

西部利得量化成长混合型发起式证券投资  
基金  
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：西部利得基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	62
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	62

7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	62
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	62
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	62
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12	投资组合报告附注	63
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>64</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	64
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	65
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>65</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>66</b>
10.1	基金份额持有人大会决议	66
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	66
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
10.4	基金投资策略的改变	66
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	66
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	66
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	66
10.8	其他重大事件	68
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>68</b>
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	68
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	69
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>69</b>
12.1	备查文件目录	69
12.2	存放地点	69
12.3	查阅方式	69

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金	
基金简称	西部利得量化成长混合	
基金主代码	000006	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 3 月 19 日	
基金管理人	西部利得基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	662,604,112.61 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	西部利得量化成长混合 A	西部利得量化成长混合 C
下属分级基金的交易代码	000006	011228
报告期末下属分级基金的份额总额	501,895,372.67 份	160,708,739.94 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过量化投资策略进行股票投资，在严格控制风险和保持资产高流动性的前提下，努力实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金主要通过多因子量化投资模型，选取并持有具有成长性的股票构成投资组合，打造成长风格，力争稳定的超越业绩基准的投资收益。（详见《基金合同》）
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*75%+同期银行活期存款利率（税后）*25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，在通常情况下其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		西部利得基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵毅	任航
	联系电话	021-38572888	010-66060069
	电子邮箱	service@westleadfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4007-007-818	95599
传真		021-50710261	010-68121816
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区耀体路 276 号 901 室-908 室	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区耀体路 276 号 901 室-908 室	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		200126	100031
法定代表人		何方	谷澍

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.westleadfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人处——上海市浦东新区耀体路 276 号晶耀商务广场 3 号楼 9 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	西部利得基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区耀体路 276 号 901 室-908 室

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)	
	西部利得量化成长混合 A	西部利得量化成长混合 C
本期已实现收益	-780,588,069.58	-482,943,985.67
本期利润	-745,345,317.18	-509,573,063.28
加权平均基金份额 本期利润	-0.8727	-1.0195
本期加权平均净 值利润率	-49.87%	-58.71%
本期基金份额净 值增长率	-22.38%	-22.70%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利 润	97,963,357.59	24,547,561.44
期末可供分配基 金份额利润	0.1952	0.1527
期末基金资产净 值	804,757,162.62	250,629,696.14
期末基金份额净 值	1.6034	1.5595
3.1.3 累计期 末指标	报告期末(2024年6月30日)	

基金份额累计净值增长率	85.27%	-17.33%
-------------	--------	---------

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用（除暂估附加税）后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益与本期暂估附加税费的合计值。

2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

西部利得量化成长混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.13%	1.17%	-5.19%	0.72%	0.06%	0.45%
过去三个月	-1.46%	1.16%	-4.82%	0.86%	3.36%	0.30%
过去六个月	-22.38%	1.51%	-6.50%	1.20%	-15.88%	0.31%
过去一年	-22.80%	1.21%	-13.12%	0.96%	-9.68%	0.25%
过去三年	-26.62%	1.32%	-20.36%	0.90%	-6.26%	0.42%
自基金合同生效起至今	85.27%	1.34%	-5.37%	0.97%	90.64%	0.37%

西部利得量化成长混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.19%	1.17%	-5.19%	0.72%	0.00%	0.45%
过去三个月	-1.66%	1.16%	-4.82%	0.86%	3.16%	0.30%
过去六个月	-22.70%	1.51%	-6.50%	1.20%	-16.20%	0.31%
过去一年	-23.43%	1.21%	-13.12%	0.96%	-10.31%	0.25%

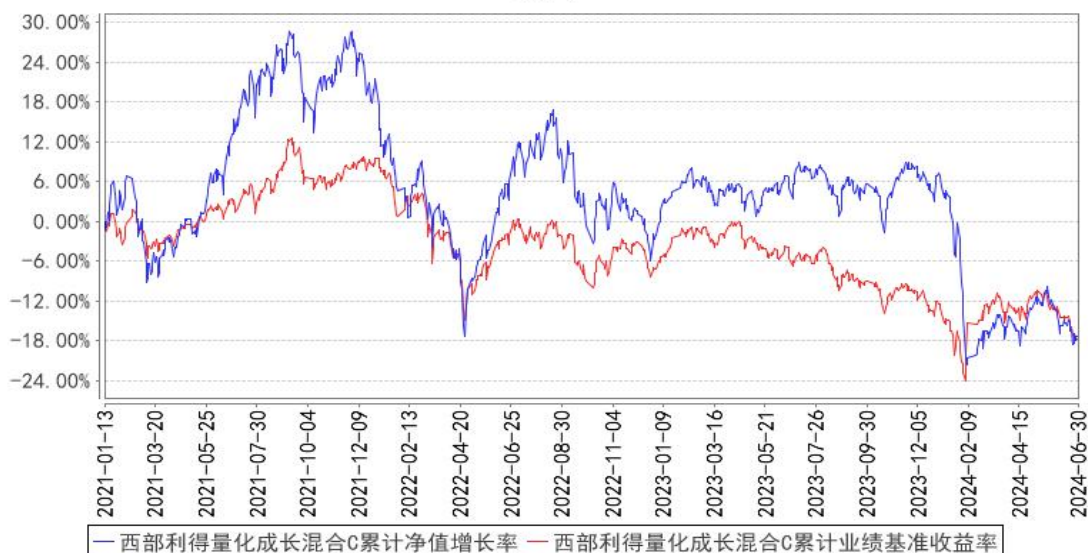
					%	
过去三年	-28.35%	1.32%	-20.36%	0.90%	-7.99%	0.42%
自基金合同生效 起至今	-17.33%	1.33%	-17.84%	0.88%	0.51%	0.45%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

西部利得量化成长混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



西部利得量化成长混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### 3.3 其他指标

无



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

西部利得基金管理有限公司于 2010 年 7 月 20 日正式成立，公司总部设在上海，在北京、深圳设有分公司，是经中国证监会批准设立的第 60 家全国规范性基金管理公司。目前公司具有公募基金、特定客户资产管理、受托管理保险资金、合格境内机构投资者资格（获批筹建）等多类别资产管理业务。

2015 年起公司逐步建立了一支前中后台密切配合的专业化团队，树立了绝对收益的投资管理方向，秉承专业稳健的投资风格，严谨科学的风险管理理念，以专业高效的服务，致力于打造良好业绩，为投资者创造长期稳定的价值。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
盛丰衍	总经理助理、投资总监、主动量化投资部总经理、基金经理	2019 年 3 月 19 日	-	11 年	复旦大学计算机应用技术专业硕士。曾任光大证券股份有限公司权益投资助理、上海光大证券资产管理有限公司研究员、兴证证券资产管理有限公司量化研究员。2016 年 10 月加入本公司，具有基金从业资格，中国国籍。

注：1. 任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》、本基金《基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

对于场内交易，本基金管理人按照时间优先、价格优先的原则，对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金，采用了系统中的公平交易模块进行操作，实现了公平交易；对于场外交易，本基金管理人按照公司制度和流程执行。

本基金管理人风险管理部负责对各账户公平交易进行事后监察，在每日公平交易报表中记录不同投资组合当天整体收益率、分投资类别（股票、债券）同向（1日、3日、5日）交易价差分析、银行间交易价格偏离度分析；并分别于季度和年度末编制公平交易季度及年度收益率差异分析报告，对本基金管理人管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）不同时间窗口同向（1日、3日、5日）交易的交易价差以及 T 检验、银行间交易价格偏离度进行了分析。

当监控到疑似异常交易时，本基金管理人风险管理部及时要求相关投资组合经理给予解释，该解释经风险管理部辨认后确认该交易无异常情况后留档备查，公平交易季报及年报由投资组合经理、督察长、总经理签署后，由风险管理部妥善保存分析报告备查。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析，公司未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

投资策略上，本基金始终维持高股票仓位，当前相对基准指数正向暴露的风格因子主要为盈利、残差波动率；负向暴露的风格因子主要为贝塔、市值。行业配置略参考中证 500 指数，股票持仓极为分散以此弱化个股黑天鹅的影响。本基金量化策略的特点是多策略，利用主观决策中长期风格，量化决策个股。本基金努力通过选股打造优质量化基金。

感谢持有人的支持，我们将继续以诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金，努力为持有人带来优异回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内基金业绩表现参见本报告第三部分“主要财务指标和基金净值表现”。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年下半年，影响 A 股的主要有三股力量。

其一是美联储降息节奏

美联储降息预期几度变化，人民币汇率和人民币资产也几经涨落。美联储降息速度可能会在未来一段时间内成为 A 股（特别是龙头股）的重要影响因素之一。

其二是中央加杠杆节奏

随着地产驱动的经济模式告一段落，居民部门、企业部门、地方政府部门的杠杆率也阶段性见顶，短期稳经济主要依赖于中央加杠杆。未来中国经济以及和经济紧密相关的股票资产表现可能取决于中央加杠杆的节奏。中央加杠杆或以对冲内外部负面压力的形式展开，危中有机。

其三是高质量发展的推进

中国经济高质量发展是未来一段时间的主旋律。高质量发展对于不同行业不同所有制企业的内涵不尽相同。对于过去贡献了大量社会正外部性的国企而言，高质量发展一般意味着 ROE 的提升；对于部分民企而言，高质量发展意味着减少社会负外部性以及增加正外部性，相关行业进入高质量替代高增速的发展模式。国企、特别是央企股票值得重点关注，它们是新时代的“核心资产”。央企股票不止是高股息资产，不少央企中小票也有投资价值，这部分市场远未定价。

整体来看，A 股权益市场估值处于历史低位区域，所以当下非常看好未来权益市场表现，结构上看好央企潜力资产，其符合当下投资者的偏好，其中央企中小票当前定价并不充分。小市值风格一季度的大幅回撤和反弹深刻影响了市场对该类资产的交易模式，该板块未来潜在的波动可能加大，但考虑到其和中证 800 指数成分股的低相关性，该板块仍有配置价值。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据相关法律法规的规定，本基金管理人制订了证券投资基金估值政策和程序，并经本基金管理人总经理办公会议审议通过成立了估值委员会。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。具体职责包括对本基金管理人估值政策和程序的制订和解释；在发生影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况，以及在采用新投资策略或投资新品种时，估值委员会负责对所采用的估值模型、假设及参数的适当性进行重新评估或修订，必要时聘请会计师事务所进行审核并出具意见。针对个别投资品种的估值方法调整，均须通过托管银行复核。

估值委员会的成员包括投资管理部、风险控制岗、监察稽核部、基金运营部等有关人员组成。基金经理如认为持仓品种的估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议，通过参与对估值问题的讨论和与估值委员会共同商定估值原则和政策等方式，对估值

