

西部利得多策略优选灵活配置混合型证券  
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：兴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。

基金托管人兴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	5
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	6
3.3 其他指标	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	10
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>11</b>
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	15
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	45
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	46

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.....	46
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.....	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	47
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
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.....	48
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>48</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>48</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	51
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>51</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.....	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
<b>§ 12 备查文件目录.....</b>	<b>52</b>
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	西部利得多策略优选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	西部利得多策略优选混合
基金主代码	673030
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 7 月 27 日
基金管理人	西部利得基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	93,875,353.67 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过构建有效的投资组合，在严格控制风险的前提下，力求获得长期稳定的收益。
投资策略	大类资产配置策略、股票投资策略（包括价值投资策略、主题轮动策略、趋势投资策略、成长投资策略、事件驱动策略）、债券投资策略、股指期货投资策略、资产支持证券投资策略。（详见《基金合同》）
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%
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，属于证券投资基金中等风险水平的投资品种。

### 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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵毅	龚小武
	联系电话	021-38572888	021-52629999-212056
	电子邮箱	service@westleadfund.com	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话		4007-007-818	95561
传真		021-50710261	021-62159217
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区耀体路 276 号 901 室-908 室	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区耀体路 276 号 901 室-908 室	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码		200126	200120
法定代表人		何方	吕家进

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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)
本期已实现收益	-123,393.84
本期利润	502,534.03
加权平均基金份额本期利润	0.0053
本期加权平均净值利润率	0.55%
本期基金份额净值增长率	0.62%
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	-5,903,394.01
期末可供分配基金份额利润	-0.0629
期末基金资产净值	91,520,792.39
期末基金份额净值	0.975
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	62.97%

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。

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

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	-0.61%	0.18%	-1.17%	0.24%	0.56%	-0.06%
过去三个月	-0.31%	0.25%	-0.08%	0.36%	-0.23%	-0.11%

过去六个月	0.62%	0.30%	2.71%	0.44%	-2.09%	-0.14%
过去一年	-2.30%	0.27%	-1.77%	0.43%	-0.53%	-0.16%
过去三年	-3.91%	0.34%	-10.93%	0.52%	7.02%	-0.18%
自基金合同生效起至今	62.97%	0.50%	16.69%	0.64%	46.28%	-0.14%

### 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

西部利得多策略优选混合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		
童国林	基金经理	2021 年 7 月 14 日	-	29 年	中南财经大学货币银行学专业硕士。曾任深圳中航企业集团财务部会计，君安证券公司研究所研究员，甘肃证券深圳代表处投资经理，华宝兴业基金公司研究总监、基金经理，富国基金公司首席策略分析师，天弘基金公司总经理助理兼投资总监，上海安苏投资管理有限公司总经理，长江证券股份有限公司投资经理，长江证券（上海）资产管理有限公司权益投资部总经理，凯石基金管理有限公司投资八部总经理。2018 年 11 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

报告期内，本基金整体上采取了追求稳健收益的投资策略，主要资产配置在固定收益领域；同时通过中度参与权益市场，并进行严格风险控制，力争实现中长期的稳健资产增值。

本基金在报告期内，固定收益投资策略继续应市场变化而不断优化；持仓品种以利率债为主，减少信用风险暴露；长品种跟随利率变动趋势，报告期前期多次提高长品种利率债配置，后期随着利率波动加剧而采取中性至积极的配置策略，与前期相比整体上降低了长品种利率债的配置比例。

权益资产方面，本基金围绕核心投资策略，权益资产在既定配置比例下以超额收益为主、适当进行时机选择。超额收益方面，本基金采取如下投资策略概要：均衡布局、重点优化、整体控制；对本基金跟踪的股票池，按照一定的方法（主要是聚类方法）进行分组、选择代表性股票，构建投资组合；对投资组合中的股票进行基本面的深入分析，进而优化组合配置；并控制投资组合相对于比较基准的跟踪误差。报告期内，本基金在更大的范围内选择股票，动态根据个股的基本面变化和市场表现趋势，进行配置比例的不断优化。综合来看，由于沪深 300 指数（本基金权益基准指数）在报告期内相对于其他指数（特别是小盘成长股）显著强势，本基金在追逐超额收益方面面临较大的挑战。