议案提出反馈意见。作为公司估值委员会委员，基金经理有权投票表决有关议案。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场债券品种的估值数据及交易所交易的债券品种的估值数据、流通受限股票流动性折扣。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

可参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人以及基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—西部利得基金管理有限公司 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，西部利得基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，西部利得基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	88,408,937.10	490,829,658.84
结算备付金		10,784,635.90	64,870,723.74
存出保证金		5,780,700.22	11,943,943.22
交易性金融资产	6.4.7.2	948,783,455.62	5,131,121,279.23
其中：股票投资		948,783,455.62	5,131,121,279.23
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		10,222,761.82	65,674,951.81
应收股利		-	-
应收申购款		338,685.32	41,608,454.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,064,319,175.98	5,806,049,011.69
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,200,181.90	70,367,746.59
应付赎回款		1,834,262.90	23,472,785.16
应付管理人报酬		1,174,456.71	5,709,967.59
应付托管费		97,871.38	475,830.63
应付销售服务费		170,298.11	1,661,911.40
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	2,455,246.22	7,520,801.03
负债合计		8,932,317.22	109,209,042.40
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	662,604,112.61	2,785,758,194.44
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	392,782,746.15	2,911,081,774.85
净资产合计		1,055,386,858.76	5,696,839,969.29
负债和净资产总计		1,064,319,175.98	5,806,049,011.69

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，西部利得量化成长混合 A 基金份额净值为 1.6034 元，基金份额总额为 501,895,372.67 份；西部利得量化成长混合 C 基金份额净值为 1.5595 元，基金份额总额为 160,708,739.94 份。西部利得量化成长混合基金总份额为 662,604,112.61 份。

## 6.2 利润表

会计主体：西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-1,236,259,276.20	262,976,480.67
1. 利息收入		1,048,551.33	1,164,807.47
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,048,551.33	1,164,807.47
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,249,589,517.12	155,521,432.07
其中：股票投资收益		-1,239,481,418.06	133,954,153.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-20,546,040.69	-1,206,891.61
股利收益	6.4.7.19	10,437,941.63	22,774,170.14
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益	6.4.7.20	8,613,674.79	105,470,891.08

(损失以“-”号填列)			
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.21	3,668,014.80	819,350.05
<b>减：二、营业总支出</b>		18,659,104.26	22,363,063.93
1. 管理人报酬		13,957,537.20	18,681,347.26
2. 托管费		1,163,128.09	1,245,423.20
3. 销售服务费		3,421,068.62	2,311,220.81
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	5,539.57
8. 其他费用	6.4.7.23	117,370.35	119,533.09
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		-1,254,918,380.46	240,613,416.74
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		-1,254,918,380.46	240,613,416.74
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-1,254,918,380.46	240,613,416.74

### 6.3 净资产变动表

会计主体：西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024年1月1日至2024年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,785,758,194.44	2,911,081,774.85	5,696,839,969.29
二、本期期初净资产	2,785,758,194.44	2,911,081,774.85	5,696,839,969.29
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-2,123,154,081.83	-2,518,299,028.70	-4,641,453,110.53
(一)、综合收益总额	-	-1,254,918,380.46	-1,254,918,380.46
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-2,123,154,081.83	-1,263,380,648.24	-3,386,534,730.07

号填列)			
其中:1. 基金申购款	327,005,823.12	277,911,812.66	604,917,635.78
2. 基金赎回款	-2,450,159,904.95	-1,541,292,460.90	-3,991,452,365.85
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	662,604,112.61	392,782,746.15	1,055,386,858.76
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	894,551,836.89	779,459,592.75	1,674,011,429.64
二、本期期初净资产	894,551,836.89	779,459,592.75	1,674,011,429.64
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	868,566,627.04	1,095,570,473.07	1,964,137,100.11
(一)、综合收益总额	-	240,613,416.74	240,613,416.74
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	868,566,627.04	854,957,056.33	1,723,523,683.37
其中:1. 基金申购款	1,115,940,802.17	1,099,933,678.10	2,215,874,480.27
2. 基金赎回款	-247,374,175.13	-244,976,621.77	-492,350,796.90
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	1,763,118,463.93	1,875,030,065.82	3,638,148,529.75

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

贺燕萍

贺燕萍

张皞骏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人



## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]第 189 号《关于准予西部利得量化阿尔法混合型证券投资基金变更注册的批复》核准,由西部利得基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 177,836,375.57 元,业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第 1900164 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2019 年 3 月 19 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 177,856,344.09 份基金份额,其中认购资金利息折合 19,968.52 份基金份额。本基金的基金管理人为西部利得基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债券、短期融资券(含超短期融资券)、中期票据、资产支持证券、次级债券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的 60%-95%。基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率\*75%+同期银行活期存款利率(税后)\*25%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业

协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 06 月 30 日的财务状况、2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期未发生重大会计政策和会计估计变更。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(b) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(d) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	88,408,937.10
等于：本金	88,387,408.30
加：应计利息	21,528.80
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-

其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	88,408,937.10

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,003,234,469.11	-	948,783,455.62	-54,451,013.49
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,003,234,469.11	-	948,783,455.62	-54,451,013.49

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	32,887,600.00	-	-	-
其中：股指期货	32,887,600.00	-	-	-

投资				
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	32,887,600.00	-	-	-

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则（试行）》及《企业会计准则——金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具——股指期货投资”与“证券清算款——股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具——股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2407	IM2407	34.00	33,034,400.00	146,800.00
合计				146,800.00
减：可抵销期货暂收款				146,800.00
净额				-

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末未持有债权投资。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末发生债权投资减值准备。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

**6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

本基金本报告期末未发生其他债权投资减值准备。

**6.4.7.7 其他权益工具投资****6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

**6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

**6.4.7.8 其他资产**

本基金本报告期末未持有其他资产。

**6.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	840.98
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,363,902.10
其中：交易所市场	2,363,902.10
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	90,503.14
合计	2,455,246.22

**6.4.7.10 实收基金**

金额单位：人民币元

## 西部利得量化成长混合 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,592,525,025.77	1,592,525,025.77
本期申购	156,972,271.89	156,972,271.89
本期赎回（以“-”号填列）	-1,247,601,924.99	-1,247,601,924.99
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	501,895,372.67	501,895,372.67

## 西部利得量化成长混合 C

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
----	----------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,193,233,168.67	1,193,233,168.67
本期申购	170,033,551.23	170,033,551.23
本期赎回（以“-”号填列）	-1,202,557,979.96	-1,202,557,979.96
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	160,708,739.94	160,708,739.94

注：申购含红利再投资、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

##### 西部利得量化成长混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,219,667,409.35	477,353,106.40	1,697,020,515.75
本期期初	1,219,667,409.35	477,353,106.40	1,697,020,515.75
本期利润	-780,588,069.58	35,242,752.40	-745,345,317.18
本期基金份额交易产生的变动数	-341,115,982.18	-307,697,426.44	-648,813,408.62
其中：基金申购款	68,461,102.51	60,070,979.12	128,532,081.63
基金赎回款	-409,577,084.69	-367,768,405.56	-777,345,490.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	97,963,357.59	204,898,432.36	302,861,789.95

##### 西部利得量化成长混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	855,201,740.66	358,859,518.44	1,214,061,259.10
本期期初	855,201,740.66	358,859,518.44	1,214,061,259.10
本期利润	-482,943,985.67	-26,629,077.61	-509,573,063.28
本期基金份额交易产生的变动数	-347,710,193.55	-266,857,046.07	-614,567,239.62
其中：基金申购款	102,296,555.46	47,083,175.57	149,379,731.03
基金赎回款	-450,006,749.01	-313,940,221.64	-763,946,970.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	24,547,561.44	65,373,394.76	89,920,956.20

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	883,438.29

定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	142,367.16
其他	22,745.88
合计	1,048,551.33

注：其他包括结算保证金利息收入和申购款利息收入。

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,239,481,418.06
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-1,239,481,418.06

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	11,253,621,163.73
减：卖出股票成本总额	12,476,164,676.55
减：交易费用	16,937,905.24
买卖股票差价收入	-1,239,481,418.06

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无股票出借差价收入。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。



**6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期无债券申购差价收入。

**6.4.7.16 资产支持证券投资收益****6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

**6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期无资产支持证券赎回差价收入。

**6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期无资产支持证券申购差价收入。

**6.4.7.17 贵金属投资收益****6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期末持有贵金属。

**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期末持有贵金属。

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期末持有贵金属。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期末持有贵金属。

**6.4.7.18 衍生工具收益****6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	-20,546,040.69

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	10,437,941.63

其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	10,437,941.63

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	7,737,574.79
股票投资	7,737,574.79
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	876,100.00
权证投资	-
期货投资	876,100.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	8,613,674.79

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	3,652,382.45
基金转换费收入	15,632.35
合计	3,668,014.80

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额不低于 25% 的部分归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费不低于 25% 的部分归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	30,830.80
信息披露费	59,672.34

证券出借违约金	-
银行费用	26,867.21
合计	117,370.35

#### 6.4.7.24 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
西部利得基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
西部证券股份有限公司	基金管理人的股东
利得科技有限公司	基金管理人的股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	13,957,537.20	18,681,347.26
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,761,987.99	3,561,458.03
应支付基金管理人的净管理费	11,195,549.21	15,119,889.23

注：支付基金管理人西部利得基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.20% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,163,128.09	1,245,423.20

注：支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	西部利得量化成长混 合 A	西部利得量化成长混 合 C	合计
西部利得基金管理有限公司	-	1,615,357.85	1,615,357.85
西部证券股份有限公司	-	2,955.06	2,955.06
中国农业银行股份有限公司	-	-	-

合计	-	1,618,312.91	1,618,312.91
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	西部利得量化成长混合 A	西部利得量化成长混合 C	合计
西部利得基金管理有限公司	-	1,370,549.62	1,370,549.62
西部证券股份有限公司	-	3,633.96	3,633.96
中国农业银行股份有限公司	-	-	-
合计	-	1,374,183.58	1,374,183.58

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.8% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给西部利得基金管理有限公司，再由西部利得基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.8\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	西部利得量化成长混合 A	西部利得量化成长混合 C
基金合同生效日（2019 年 3 月 19 日）持有的基金份额	10,000,600.00	-
报告期初持有的基金份额	7,629,935.47	-
报告期间申购/买入总份额	0.00	-

报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	7,629,935.47	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.1515%	-
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	西部利得量化成长混合 A	西部利得量化成长混合 C
基金合同生效日（2019年3月19日）持有的基金份额	10,000,600.00	-
报告期初持有的基金份额	5,050,605.20	-
报告期间申购/买入总份额	0.00	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	5,050,605.20	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.2865%	-

注：本基金本报告期末及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资西部利得量化成长混合 C。

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	88,408,937.10	883,438.29	302,966,148.22	1,011,099.44

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

2. 本基金通过“中国农业银行股份有限公司基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2024年06月30日的相关余额为人民币4,660,177.63元。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001359	平安电工	2024年3月19日	6个月	锁定期	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001379	腾达科技	2024年1月11日	6个月	锁定期	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
001387	雪祺电气	2024年1月4日	6个月	锁定期	15.38	15.25	133	2,045.54	2,028.25	-
001387	雪祺电气	2024年6月3日	6个月	锁定期	-	15.25	40	-	610.00	锁定期内送股
001389	广合科技	2024年3月26日	6个月	锁定期	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-

		日									
002224	三力士	2024年2月29日	6个月	锁定期	4.21	3.74	4,988,123	20,999,997.83	18,655,580.02	-	
300162	雷曼光电	2023年12月29日	6个月	锁定期	6.59	7.06	4,552,352	29,999,999.68	32,139,605.12	-	
300616	尚品宅配	2024年2月7日	6个月	锁定期	15.01	10.73	438,399	6,580,368.99	4,704,021.27	-	
301392	汇成真空	2024年5月28日	6个月	锁定期	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-	
301502	华阳智能	2024年1月26日	6个月	锁定期	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-	
301536	星辰科技	2024年3月20日	6个月	锁定期	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-	
301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月	锁定期	55.82	91.24	107	5,972.74	9,762.68	-	
301538	骏鼎达	2024年5月22日	6个月	锁定期	-	91.24	43	-	3,923.32	锁定期内送股	
301539	宏鑫	2024年	6个月	锁定期	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-	



	科技	4月3日		期							
301565	中仑新材	2024年6月13日	6个月	锁定期	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-	
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	锁定期	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-	
301580	爱迪特	2024年6月19日	6个月	锁定期	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-	
301587	中瑞股份	2024年3月27日	6个月	锁定期	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-	
301588	美新科技	2024年3月6日	6个月	锁定期	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-	
301589	诺瓦星云	2024年2月1日	6个月	锁定期	126.89	188.01	691	87,680.99	129,914.91	-	
301589	诺瓦星云	2024年5月30日	6个月	锁定期	-	188.01	553	-	103,969.53	锁定期内送股	
301591	肯特股份	2024年2月20日	6个月	锁定期	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-	
601033	永兴	2024年	6个月	锁定	16.20	15.96	1,258	20,379.60	20,077.68	-	

	股份	1月11日		期						
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	锁定期	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603185	弘元绿能	2024年2月1日	6个月	锁定期	25.22	16.71	1,189,532	29,999,997.04	19,877,079.72	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	1,287	24,002.55	24,002.55	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	锁定期	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月	锁定期	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1个月内(含)	新股未上市	20.56	20.56	1,051	21,608.56	21,608.56	-
603375	盛景微	2024年1月17日	6个月	锁定期	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603381	永臻股份	2024年6月19日	6个月	锁定期	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
603396	金辰股份	2024年1月23日	6个月	锁定期	44.39	31.87	675,827	29,999,960.53	21,538,606.49	-

		日								
688530	欧莱新材	2024年4月29日	6个月	锁定期	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	6个月	锁定期	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	锁定期	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
688695	中创股份	2024年3月6日	6个月	锁定期	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括信用风险、流动性风险、市场风险等。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人实行全员参与的全面风险管理，董事会及其下设合规审核委员会、监事会、经营管理层及其下设合规及风险管理委员会、督察长、风险管理部、监察稽核部、各业务部门和分支机构均根据公司制度规定履行各自的风险管理职责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去

估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用风险评估、交易对手分类管理、投资比例控制等方式来管控信用风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在信用良好的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金于本报告期末及上年度末均未持有债券、资产支持证券、同业存单，因此无相关重大信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类：

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	88,408,937.10	-	-	-	88,408,937.10
结算备付金	10,784,635.90	-	-	-	10,784,635.90
存出保证金	5,780,700.22	-	-	-	5,780,700.22
交易性金融资产	-	-	-	948,783,455.62	948,783,455.62
应收申购款	70,116.08	-	-	268,569.24	338,685.32

应收清算款	-	-	-	10,222,761.82	10,222,761.82
资产总计	105,044,389.30	-	-	-959,274,786.68	1,064,319,175.98
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,834,262.90	1,834,262.90
应付管理人报酬	-	-	-	1,174,456.71	1,174,456.71
应付托管费	-	-	-	97,871.38	97,871.38
应付清算款	-	-	-	3,200,181.90	3,200,181.90
应付销售服务费	-	-	-	170,298.11	170,298.11
其他负债	-	-	-	2,455,246.22	2,455,246.22
负债总计	-	-	-	8,932,317.22	8,932,317.22
利率敏感度缺口	105,044,389.30	-	-	-950,342,469.46	1,055,386,858.76
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	490,829,658.84	-	-	-	490,829,658.84
结算备付金	64,870,723.74	-	-	-	64,870,723.74
存出保证金	11,943,943.22	-	-	-	11,943,943.22
交易性金融资产	-	-	-	5,131,121,279.23	5,131,121,279.23
应收申购款	-	-	-	41,608,454.85	41,608,454.85
应收清算款	-	-	-	65,674,951.81	65,674,951.81
资产总计	567,644,325.80	-	-	5,238,404,685.89	5,806,049,011.69
负债					
应付赎回款	-	-	-	23,472,785.16	23,472,785.16
应付管理人报酬	-	-	-	5,709,967.59	5,709,967.59
应付托管费	-	-	-	475,830.63	475,830.63
应付清算款	-	-	-	70,367,746.59	70,367,746.59
应付销售服务费	-	-	-	1,661,911.40	1,661,911.40
其他负债	-	-	-	7,520,801.03	7,520,801.03
负债总计	-	-	-	109,209,042.40	109,209,042.40
利率敏感度缺口	567,644,325.80	-	-	5,129,195,643.49	5,696,839,969.29

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2024 年 6 月 30 日，本基金主要投资于权益类金融工具，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响（2023 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

于 6 月 30 日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	948,783,455.62	89.90	5,131,121,279.23	90.07
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	948,783,455.62	89.90	5,131,121,279.23	90.07

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5% 的影响金额	60,917,000.00	342,953,000.00
	业绩比较基准下降 5% 的影响金额	-60,917,000.00	-342,953,000.00

## 6.4.14 公允价值

### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	851,372,696.25	5,057,518,136.44
第二层次	45,611.11	-
第三层次	97,365,148.26	73,603,142.79
合计	948,783,455.62	5,131,121,279.23

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2024年6月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2023年12月31日：无)。

### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

## 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于2024年6月30日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元



序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	948,783,455.62	89.14
	其中：股票	948,783,455.62	89.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	99,193,573.00	9.32
8	其他各项资产	16,342,147.36	1.54
9	合计	1,064,319,175.98	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	7,318,877.44	0.69
B	采矿业	24,444,469.80	2.32
C	制造业	644,050,048.79	61.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,823,552.98	2.35
E	建筑业	27,927,123.00	2.65
F	批发和零售业	23,638,337.06	2.24
G	交通运输、仓储和邮政业	13,334,643.00	1.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	48,831,746.38	4.63
J	金融业	90,407,238.04	8.57
K	房地产业	5,830,381.00	0.55
L	租赁和商务服务业	3,136,656.00	0.30
M	科学研究和技术服务业	14,658,480.25	1.39
N	水利、环境和公共设施管理业	11,056,600.88	1.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,457,773.00	0.23
Q	卫生和社会工作	539,595.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	6,327,933.00	0.60
S	综合	-	-
	合计	948,783,455.62	89.90

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300162	雷曼光电	4,552,352	32,139,605.12	3.05
2	002735	王子新材	2,428,891	23,875,998.53	2.26
3	603396	金辰股份	675,827	21,538,606.49	2.04
4	603185	弘元绿能	1,189,532	19,877,079.72	1.88
5	002224	三力士	4,988,123	18,655,580.02	1.77
6	600050	中国联通	2,092,839	9,836,343.30	0.93
7	000725	京东方 A	2,265,800	9,267,122.00	0.88
8	601668	中国建筑	1,572,000	8,347,320.00	0.79
9	600000	XD 浦发银	975,412	8,027,640.76	0.76
10	601728	中国电信	1,302,100	8,007,915.00	0.76
11	601319	中国人保	1,526,100	7,859,415.00	0.74
12	601766	中国中车	991,800	7,448,418.00	0.71
13	600519	贵州茅台	5,000	7,336,950.00	0.70
14	601877	正泰电器	367,900	7,012,174.00	0.66
15	000333	美的集团	104,400	6,733,800.00	0.64
16	000651	格力电器	165,100	6,475,222.00	0.61
17	600887	伊利股份	228,700	5,909,608.00	0.56
18	601800	中国交建	607,900	5,434,626.00	0.51
19	601328	交通银行	726,800	5,429,196.00	0.51
20	601607	上海医药	282,450	5,397,619.50	0.51
21	002001	新和成	279,053	5,357,817.60	0.51
22	300760	迈瑞医疗	18,400	5,352,744.00	0.51
23	601229	上海银行	705,700	5,123,382.00	0.49
24	300616	尚品宅配	469,399	5,046,881.27	0.48
25	601398	工商银行	847,800	4,832,460.00	0.46
26	002415	海康威视	147,100	4,546,861.00	0.43
27	600183	生益科技	206,600	4,350,996.00	0.41
28	600018	上港集团	740,100	4,277,778.00	0.41
29	600741	华域汽车	261,146	4,277,571.48	0.41
30	600989	宝丰能源	246,100	4,264,913.00	0.40
31	600028	中国石化	671,290	4,242,552.80	0.40
32	601658	邮储银行	829,100	4,203,537.00	0.40
33	000568	泸州老窖	29,200	4,189,908.00	0.40
34	601600	中国铝业	548,300	4,183,529.00	0.40
35	600999	招商证券	299,000	4,159,090.00	0.39
36	600104	上汽集团	299,900	4,156,614.00	0.39