#### 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，宏观经济环境有望边际改善，证券市场有望在充分调整后逐步选择新的方向。

从宏观经济环境来看：外部环境有望逐步走出美元高利率困扰，美元有望开启利率正常化进程；国内经济的恢复有望继续展开，房地产等行业的调整对经济的整体影响可能将逐渐降低，旅游、汽车、出口等行业或将起到新的拉动作用。

证券市场的周期性较强，前期的市场调整可能是对过去宏观基本面的反应；2024 年上半年证券市场主要指数的稳步运行，也预示着市场主流投资者对后市发展方向有了新的思考。

本基金将继续分析基本面的情况，观察市场走势，并适时调整投资方向。

#### 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及应用性的情况，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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《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

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：西部利得多策略优选灵活配置混合型证券投资基金

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	7,271,849.50	5,726,117.68
结算备付金		1,096,345.67	1,312,873.08
存出保证金		510,976.44	173,325.43
交易性金融资产	6.4.7.2	88,423,993.87	86,934,342.42
其中：股票投资		28,375,618.87	28,524,082.50
基金投资		-	-
债券投资		60,048,375.00	58,410,259.92
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	-	5,002,421.21

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		190,170.90	73,850.78
应收股利		-	-
应收申购款		500.00	65.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		97,493,836.38	99,222,995.88
<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		4,001,528.74	5,002,287.68
应付清算款		1,792,572.08	44,466.26
应付赎回款		-	39.83
应付管理人报酬		45,214.81	47,601.82
应付托管费		11,303.67	11,900.46
应付销售服务费		15,071.60	15,867.29
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	107,353.09	242,335.45
负债合计		5,973,043.99	5,364,498.79
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	93,875,353.67	96,871,714.52
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-2,354,561.28	-3,013,217.43
净资产合计		91,520,792.39	93,858,497.09
负债和净资产总计		97,493,836.38	99,222,995.88

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.975 元，基金份额总额 93,875,353.67 份。

## 6.2 利润表

会计主体：西部利得多策略优选灵活配置混合型证券投资基金

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	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
<b>一、营业总收入</b>		1,019,463.02	1,154,809.52
1. 利息收入		28,939.53	47,514.40
其中：存款利息收入	6.4.7.13	20,900.45	47,514.40
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		8,039.08	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		363,293.69	288,778.25
其中：股票投资收益		-1,198,062.58	299,541.85
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	1,224,773.56	258,021.97
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-52,057.42	-528,897.52
股利收益	6.4.7.19	388,640.13	260,111.95
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	625,927.87	818,477.09
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	1,301.93	39.78
<b>减：二、营业总支出</b>		516,928.99	620,941.87
1. 管理人报酬		274,178.91	317,393.98
2. 托管费		68,544.71	79,348.50
3. 销售服务费		91,392.98	105,797.98
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		7,475.35	14,277.68
其中：卖出回购金融资产支出		7,475.35	14,277.68
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		10.76	4.72
8. 其他费用	6.4.7.23	75,326.28	104,119.01
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		502,534.03	533,867.65
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		502,534.03	533,867.65

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		502,534.03	533,867.65

### 6.3 净资产变动表

会计主体：西部利得多策略优选灵活配置混合型证券投资基金

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	96,871,714.52	-3,013,217.43	93,858,497.09
二、本期期初净资产	96,871,714.52	-3,013,217.43	93,858,497.09
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-2,996,360.85	658,656.15	-2,337,704.70
(一)、综合收益总额	-	502,534.03	502,534.03
(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)	-2,996,360.85	156,122.12	-2,840,238.73
其中：1. 基金申购款	219,430.76	-5,333.78	214,096.98
2. 基金赎回款	-3,215,791.61	161,455.90	-3,054,335.71
(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	93,875,353.67	-2,354,561.28	91,520,792.39
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	106,239,020.53	-761,406.05	105,477,614.48
二、本期期初净资产	106,239,020.53	-761,406.05	105,477,614.48
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	1,204,786.57	537,875.75	1,742,662.32

(一)、综合收益总额	-	533,867.65	533,867.65
(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)	1,204,786.57	4,008.10	1,208,794.67
其中:1.基金申购款	1,662,913.72	6,894.96	1,669,808.68
2.基金赎回款	-458,127.15	-2,886.86	-461,014.01
(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	107,443,807.10	-223,530.30	107,220,276.80

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：

<u>贺燕萍</u>	<u>贺燕萍</u>	<u>张皞骏</u>
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

西部利得多策略优选灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）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[2015]1525号《关于核准西部利得多策略优选灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》批准，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《西部利得多策略优选灵活配置混合型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 6,023,768,455.44 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 977 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《西部利得多策略优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 7 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 6,023,768,460.47 份基金份额，其中认购资金利息折合 5.03 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，基金托管人为兴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《西部利得多策略优选灵活配置混合型证券投资

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）、债券、中期票据、短期融资券、货币市场工具、权证、股指期货、债券回购、银行存款、资产支持证券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：股票市值占基金资产净值的 0%-95%。其中，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：沪深 300 指数收益率\*50%+中证全债指数收益率\*50%。

#### 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 6 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

本基金本报告期末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	7,271,849.50
等于：本金	7,271,227.11
加：应计利息	622.39
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	7,271,849.50

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	28,110,889.22	-	28,375,618.87	264,729.65	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	59,095,655.09	557,195.00	60,048,375.00	395,524.91
	银行间市场	-	-	-	-

	合计	59,095,655.09	557,195.00	60,048,375.00	395,524.91
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
	合计	87,206,544.31	557,195.00	88,423,993.87	660,254.56

### 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				备注
	合同/名义 金额	公允价值			
		资产	负债		
利率衍生工具	-	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	-	
权益衍生工具	-4,194,420.00	-	-	-	
其中：股指期货投资	-4,194,420.00	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	-	
合计	-4,194,420.00	-	-	-	

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
IF2407	IF2407	-1.00	-1,031,100.00	7,980.00
IF2409	IF2409	-3.00	-3,081,240.00	74,100.00
合计				82,080.00
减：可抵销期货暂收款				82,080.00
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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	41,862.41

其中：交易所市场	41,862.41
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	65,490.68
合计	107,353.09

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	96,871,714.52	96,871,714.52
本期申购	219,430.76	219,430.76
本期赎回（以“-”号填列）	-3,215,791.61	-3,215,791.61
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	93,875,353.67	93,875,353.67

注：申购含红利再投、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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-5,971,804.31	2,958,586.88	-3,013,217.43
本期期初	-5,971,804.31	2,958,586.88	-3,013,217.43
本期利润	-123,393.84	625,927.87	502,534.03
本期基金份额交易产生的变动数	191,804.14	-35,682.02	156,122.12
其中：基金申购款	-14,836.13	9,502.35	-5,333.78
基金赎回款	206,640.27	-45,184.37	161,455.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,903,394.01	3,548,832.73	-2,354,561.28

#### 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
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	11,291.26
其他	201.72
合计	20,900.45

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	-1,198,062.58
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	-1,198,062.58

##### 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	69,164,745.80
减：卖出股票成本总额	70,223,215.01
减：交易费用	139,593.37
买卖股票差价收入	-1,198,062.58

##### 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

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	653,542.90
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	571,230.66
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-

合计	1,224,773.56
----	--------------

#### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	101,083,017.11
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	99,604,696.34
减：应计利息总额	907,090.11
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	571,230.66

#### 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	-52,057.42

**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	388,640.13
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	388,640.13

**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	547,807.87
股票投资	376,864.53
债券投资	170,943.34
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	78,120.00
权证投资	-
期货投资	78,120.00
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	625,927.87

**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	1,073.29
基金转换费收入	228.64
合计	1,301.93

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	16,409.12
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
银行费用	535.60
账户维护费	18,600.00
合计	75,326.28

#### 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
兴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 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
当期发生的基金应支付的管理费	274,178.91	317,393.98
其中：应支付销售机构的客户维护 费	608.73	954.97
应支付基金管理人的净管理费	273,570.18	316,439.01