37	601939	建设银行	552,600	4,089,240.00	0.39
38	601236	红塔证券	636,600	4,086,972.00	0.39
39	600875	东方电气	216,200	3,988,890.00	0.38
40	600089	特变电工	287,150	3,982,770.50	0.38
41	002007	华兰生物	248,500	3,923,815.00	0.37
42	300919	中伟股份	124,460	3,857,015.40	0.37
43	600795	国电电力	639,700	3,831,803.00	0.36
44	600690	海尔智家	131,400	3,729,132.00	0.35
45	688138	清溢光电	171,400	3,685,100.00	0.35
46	601899	紫金矿业	207,800	3,651,046.00	0.35
47	000800	一汽解放	463,800	3,631,554.00	0.34
48	000157	中联重科	453,900	3,485,952.00	0.33
49	600015	华夏银行	530,824	3,397,273.60	0.32
50	601390	中国中铁	497,000	3,240,440.00	0.31
51	600406	国电南瑞	128,500	3,207,360.00	0.30
52	601717	郑煤机	215,600	3,190,880.00	0.30
53	600642	申能股份	358,006	3,161,192.98	0.30
54	601989	中国重工	630,200	3,106,886.00	0.29
55	600062	华润双鹤	154,700	3,029,026.00	0.29
56	002841	视源股份	98,354	2,904,393.62	0.28
57	601702	华峰铝业	153,500	2,802,910.00	0.27
58	600030	中信证券	152,190	2,774,423.70	0.26
59	601688	华泰证券	223,200	2,765,448.00	0.26
60	601088	中国神华	62,200	2,759,814.00	0.26
61	300673	佩蒂股份	210,100	2,756,512.00	0.26
62	000100	TCL 科技	631,900	2,729,808.00	0.26
63	600036	招商银行	79,300	2,711,267.00	0.26
64	600905	三峡能源	621,700	2,710,612.00	0.26
65	002273	水晶光电	159,381	2,706,289.38	0.26
66	002241	歌尔股份	138,500	2,702,135.00	0.26
67	688187	时代电气	54,437	2,688,099.06	0.25
68	601318	中国平安	64,983	2,687,696.88	0.25
69	600941	中国移动	24,900	2,676,750.00	0.25
70	000617	中油资本	481,000	2,655,120.00	0.25
71	600803	新奥股份	124,500	2,589,600.00	0.25
72	000166	申万宏源	599,400	2,583,414.00	0.24
73	300433	蓝思科技	138,770	2,532,552.50	0.24
74	002595	豪迈科技	65,500	2,500,135.00	0.24
75	600186	莲花控股	705,800	2,420,894.00	0.23
76	002053	云南能投	199,100	2,407,119.00	0.23
77	300005	探路者	476,000	2,384,760.00	0.23
78	002315	焦点科技	88,200	2,377,872.00	0.23
79	600968	海油发展	576,500	2,375,180.00	0.23

80	603337	杰克股份	89,600	2,358,272.00	0.22
81	002284	亚太股份	347,100	2,346,396.00	0.22
82	002938	鹏鼎控股	58,900	2,341,864.00	0.22
83	300743	天地数码	171,600	2,323,464.00	0.22
84	002302	西部建设	445,900	2,318,680.00	0.22
85	300192	科德教育	233,000	2,288,060.00	0.22
86	601500	通用股份	425,300	2,271,102.00	0.22
87	003023	彩虹集团	141,100	2,250,545.00	0.21
88	002066	瑞泰科技	281,800	2,240,310.00	0.21
89	600444	国机通用	184,500	2,234,295.00	0.21
90	002035	华帝股份	357,700	2,228,471.00	0.21
91	600099	林海股份	321,100	2,209,168.00	0.21
92	601985	中国核电	204,300	2,177,838.00	0.21
93	000895	双汇发展	88,200	2,096,514.00	0.20
94	300428	立中集团	112,300	2,087,657.00	0.20
95	300387	富邦股份	348,100	2,085,119.00	0.20
96	603041	美思德	203,000	2,030,000.00	0.19
97	601166	兴业银行	115,200	2,029,824.00	0.19
98	300750	宁德时代	10,900	1,962,327.00	0.19
99	000920	沃顿科技	262,000	1,920,460.00	0.18
100	601857	中国石油	182,800	1,886,496.00	0.18
101	002057	中钢天源	265,700	1,859,900.00	0.18
102	600876	凯盛新能	196,400	1,854,016.00	0.18
103	600469	风神股份	312,100	1,822,664.00	0.17
104	300962	中金辐照	133,200	1,816,848.00	0.17
105	000985	大庆华科	143,700	1,810,620.00	0.17
106	600148	长春一东	152,000	1,808,800.00	0.17
107	601988	中国银行	390,500	1,804,110.00	0.17
108	002180	纳思达	68,200	1,801,844.00	0.17
109	601225	陕西煤业	69,800	1,798,746.00	0.17
110	002205	国统股份	286,800	1,798,236.00	0.17
111	600636	国新文化	238,700	1,790,250.00	0.17
112	603698	航天工程	148,800	1,781,136.00	0.17
113	600379	宝光股份	213,900	1,773,231.00	0.17
114	301137	哈焊华通	121,400	1,768,798.00	0.17
115	600980	北矿科技	135,400	1,764,262.00	0.17
116	600560	金自天正	131,100	1,756,740.00	0.17
117	002017	东信和平	210,800	1,755,964.00	0.17
118	002059	云南旅游	372,500	1,754,475.00	0.17
119	600495	晋西车轴	544,000	1,746,240.00	0.17
120	000852	石化机械	325,600	1,745,216.00	0.17
121	600081	东风科技	199,030	1,741,512.50	0.17
122	002046	国机精工	171,200	1,741,104.00	0.16

123	002935	天奥电子	143,920	1,738,553.60	0.16
124	300516	久之洋	60,500	1,736,955.00	0.16
125	002189	中光学	124,500	1,735,530.00	0.16
126	000962	东方钨业	169,900	1,734,679.00	0.16
127	688009	中国通号	289,100	1,734,600.00	0.16
128	000731	四川美丰	261,600	1,734,408.00	0.16
129	600698	湖南天雁	509,300	1,726,527.00	0.16
130	000720	新能泰山	716,100	1,725,801.00	0.16
131	600962	国投中鲁	144,200	1,724,632.00	0.16
132	603126	中材节能	315,700	1,720,565.00	0.16
133	600523	贵航股份	173,700	1,719,630.00	0.16
134	300105	龙源技术	266,100	1,719,006.00	0.16
135	300388	节能国祯	309,800	1,716,292.00	0.16
136	600433	冠豪高新	647,550	1,716,007.50	0.16
137	600506	统一股份	138,200	1,710,916.00	0.16
138	002819	东方中科	81,100	1,709,588.00	0.16
139	000815	美利云	237,700	1,709,063.00	0.16
140	002419	天虹股份	408,800	1,708,784.00	0.16
141	600262	北方股份	103,900	1,707,077.00	0.16
142	002106	莱宝高科	156,600	1,706,940.00	0.16
143	300797	钢研纳克	184,150	1,705,229.00	0.16
144	000798	中水渔业	302,128	1,700,980.64	0.16
145	301175	中科环保	387,300	1,700,247.00	0.16
146	301311	昆船智能	92,500	1,700,150.00	0.16
147	002190	成飞集成	120,200	1,697,224.00	0.16
148	000819	岳阳兴长	94,900	1,695,863.00	0.16
149	601226	华电重工	345,800	1,694,420.00	0.16
150	600391	航发科技	110,900	1,691,225.00	0.16
151	600313	农发种业	302,500	1,690,975.00	0.16
152	600581	八一钢铁	638,000	1,690,700.00	0.16
153	603013	亚普股份	125,500	1,690,485.00	0.16
154	002462	嘉事堂	154,400	1,689,136.00	0.16
155	000777	中核科技	110,500	1,688,440.00	0.16
156	600449	宁夏建材	143,200	1,682,600.00	0.16
157	002140	东华科技	217,100	1,682,525.00	0.16
158	002314	南山控股	812,700	1,682,289.00	0.16
159	600292	远达环保	358,500	1,681,365.00	0.16
160	600135	乐凯胶片	344,200	1,679,696.00	0.16
161	601606	长城军工	175,700	1,679,692.00	0.16
162	601360	三六零	218,600	1,678,848.00	0.16
163	688119	中钢洛耐	509,229	1,675,363.41	0.16
164	601186	中国铁建	195,300	1,673,721.00	0.16
165	000858	五粮液	13,063	1,672,586.52	0.16

166	000026	飞亚达	189,800	1,672,138.00	0.16
167	688509	正元地信	577,440	1,668,801.60	0.16
168	002777	久远银海	111,300	1,668,387.00	0.16
169	300847	中船汉光	115,000	1,666,350.00	0.16
170	003019	宸展光电	65,631	1,662,433.23	0.16
171	000881	中广核技	257,600	1,658,944.00	0.16
172	002258	利尔化学	206,600	1,656,932.00	0.16
173	300087	荃银高科	268,010	1,656,301.80	0.16
174	688334	西高院	102,500	1,650,250.00	0.16
175	000713	丰乐种业	303,800	1,649,634.00	0.16
176	601968	宝钢包装	352,300	1,648,764.00	0.16
177	688586	江航装备	177,100	1,647,030.00	0.16
178	600230	沧州大化	162,200	1,643,086.00	0.16
179	300548	博创科技	84,200	1,641,058.00	0.16
180	300523	辰安科技	108,500	1,637,265.00	0.16
181	600158	XD 中体产	212,800	1,636,432.00	0.16
182	000503	国新健康	244,800	1,632,816.00	0.15
183	688456	有研粉材	61,200	1,632,204.00	0.15
184	603328	依顿电子	207,300	1,629,378.00	0.15
185	688285	高铁电气	253,300	1,628,719.00	0.15
186	000059	华锦股份	387,900	1,625,301.00	0.15
187	000635	英力特	277,400	1,622,790.00	0.15
188	603060	国检集团	277,780	1,622,235.20	0.15
189	688707	振华新材	166,029	1,617,122.46	0.15
190	000698	沈阳化工	529,200	1,608,768.00	0.15
191	600990	四创电子	91,400	1,604,070.00	0.15
192	688552	航天南湖	98,400	1,594,080.00	0.15
193	688128	中国电研	92,568	1,593,095.28	0.15
194	600963	岳阳林纸	433,300	1,590,211.00	0.15
195	002116	中国海诚	170,600	1,588,286.00	0.15
196	000922	佳电股份	132,800	1,584,304.00	0.15
197	600268	国电南自	275,760	1,574,589.60	0.15
198	600332	白云山	53,500	1,569,155.00	0.15
199	301309	万得凯	60,400	1,543,824.00	0.15
200	002246	北化股份	183,200	1,540,712.00	0.15
201	002252	上海莱士	196,800	1,538,976.00	0.15
202	601169	北京银行	263,100	1,536,504.00	0.15
203	000027	深圳能源	207,200	1,512,560.00	0.14
204	003010	若羽臣	141,940	1,501,725.20	0.14
205	002774	快意电梯	234,200	1,487,170.00	0.14
206	301296	新巨丰	205,800	1,483,818.00	0.14
207	002536	飞龙股份	155,400	1,479,408.00	0.14
208	603823	百合花	152,800	1,477,576.00	0.14

209	002736	国信证券	168,000	1,459,920.00	0.14
210	603173	福斯达	67,000	1,454,570.00	0.14
211	600362	江西铜业	60,800	1,439,744.00	0.14
212	600866	星湖科技	259,300	1,431,336.00	0.14
213	600011	华能国际	147,700	1,420,874.00	0.13
214	300446	航天智造	118,400	1,408,960.00	0.13
215	600184	光电股份	164,700	1,401,597.00	0.13
216	300652	雷迪克	70,000	1,388,100.00	0.13
217	601006	大秦铁路	192,900	1,381,164.00	0.13
218	600027	华电国际	197,900	1,373,426.00	0.13
219	002943	宇晶股份	66,400	1,372,488.00	0.13
220	605128	上海沿浦	49,092	1,369,175.88	0.13
221	601818	光大银行	431,400	1,367,538.00	0.13
222	601698	中国卫通	96,500	1,359,685.00	0.13
223	600019	宝钢股份	204,263	1,358,348.95	0.13
224	601009	南京银行	130,700	1,357,973.00	0.13
225	600196	复星医药	59,429	1,315,758.06	0.12
226	601108	财通证券	198,110	1,309,507.10	0.12
227	600919	江苏银行	175,600	1,304,708.00	0.12
228	600460	士兰微	72,400	1,267,724.00	0.12
229	601919	中远海控	81,000	1,254,690.00	0.12
230	601998	中信银行	187,100	1,253,570.00	0.12
231	600016	民生银行	325,800	1,234,782.00	0.12
232	002475	立讯精密	30,700	1,206,817.00	0.11
233	002185	华天科技	147,600	1,202,940.00	0.11
234	000999	华润三九	27,820	1,184,575.60	0.11
235	301008	宏昌科技	67,800	1,183,788.00	0.11
236	600346	恒力石化	84,600	1,180,170.00	0.11
237	600707	彩虹股份	172,600	1,175,406.00	0.11
238	002236	大华股份	74,100	1,145,586.00	0.11
239	601898	中煤能源	90,500	1,129,440.00	0.11
240	688036	传音控股	14,420	1,103,706.80	0.10
241	600039	四川路桥	137,600	1,085,664.00	0.10
242	603993	洛阳钼业	127,300	1,082,050.00	0.10
243	603055	台华新材	104,900	1,062,637.00	0.10
244	601699	潞安环能	58,100	1,053,353.00	0.10
245	301323	新莱福	32,900	1,038,982.00	0.10
246	601138	工业富联	37,600	1,030,240.00	0.10
247	601000	唐山港	214,400	1,007,680.00	0.10
248	600582	天地科技	145,900	1,005,251.00	0.10
249	000708	中信特钢	73,942	1,003,392.94	0.10
250	002027	分众传媒	164,700	998,082.00	0.09
251	601231	环旭电子	61,797	991,841.85	0.09

252	300383	光环新网	116,721	986,292.45	0.09
253	300054	鼎龙股份	42,900	972,972.00	0.09
254	002152	广电运通	92,900	971,734.00	0.09
255	601601	中国太保	34,700	966,742.00	0.09
256	603833	欧派家居	18,014	964,829.84	0.09
257	600901	江苏金租	189,000	954,450.00	0.09
258	600282	南钢股份	190,600	949,188.00	0.09
259	000997	新大陆	67,900	944,489.00	0.09
260	601098	中南传媒	75,900	942,678.00	0.09
261	002430	杭氧股份	41,800	930,050.00	0.09
262	600025	华能水电	85,900	926,002.00	0.09
263	000425	徐工机械	126,100	901,615.00	0.09
264	002429	兆驰股份	186,800	898,508.00	0.09
265	300253	卫宁健康	152,000	896,800.00	0.08
266	301053	远信工业	44,900	896,204.00	0.08
267	600585	海螺水泥	37,972	895,759.48	0.08
268	600588	用友网络	88,000	880,000.00	0.08
269	300703	创源股份	108,300	875,064.00	0.08
270	300789	唐源电气	65,682	869,629.68	0.08
271	601555	东吴证券	147,300	869,070.00	0.08
272	002304	洋河股份	10,700	863,918.00	0.08
273	600801	华新水泥	62,000	852,500.00	0.08
274	002648	卫星化学	47,300	850,454.00	0.08
275	688026	洁特生物	85,300	849,588.00	0.08
276	600998	九州通	173,962	848,934.56	0.08
277	000050	深天马 A	116,300	846,664.00	0.08
278	001209	洪兴股份	61,300	845,940.00	0.08
279	600299	安迪苏	85,500	829,350.00	0.08
280	301298	东利机械	64,900	827,475.00	0.08
281	002998	优彩资源	145,800	826,686.00	0.08
282	600188	兖矿能源	36,300	825,099.00	0.08
283	000983	山西焦煤	79,900	823,769.00	0.08
284	688203	海正生材	95,988	815,898.00	0.08
285	688459	哈铁科技	97,800	802,938.00	0.08
286	002084	海鸥住工	326,700	800,415.00	0.08
287	600637	东方明珠	131,618	800,237.44	0.08
288	300694	蠡湖股份	94,000	799,940.00	0.08
289	600967	内蒙一机	110,400	794,880.00	0.08
290	002465	海格通信	74,700	773,892.00	0.07
291	601216	君正集团	209,100	771,579.00	0.07
292	601928	凤凰传媒	68,700	752,952.00	0.07
293	002294	信立泰	28,000	745,640.00	0.07
294	000933	神火股份	36,600	740,418.00	0.07



295	600909	华安证券	172,900	727,909.00	0.07
296	000636	风华高科	55,200	720,912.00	0.07
297	688366	昊海生科	11,560	713,020.80	0.07
298	600480	凌云股份	71,500	702,845.00	0.07
299	601568	北元集团	182,000	675,220.00	0.06
300	603612	索通发展	51,500	657,140.00	0.06
301	002245	蔚蓝锂芯	84,200	652,550.00	0.06
302	603008	喜临门	37,500	649,875.00	0.06
303	003022	联泓新科	47,000	644,370.00	0.06
304	600970	中材国际	53,300	642,798.00	0.06
305	301326	捷邦科技	19,600	637,784.00	0.06
306	301365	矩阵股份	58,000	637,420.00	0.06
307	000728	国元证券	103,900	629,634.00	0.06
308	600586	金晶科技	108,300	628,140.00	0.06
309	003041	真爱美家	51,400	627,594.00	0.06
310	000768	中航西飞	25,700	617,571.00	0.06
311	300035	中科电气	71,700	610,167.00	0.06
312	300588	熙菱信息	78,400	606,816.00	0.06
313	600380	XD 健康元	54,317	606,720.89	0.06
314	688455	科捷智能	75,519	606,417.57	0.06
315	603806	福斯特	41,100	604,170.00	0.06
316	002420	毅昌科技	131,600	600,096.00	0.06
317	600764	中国海防	30,300	594,789.00	0.06
318	300235	方直科技	74,000	593,480.00	0.06
319	300153	科泰电源	99,400	591,430.00	0.06
320	300780	德恩精工	43,800	590,862.00	0.06
321	000066	中国长城	67,400	589,750.00	0.06
322	688379	华光新材	42,957	588,940.47	0.06
323	300553	集智股份	24,000	587,760.00	0.06
324	688613	奥精医疗	46,000	585,580.00	0.06
325	600097	开创国际	71,000	584,330.00	0.06
326	002909	集泰股份	142,500	584,250.00	0.06
327	301001	凯淳股份	32,900	580,027.00	0.05
328	300234	开尔新材	146,000	579,620.00	0.05
329	002949	华阳国际	61,500	578,715.00	0.05
330	603331	百达精工	63,800	578,666.00	0.05
331	002517	恺英网络	60,550	578,252.50	0.05
332	688819	天能股份	24,171	576,720.06	0.05
333	300610	晨化股份	65,400	573,558.00	0.05
334	300001	特锐德	28,500	573,420.00	0.05
335	301192	泰祥股份	33,200	573,032.00	0.05
336	002497	雅化集团	64,200	572,664.00	0.05
337	300549	优德精密	42,300	571,896.00	0.05

338	300692	中环环保	123,500	571,805.00	0.05
339	300746	汉嘉设计	91,000	571,480.00	0.05
340	300865	大宏立	35,600	571,024.00	0.05
341	600356	恒丰纸业	96,400	570,688.00	0.05
342	000039	中集集团	61,600	570,416.00	0.05
343	301167	建研设计	49,000	570,360.00	0.05
344	605287	德才股份	45,300	570,327.00	0.05
345	603079	圣达生物	56,800	570,272.00	0.05
346	001255	博菲电气	26,100	570,024.00	0.05
347	002809	红墙股份	79,500	570,015.00	0.05
348	603137	恒尚节能	55,860	569,772.00	0.05
349	603332	苏州龙杰	77,200	568,964.00	0.05
350	603183	建研院	177,200	568,812.00	0.05
351	603988	中电电机	72,800	568,568.00	0.05
352	000795	英洛华	102,500	567,850.00	0.05
353	600988	赤峰黄金	34,700	566,998.00	0.05
354	603656	泰禾智能	52,200	566,892.00	0.05
355	603238	诺邦股份	56,900	566,724.00	0.05
356	301118	恒光股份	38,000	566,580.00	0.05
357	300539	横河精密	70,300	565,915.00	0.05
358	003017	大洋生物	34,800	565,848.00	0.05
359	000548	湖南投资	140,600	565,212.00	0.05
360	301010	晶雪节能	49,000	563,990.00	0.05
361	600109	国金证券	74,600	563,230.00	0.05
362	301007	德迈仕	48,200	562,976.00	0.05
363	688420	美腾科技	27,208	562,661.44	0.05
364	301107	瑜欣电子	22,400	562,240.00	0.05
365	000586	汇源通信	71,600	562,060.00	0.05
366	002576	通达动力	49,500	561,825.00	0.05
367	002347	泰尔股份	149,000	561,730.00	0.05
368	601666	平煤股份	50,100	561,120.00	0.05
369	300980	祥源新材	35,600	561,056.00	0.05
370	301057	汇隆新材	49,000	560,560.00	0.05
371	603311	金海高科	65,700	559,764.00	0.05
372	002360	同德化工	110,600	559,636.00	0.05
373	603333	尚纬股份	179,800	559,178.00	0.05
374	603159	上海亚虹	53,700	559,017.00	0.05
375	002566	益盛药业	91,300	558,756.00	0.05
376	603903	中持股份	79,700	558,697.00	0.05
377	603682	锦和商管	139,800	557,802.00	0.05
378	603926	铁流股份	67,200	557,760.00	0.05
379	301006	迈拓股份	47,700	557,613.00	0.05
380	002899	英派斯	42,300	557,091.00	0.05

381	603709	中源家居	44,800	556,864.00	0.05
382	002769	普路通	106,400	556,472.00	0.05
383	301335	天元宠物	35,000	556,150.00	0.05
384	600095	湘财股份	93,300	556,068.00	0.05
385	603858	步长制药	36,700	556,005.00	0.05
386	000605	渤海股份	120,000	555,600.00	0.05
387	300112	万讯自控	80,500	555,450.00	0.05
388	300335	迪森股份	143,500	555,345.00	0.05
389	603725	天安新材	89,400	555,174.00	0.05
390	300584	海辰药业	36,400	554,372.00	0.05
391	300642	透景生命	47,600	554,064.00	0.05
392	600933	爱柯迪	37,400	553,146.00	0.05
393	688607	康众医疗	44,500	552,690.00	0.05
394	003011	海象新材	41,200	552,492.00	0.05
395	603790	雅运股份	57,500	552,000.00	0.05
396	600778	友好集团	141,800	551,602.00	0.05
397	603958	哈森股份	67,500	551,475.00	0.05
398	002928	华夏航空	86,900	550,946.00	0.05
399	603156	养元饮品	25,900	550,893.00	0.05
400	300813	泰林生物	32,500	550,875.00	0.05
401	603700	宁水集团	58,700	550,606.00	0.05
402	605033	美邦股份	44,300	550,206.00	0.05
403	603536	惠发食品	69,500	549,745.00	0.05
404	603089	正裕工业	65,700	549,252.00	0.05
405	301158	德石股份	44,400	549,228.00	0.05
406	600405	动力源	152,000	548,720.00	0.05
407	002136	安纳达	60,500	548,130.00	0.05
408	301063	海锅股份	38,200	547,788.00	0.05
409	002853	皮阿诺	73,700	547,591.00	0.05
410	002679	福建金森	78,900	546,777.00	0.05
411	301355	南王科技	57,000	546,630.00	0.05
412	603506	南都物业	65,200	546,376.00	0.05
413	605155	西大门	59,700	546,255.00	0.05
414	002883	中设股份	61,700	546,045.00	0.05
415	000678	襄阳轴承	145,000	545,200.00	0.05
416	300247	融捷健康	224,300	545,049.00	0.05
417	300615	欣天科技	56,900	544,533.00	0.05
418	300966	共同药业	33,300	544,122.00	0.05
419	603329	上海雅仕	49,300	543,286.00	0.05
420	300022	吉峰科技	153,000	543,150.00	0.05
421	301209	联合化学	24,800	543,120.00	0.05
422	002693	双成药业	123,400	542,960.00	0.05
423	300246	宝莱特	89,700	542,685.00	0.05

424	002820	桂发祥	73,400	542,426.00	0.05
425	605003	众望布艺	33,700	540,885.00	0.05
426	605567	春雪食品	70,600	540,796.00	0.05
427	688466	金科环境	45,345	540,512.40	0.05
428	300519	新光药业	49,800	540,330.00	0.05
429	600423	柳化股份	233,700	539,847.00	0.05
430	605255	天普股份	44,900	539,698.00	0.05
431	002524	光正眼科	171,300	539,595.00	0.05
432	603839	安正时尚	123,400	539,258.00	0.05
433	002563	森马服饰	92,800	539,168.00	0.05
434	600689	上海三毛	79,800	538,650.00	0.05
435	600665	天地源	242,600	538,572.00	0.05
436	002133	广宇集团	241,400	538,322.00	0.05
437	605055	迎丰股份	132,200	538,054.00	0.05
438	300960	通业科技	35,700	537,999.00	0.05
439	603176	汇通集团	144,200	537,866.00	0.05
440	603177	德创环保	76,500	537,795.00	0.05
441	000619	海螺新材	133,100	537,724.00	0.05
442	002715	登云股份	45,400	537,536.00	0.05
443	603028	赛福天	95,400	537,102.00	0.05
444	603585	苏利股份	55,000	536,800.00	0.05
445	600697	欧亚集团	53,400	536,670.00	0.05
446	002802	洪汇新材	60,400	536,352.00	0.05
447	300955	嘉亨家化	42,300	535,941.00	0.05
448	605122	四方新材	54,900	533,628.00	0.05
449	300907	康平科技	28,100	533,619.00	0.05
450	002760	凤形股份	40,400	533,280.00	0.05
451	000593	德龙汇能	114,400	533,104.00	0.05
452	001366	播恩集团	47,800	530,580.00	0.05
453	603818	曲美家居	189,700	529,263.00	0.05
454	300920	润阳科技	35,100	527,904.00	0.05
455	301227	森鹰窗业	28,000	526,680.00	0.05
456	688098	申联生物	126,200	526,254.00	0.05
457	002873	新天药业	63,400	526,220.00	0.05
458	300321	同大股份	28,200	525,366.00	0.05
459	002817	黄山胶囊	98,300	524,922.00	0.05
460	003042	中农联合	44,800	524,608.00	0.05
461	002295	精艺股份	98,600	524,552.00	0.05
462	300591	万里马	168,000	524,160.00	0.05
463	300967	晓鸣股份	57,700	523,339.00	0.05
464	603286	日盈电子	32,800	522,504.00	0.05
465	605189	富春染织	49,000	522,340.00	0.05
466	301234	五洲医疗	24,100	521,765.00	0.05

467	603810	丰山集团	62,400	521,664.00	0.05
468	600717	天津港	122,100	521,367.00	0.05
469	002494	华斯股份	167,100	521,352.00	0.05
470	301113	雅艺科技	26,200	521,118.00	0.05
471	603908	牧高笛	25,900	519,554.00	0.05
472	688355	明志科技	38,700	519,354.00	0.05
473	600051	宁波联合	98,400	518,568.00	0.05
474	300819	聚杰微纤	44,800	518,336.00	0.05
475	603637	镇海股份	84,900	517,890.00	0.05
476	002795	永和智控	138,900	516,708.00	0.05
477	002862	实丰文化	38,200	516,464.00	0.05
478	002826	易明医药	65,000	515,450.00	0.05
479	000803	山高环能	147,500	514,775.00	0.05
480	601669	中国电建	92,000	514,280.00	0.05
481	601019	山东出版	43,500	514,170.00	0.05
482	600156	华升股份	165,300	514,083.00	0.05
483	300871	回盛生物	53,800	513,252.00	0.05
484	603090	宏盛股份	28,800	513,216.00	0.05
485	600149	廊坊发展	159,300	512,946.00	0.05
486	300931	通用电梯	93,300	511,284.00	0.05
487	600235	民丰特纸	111,000	510,600.00	0.05
488	603182	嘉华股份	48,300	508,116.00	0.05
489	688616	西力科技	44,700	506,898.00	0.05
490	603073	彩蝶实业	35,000	506,100.00	0.05
491	300970	华绿生物	44,100	505,827.00	0.05
492	603025	大豪科技	36,600	505,812.00	0.05
493	002830	名雕股份	51,400	505,776.00	0.05
494	002858	力盛体育	48,600	505,440.00	0.05
495	300509	新美星	107,900	504,972.00	0.05
496	301065	本立科技	31,700	504,030.00	0.05
497	300126	锐奇股份	111,200	503,736.00	0.05
498	000001	平安银行	49,600	503,440.00	0.05
499	300564	筑博设计	58,900	502,417.00	0.05
500	600791	京能置业	157,300	501,787.00	0.05
501	002357	富临运业	97,800	501,714.00	0.05
502	002743	富煌钢构	135,900	501,471.00	0.05
503	600098	广州发展	78,200	500,480.00	0.05
504	300371	汇中股份	59,700	499,689.00	0.05
505	300838	浙江力诺	48,600	499,608.00	0.05
506	600137	浪莎股份	42,000	498,540.00	0.05
507	603214	爱婴室	44,100	497,889.00	0.05
508	301081	严牌股份	66,300	497,250.00	0.05
509	002921	联诚精密	49,600	496,496.00	0.05

510	002209	达意隆	64,900	495,187.00	0.05
511	300710	万隆光电	32,600	494,542.00	0.05
512	002718	友邦吊顶	47,100	491,724.00	0.05
513	300658	延江股份	116,500	491,630.00	0.05
514	300611	美力科技	64,500	491,490.00	0.05
515	001230	劲旅环境	35,340	490,872.60	0.05
516	301161	唯万密封	31,500	489,195.00	0.05
517	300749	顶固集创	92,300	489,190.00	0.05
518	300892	品渥食品	35,800	488,312.00	0.05
519	002910	庄园牧场	78,700	487,940.00	0.05
520	002030	达安基因	97,500	487,500.00	0.05
521	002114	罗平锌电	114,400	487,344.00	0.05
522	000856	冀东装备	80,100	487,008.00	0.05
523	300883	龙利得	115,100	486,873.00	0.05
524	001231	农心科技	34,600	486,822.00	0.05
525	002726	龙大美食	74,200	486,752.00	0.05
526	002890	弘宇股份	60,580	485,851.60	0.05
527	600857	宁波中百	85,900	485,335.00	0.05
528	002105	信隆健康	118,300	485,030.00	0.05
529	600900	长江电力	16,700	482,964.00	0.05
530	002696	百洋股份	121,900	481,505.00	0.05
531	002780	三夫户外	53,300	481,299.00	0.05
532	002591	恒大高新	131,500	481,290.00	0.05
533	300640	德艺文创	121,600	479,104.00	0.05
534	600116	三峡水利	69,300	478,170.00	0.05
535	300211	亿通科技	90,200	477,158.00	0.05
536	600575	淮河能源	121,500	472,635.00	0.04
537	603113	金能科技	85,800	469,326.00	0.04
538	300119	瑞普生物	34,300	467,166.00	0.04
539	002408	齐翔腾达	83,400	467,040.00	0.04
540	000987	越秀资本	94,000	466,240.00	0.04
541	300385	雪浪环境	138,200	465,734.00	0.04
542	300030	阳普医疗	124,500	463,140.00	0.04
543	603103	横店影视	33,300	460,872.00	0.04
544	000975	银泰黄金	28,200	459,378.00	0.04
545	300573	兴齐眼药	2,800	459,200.00	0.04
546	002691	冀凯股份	104,100	456,999.00	0.04
547	688338	赛科希德	20,833	451,034.45	0.04
548	002370	亚太药业	180,400	449,196.00	0.04
549	002011	盾安环境	45,300	445,299.00	0.04
550	600882	妙可蓝多	34,500	430,215.00	0.04
551	688711	宏微科技	26,000	417,560.00	0.04
552	601886	江河集团	85,200	415,776.00	0.04

553	000786	北新建材	14,000	415,240.00	0.04
554	002461	珠江啤酒	55,900	414,778.00	0.04
555	002126	银轮股份	23,700	412,617.00	0.04
556	300451	创业慧康	118,900	411,394.00	0.04
557	688772	珠海冠宇	27,539	410,331.10	0.04
558	601279	英利汽车	109,500	408,435.00	0.04
559	002661	克明食品	54,400	406,368.00	0.04
560	600827	百联股份	54,200	399,996.00	0.04
561	300695	兆丰股份	10,900	399,812.00	0.04
562	002067	景兴纸业	146,400	398,208.00	0.04
563	601598	中国外运	70,300	395,789.00	0.04
564	000683	远兴能源	56,800	392,488.00	0.04
565	601916	浙商银行	141,500	390,540.00	0.04
566	002625	光启技术	22,300	386,905.00	0.04
567	603167	渤海轮渡	47,300	386,441.00	0.04
568	000703	恒逸石化	54,500	386,405.00	0.04
569	600977	中国电影	35,800	385,208.00	0.04
570	002637	赞宇科技	45,300	383,238.00	0.04
571	002532	天山铝业	47,200	382,792.00	0.04
572	601608	中信重工	99,900	380,619.00	0.04
573	600373	中文传媒	25,600	379,904.00	0.04
574	300251	光线传媒	45,100	379,291.00	0.04
575	600511	国药股份	12,300	378,717.00	0.04
576	601838	成都银行	24,900	378,231.00	0.04
577	600704	物产中大	86,900	377,146.00	0.04
578	601008	连云港	109,600	377,024.00	0.04
579	600023	浙能电力	53,000	376,830.00	0.04
580	600143	金发科技	57,000	376,770.00	0.04
581	300017	网宿科技	47,500	375,250.00	0.04
582	600521	华海药业	22,000	375,100.00	0.04
583	601058	赛轮轮胎	26,700	373,800.00	0.04
584	688317	之江生物	25,900	373,219.00	0.04
585	000900	现代投资	101,800	372,588.00	0.04
586	688788	科思科技	16,000	372,000.00	0.04
587	002939	长城证券	55,500	371,850.00	0.04
588	300144	宋城演艺	46,200	370,986.00	0.04
589	002064	华峰化学	51,700	370,689.00	0.04
590	001965	招商公路	31,100	368,846.00	0.03
591	688030	山石网科	35,200	367,840.00	0.03
592	688176	亚虹医药	70,900	362,299.00	0.03
593	688485	九州一轨	46,414	362,029.20	0.03
594	688516	奥特维	8,600	359,566.00	0.03
595	300440	运达科技	68,400	359,100.00	0.03

595	688395	正弦电气	25,200	359,100.00	0.03
596	002500	山西证券	76,000	357,200.00	0.03
597	002469	三维化学	62,300	355,110.00	0.03
598	603112	华翔股份	33,700	354,187.00	0.03
599	002139	拓邦股份	33,000	350,460.00	0.03
600	300783	三只松鼠	16,000	349,920.00	0.03
601	002612	朗姿股份	25,300	349,646.00	0.03
602	603132	金徽股份	25,400	349,504.00	0.03
603	600415	小商品城	46,200	342,804.00	0.03
604	600279	重庆港	94,000	341,220.00	0.03
605	300390	天华新能	19,600	336,728.00	0.03
606	688118	普元信息	23,200	334,776.00	0.03
607	603899	晨光股份	10,700	334,696.00	0.03
608	002863	今飞凯达	81,800	332,926.00	0.03
609	000690	宝新能源	65,200	332,520.00	0.03
610	300257	开山股份	32,700	330,270.00	0.03
611	688350	富淼科技	28,900	329,749.00	0.03
612	600688	上海石化	126,200	329,382.00	0.03
613	600320	振华重工	96,200	329,004.00	0.03
614	002332	仙琚制药	28,800	328,608.00	0.03
615	300232	洲明科技	62,500	326,250.00	0.03
616	603898	好莱客	44,300	325,605.00	0.03
617	300501	海顺新材	30,200	325,556.00	0.03
618	600059	古越龙山	41,000	325,540.00	0.03
619	688056	莱伯泰科	14,654	324,732.64	0.03
620	002891	中宠股份	15,500	323,485.00	0.03
621	301216	万凯新材	28,900	323,391.00	0.03
622	601369	陕鼓动力	40,300	323,206.00	0.03
623	300348	长亮科技	47,300	322,586.00	0.03
624	601665	齐鲁银行	65,400	321,114.00	0.03
625	688132	邦彦技术	18,500	320,975.00	0.03
626	002282	博深股份	50,000	319,500.00	0.03
627	688571	杭华股份	60,300	318,987.00	0.03
628	688517	金冠电气	22,800	318,744.00	0.03
629	301003	江苏博云	14,800	318,348.00	0.03
630	002773	康弘药业	14,700	318,255.00	0.03
631	301222	浙江恒威	12,800	316,928.00	0.03
632	002228	合兴包装	135,400	316,836.00	0.03
633	003012	东鹏控股	51,800	316,498.00	0.03
634	600233	圆通速递	20,200	316,130.00	0.03
635	688681	科汇股份	30,900	315,489.00	0.03
636	002215	诺普信	42,300	315,135.00	0.03
637	000898	鞍钢股份	148,400	314,608.00	0.03



638	603856	东宏股份	30,900	314,562.00	0.03
639	300441	鲍斯股份	53,000	314,290.00	0.03
640	000848	承德露露	39,900	313,614.00	0.03
641	000930	中粮科技	62,300	313,369.00	0.03
642	300151	昌红科技	19,700	311,654.00	0.03
643	000959	首钢股份	114,500	311,440.00	0.03
644	603982	泉峰汽车	38,900	311,200.00	0.03
645	002083	孚日股份	73,300	310,059.00	0.03
646	000681	视觉中国	26,900	309,350.00	0.03
647	300535	达威股份	26,200	309,160.00	0.03
648	002925	盈趣科技	24,400	309,148.00	0.03
649	002063	远光软件	58,800	308,112.00	0.03
650	601121	宝地矿业	54,000	307,260.00	0.03
651	603676	卫信康	38,300	306,783.00	0.03
652	000417	合肥百货	73,900	306,685.00	0.03
653	002110	三钢闽光	103,800	306,210.00	0.03
654	603976	正川股份	21,700	306,187.00	0.03
655	002582	好想你	57,000	306,090.00	0.03
656	688448	磁谷科技	16,200	305,856.00	0.03
657	002798	帝欧家居	93,600	305,136.00	0.03
658	601609	金田股份	53,900	305,074.00	0.03
659	688151	华强科技	24,500	305,025.00	0.03
660	300070	碧水源	72,700	304,613.00	0.03
661	605177	东亚药业	13,800	304,566.00	0.03
662	002303	美盈森	126,000	303,660.00	0.03
663	301078	孩子王	60,000	303,600.00	0.03
664	603877	太平鸟	22,100	303,433.00	0.03
665	300625	三雄极光	28,900	303,161.00	0.03
666	300664	鹏鹞环保	68,100	303,045.00	0.03
667	300631	久吾高科	15,800	302,570.00	0.03
668	600664	哈药股份	114,600	302,544.00	0.03
669	002706	良信股份	44,100	302,526.00	0.03
670	002073	软控股份	40,900	302,251.00	0.03
671	001296	长江材料	21,200	302,100.00	0.03
672	603997	继峰股份	29,500	301,785.00	0.03
673	603098	森特股份	38,300	301,038.00	0.03
674	688219	会通股份	38,624	300,108.48	0.03
675	600853	龙建股份	97,400	299,018.00	0.03
676	301056	森赫股份	38,900	298,363.00	0.03
677	002727	一心堂	19,700	297,273.00	0.03
678	600663	陆家嘴	33,700	297,234.00	0.03
679	688121	卓然股份	24,700	296,894.00	0.03
680	603368	柳药集团	16,900	295,750.00	0.03

681	000338	潍柴动力	18,200	295,568.00	0.03
682	688255	凯尔达	14,700	294,735.00	0.03
683	002382	蓝帆医疗	68,000	293,760.00	0.03
684	603680	今创集团	44,400	293,040.00	0.03
685	688660	电气风电	101,600	292,608.00	0.03
686	688080	映翰通	9,600	291,168.00	0.03
687	688247	宣泰医药	35,300	290,166.00	0.03
688	688015	交控科技	16,000	287,520.00	0.03
689	002496	辉丰股份	127,300	285,152.00	0.03
690	002237	恒邦股份	24,700	284,297.00	0.03
691	688981	中芯国际	6,112	281,763.20	0.03
692	000913	钱江摩托	17,800	280,528.00	0.03
693	002034	旺能环境	21,400	278,414.00	0.03
694	000597	东北制药	71,900	278,253.00	0.03
695	002537	海联金汇	53,800	278,146.00	0.03
696	002216	三全食品	25,300	277,794.00	0.03
697	603733	仙鹤股份	15,800	277,764.00	0.03
698	600201	生物股份	38,500	277,585.00	0.03
699	000950	重药控股	56,100	273,207.00	0.03
700	603233	大参林	19,000	271,700.00	0.03
701	688202	美迪西	10,429	271,675.45	0.03
702	600597	光明乳业	34,800	270,396.00	0.03
703	301009	可靠股份	34,900	260,703.00	0.02
704	688007	XD 光峰科	15,972	257,149.20	0.02
705	300851	交大思诺	10,800	249,696.00	0.02
706	300623	捷捷微电	14,300	247,390.00	0.02
707	000528	柳工	21,700	242,823.00	0.02
708	601816	京沪高铁	45,000	241,650.00	0.02
709	002153	石基信息	41,177	235,944.21	0.02
710	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.02
711	600761	安徽合力	10,600	229,384.00	0.02
712	300737	科顺股份	52,500	225,750.00	0.02
713	002906	华阳集团	8,300	222,108.00	0.02
714	002318	久立特材	9,400	219,302.00	0.02
715	001222	源飞宠物	17,800	218,050.00	0.02
716	603027	千禾味业	15,400	204,820.00	0.02
717	601678	滨化股份	58,000	201,840.00	0.02
718	600271	航天信息	26,900	197,984.00	0.02
719	000883	湖北能源	32,800	197,128.00	0.02
720	688393	安必平	12,600	193,158.00	0.02
721	002019	亿帆医药	15,600	192,816.00	0.02
722	300676	华大基因	5,500	192,555.00	0.02
723	600422	昆药集团	10,700	190,781.00	0.02

724	600566	济川药业	6,000	190,260.00	0.02
725	300474	景嘉微	3,000	189,690.00	0.02
726	000830	鲁西化工	16,300	188,917.00	0.02
727	688389	普门科技	11,588	188,420.88	0.02
728	002065	东华软件	41,400	187,128.00	0.02
729	600737	中粮糖业	19,500	187,005.00	0.02
730	300285	国瓷材料	10,400	185,640.00	0.02
731	688002	睿创微纳	6,600	184,602.00	0.02
732	600131	国网信通	10,800	182,196.00	0.02
733	002385	大北农	46,800	180,180.00	0.02
734	600075	新疆天业	52,200	180,090.00	0.02
735	002659	凯文教育	51,900	169,713.00	0.02
736	002006	精工科技	12,500	167,750.00	0.02
737	603883	老百姓	9,100	167,076.00	0.02
738	300457	赢合科技	9,300	165,819.00	0.02
739	601126	四方股份	8,600	165,292.00	0.02
740	605111	新洁能	5,400	165,186.00	0.02
741	600775	南京熊猫	20,600	164,800.00	0.02
742	002617	露笑科技	34,300	164,640.00	0.02
743	003021	兆威机电	3,500	161,525.00	0.02
744	601860	紫金银行	64,500	161,250.00	0.02
745	688116	天奈科技	6,954	160,498.32	0.02
746	003039	顺控发展	12,800	160,384.00	0.02
747	300254	仟源医药	20,400	160,344.00	0.02
748	300596	利安隆	5,900	160,067.00	0.02
749	601222	林洋能源	25,500	159,885.00	0.02
750	301080	百普赛斯	4,500	157,500.00	0.01
751	000543	皖能电力	17,600	155,760.00	0.01
752	002859	洁美科技	7,700	154,616.00	0.01
753	000550	江铃汽车	7,100	154,141.00	0.01
754	300761	立华股份	6,700	151,688.00	0.01
755	603730	岱美股份	15,200	151,088.00	0.01
756	002317	众生药业	12,800	146,304.00	0.01
757	002948	青岛银行	43,400	146,258.00	0.01
758	600648	外高桥	16,500	146,190.00	0.01
759	688100	威胜信息	3,777	144,092.55	0.01
760	002544	普天科技	7,700	143,913.00	0.01
761	002571	德力股份	29,500	143,665.00	0.01
762	688278	特宝生物	2,670	142,978.50	0.01
763	300352	北信源	36,600	140,544.00	0.01
764	000415	渤海租赁	54,200	138,210.00	0.01
765	002283	天润工业	32,200	138,138.00	0.01
766	688575	亚辉龙	5,880	137,121.60	0.01

767	300406	九强生物	8,900	136,882.00	0.01
768	600110	诺德股份	44,400	135,420.00	0.01
769	000030	富奥股份	27,100	133,061.00	0.01
770	002390	信邦制药	40,000	132,400.00	0.01
771	688139	海尔生物	3,529	131,278.80	0.01
772	300973	立高食品	4,600	129,214.00	0.01
773	688083	中望软件	1,759	127,738.58	0.01
774	002594	比亚迪	500	125,125.00	0.01
775	600276	恒瑞医药	1,500	57,690.00	0.01
776	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
777	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
778	603826	坤彩科技	800	23,176.00	0.00
779	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
780	601033	永兴股份	1,258	20,077.68	0.00
781	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
782	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
783	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
784	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
785	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
786	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
787	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
788	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
789	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
790	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
791	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
792	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
793	003030	祖名股份	400	5,748.00	0.00
794	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
795	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
796	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
797	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
798	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
799	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
800	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
801	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
802	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
803	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
804	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
805	603871	嘉友国际	100	1,769.00	0.00
806	603616	韩建河山	100	295.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	42,069,271.00	0.74
2	601857	中国石油	39,352,384.00	0.69
3	601377	兴业证券	32,105,109.59	0.56
4	603185	弘元绿能	30,606,455.04	0.54
5	600489	XD 中金黄	30,344,667.00	0.53
6	603396	金辰股份	29,999,960.53	0.53
7	600362	江西铜业	28,627,539.00	0.50
8	600050	中国联通	28,046,551.00	0.49
9	600015	华夏银行	27,197,309.76	0.48
10	002410	广联达	26,506,547.84	0.47
11	600406	国电南瑞	26,428,393.47	0.46
12	600584	长电科技	24,676,563.96	0.43
13	600183	生益科技	24,083,327.00	0.42
14	000800	一汽解放	24,008,041.00	0.42
15	600019	宝钢股份	23,386,414.68	0.41
16	600837	海通证券	23,181,076.25	0.41
17	002736	国信证券	22,855,462.00	0.40
18	601998	中信银行	22,584,791.00	0.40
19	601668	中国建筑	22,348,757.00	0.39
20	000027	深圳能源	22,283,178.00	0.39

注：本表“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601998	中信银行	43,678,241.40	0.77
2	601857	中国石油	42,818,247.00	0.75
3	002938	鹏鼎控股	41,896,097.20	0.74
4	600741	华域汽车	41,010,309.06	0.72
5	601728	中国电信	38,810,306.00	0.68
6	601607	上海医药	38,794,285.40	0.68
7	600050	中国联通	38,508,818.00	0.68
8	601319	中国人保	36,776,219.46	0.65
9	601698	中国卫通	34,922,691.82	0.61
10	000333	美的集团	34,674,651.67	0.61
11	601615	明阳智能	34,590,750.00	0.61
12	600519	贵州茅台	33,977,612.00	0.60
13	601800	中国交建	33,389,126.53	0.59
14	600489	XD 中金黄	33,262,137.08	0.58

15	000538	云南白药	33,070,141.34	0.58
16	601377	兴业证券	33,028,924.30	0.58
17	002202	金风科技	32,025,467.88	0.56
18	601398	工商银行	31,735,964.00	0.56
19	600015	华夏银行	31,613,400.00	0.55
20	601988	中国银行	31,491,808.00	0.55

注：本表“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	8,286,089,278.15
卖出股票收入（成交）总额	11,253,621,163.73

注：本表“买入股票成本（成交）总额”，“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金于本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，选择流动性好、交易活跃的标的指数对应的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，同时兼顾基差的变化，以达到有效跟踪并力争超越标的指数的目的。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货不在本基金投资范围内。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

国债期货不在本基金投资范围内。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,780,700.22
2	应收清算款	10,222,761.82
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	338,685.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,342,147.36

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300162	雷曼光电	32,139,605.12	3.05	锁定期
2	603396	金辰股份	21,538,606.49	2.04	锁定期
3	603185	弘元绿能	19,877,079.72	1.88	锁定期
4	002224	三力士	18,655,580.02	1.77	锁定期

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
西部利得量化成长混合 A	47,245	10,623.25	150,104,422.51	29.91	351,790,950.16	70.09
西部利得量化成长混合 C	60,757	2,645.11	14,723,561.59	9.16	145,985,178.35	90.84
合计	106,526	6,220.12	164,827,984.10	24.88	497,776,128.51	75.12

注：1. “持有人户数”合计数小于各份额级别持有人户数的总和，是由于一个持有人同时持有多个级别基金份额；

2. 分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	西部利得量化成长混合 A	3,961,312.67	0.7893
	西部利得量化成长混合 C	649,171.74	0.4039
	合计	4,610,484.41	0.6958

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	西部利得量化成长混合 A	>100
	西部利得量化成长混合 C	10~50
	合计	>100
本基金基金经理持有	西部利得量化成长混合 A	10~50



本开放式基金	西部利得量化成长混合 C	-
	合计	10~50

#### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	7,629,935.47	1.15	5,050,605.20	0.76	36 个月
基金管理人高级管理人员	1,545,387.66	0.23	-	-	-
基金经理等人员	133,833.56	0.02	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	2,894,138.22	0.44	-	-	-
合计	12,203,294.91	1.84	5,050,605.20	0.76	36 个月

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	西部利得量化成长混合 A	西部利得量化成长混合 C
基金合同生效日 (2019年3月19日) 基金份额总额	177,856,344.09	-
本报告期期初基金份额总额	1,592,525,025.77	1,193,233,168.67
本报告期基金总申购份额	156,972,271.89	170,033,551.23
减：本报告期基金总赎回份额	1,247,601,924.99	1,202,557,979.96
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	501,895,372.67	160,708,739.94

注：其中“总申购份额”含红利再投、转换入份额；“总赎回份额”含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开本基金份额持有人大会，无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金进行审计。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国海证券	2	3,597,396,904.36	18.50	884,629.10	8.79	-
长江证券	1	2,933,602,020.17	15.08	1,308,118.77	13.00	-
民生证券	1	2,496,325,027.51	12.83	1,862,014.39	18.50	-
方正证券	2	2,225,565,165.09	11.44	1,214,950.24	12.07	-

国信证券	2	1,688,641,917.82	8.68	1,259,559.83	12.52	-
中泰证券	3	1,674,454,091.81	8.61	1,161,761.29	11.54	-
广发证券	2	1,584,787,585.50	8.15	865,130.76	8.60	-
东北证券	3	1,218,120,066.68	6.26	710,243.43	7.06	-
中邮证券	2	1,088,751,497.61	5.60	376,609.14	3.74	-
西南证券	2	759,635,390.07	3.91	338,725.21	3.37	-
东方证券	2	183,284,503.18	0.94	81,725.23	0.81	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

注：基金租用席位的选择标准是：(1) 财力雄厚，信誉良好；(2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；(3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；(4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；(5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。选择程序是：根据对各券商提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合席位券商标准的，由公司研究部提出席位券商的调整意见（调整名单及调整原因），并经公司批准。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
国海证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
民生证	-	-	-	-	-	-

券							
方正证 券	-	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-	-
英大证 券	-	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

## 10.8 其他重大事件

本报告期内本基金未发生其他重大事件。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20240101-20240205	757,100,807.62	58,328,714.61	815,429,522.23	0.00	0.00

### 产品特有风险

报告期内,本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况,由此可能导致的特有风险主要包括:当投资者持有份额占比较为集中时,个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响;极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请,可能带来流动性风险;如个别投资者大额赎回引发巨额赎回,基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请,可能影响投资者赎回业务办理;若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元,基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准本基金设立的相关文件;
- (2) 本基金《基金合同》;
- (3) 本基金《招募说明书》;
- (4) 本基金《托管协议》;
- (5) 基金管理人《基金管理资格证书》及《企业法人营业执照》;
- (6) 报告期内本基金公告的各项原稿。

### 12.2 存放地点

本基金管理人处——上海市浦东新区耀体路 276 号晶耀商务广场 3 号楼 9 层

### 12.3 查阅方式

(1) 书面查询: 查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:00。投资人可免费查阅,也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询: 基金管理人网址: <http://www.westleadfund.com> 投资人对本报告如有疑问,可咨询本基金管理人西部利得基金管理有限公司, 咨询电话 4007-007-818 (免长途话费) 或发电子邮件, E-mail: [service@westleadfund.com](mailto:service@westleadfund.com)。

西部利得基金管理有限公司

2024 年 8 月 29 日