注：支付基金管理人西部利得基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 0.60% / 当年天数。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	68,544.71	79,348.50

注：支付基金托管人兴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 0.15% 的年费率

计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

#### 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
	西部利得多策略优选混合
西部利得基金管理有限公司	90,886.88
西部证券股份有限公司	22.19
兴业银行股份有限公司	-
合计	90,909.07
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
	西部利得多策略优选混合
西部利得基金管理有限公司	105,027.27
西部证券股份有限公司	6.71
兴业银行股份有限公司	-
合计	105,033.98

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.20% 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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

#### 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固有资金投资本基金的情况

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的情况。

**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的情况。

**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
兴业银行股份有限公司	7,271,849.50	9,407.47	7,518,980.14	23,098.21

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人兴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“兴业银行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6月30日的相关余额为人民币233,736.97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**

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券的情况。

**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**

本基金本报告期末未进行利润分配。

**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**

本基金本报告期末未因认购新发/增发而持有流通受限证券。

**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**

截至本报告期末2024年06月30日，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为4,001,528.74元，于2024年7月1日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 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。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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日

A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	3,325,905.59	18,560,866.11
合计	3,325,905.59	18,560,866.11

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债、短期融资券等无信用评级的债券。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	56,722,469.41	39,849,393.81
合计	56,722,469.41	39,849,393.81

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债等无信用评级的债券。

#### 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	7,271,849.50	-	-	-	7,271,849.50
结算备付金	1,096,345.67	-	-	-	1,096,345.67
存出保证金	510,976.44	-	-	-	510,976.44
交易性金融资产	3,325,905.59	32,395,656.72	24,326,812.69	28,375,618.87	88,423,993.87
应收申购款	-	-	-	500.00	500.00
应收清算款	-	-	-	190,170.90	190,170.90
资产总计	12,205,077.20	32,395,656.72	24,326,812.69	28,566,289.77	97,493,836.38
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	45,214.81	45,214.81
应付托管费	-	-	-	11,303.67	11,303.67
应付清算款	-	-	-	1,792,572.08	1,792,572.08
卖出回购金融资产款	4,001,528.74	-	-	-	4,001,528.74
应付销售服务费	-	-	-	15,071.60	15,071.60

其他负债	-	-	-	107,353.09	107,353.09
负债总计	4,001,528.74	-	-	1,971,515.25	5,973,043.99
利率敏感度缺口	8,203,548.46	32,395,656.72	24,326,812.69	26,594,774.52	91,520,792.39
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	5,726,117.68	-	-	-	5,726,117.68
结算备付金	1,312,873.08	-	-	-	1,312,873.08
存出保证金	173,325.43	-	-	-	173,325.43
交易性金融资产	18,560,866.11	15,180,058.96	24,669,334.85	28,524,082.50	86,934,342.42
买入返售金融资产	5,002,421.21	-	-	-	5,002,421.21
应收申购款	-	-	-	65.28	65.28
应收清算款	-	-	-	73,850.78	73,850.78
资产总计	30,775,603.51	15,180,058.96	24,669,334.85	28,597,998.56	99,222,995.88
负债					
应付赎回款	-	-	-	39.83	39.83
应付管理人报酬	-	-	-	47,601.82	47,601.82
应付托管费	-	-	-	11,900.46	11,900.46
应付清算款	-	-	-	44,466.26	44,466.26
卖出回购金融资产款	5,002,287.68	-	-	-	5,002,287.68
应付销售服务费	-	-	-	15,867.29	15,867.29
其他负债	-	-	-	242,335.45	242,335.45
负债总计	5,002,287.68	-	-	362,211.11	5,364,498.79
利率敏感度缺口	25,773,315.83	15,180,058.96	24,669,334.85	28,235,787.45	93,858,497.09

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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

假设	除市场利率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）
	市场利率上升 25 基点	-705,000.00	-622,000.00
市场利率下降 25 基点	712,000.00	628,000.00	

#### 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	28,375,618.87	31.00	28,524,082.50	30.39
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	60,048,375.00	65.61	58,410,259.92	62.23
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	88,423,993.87	96.62	86,934,342.42	92.62

##### 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	1,961,000.00	1,985,000.00
	业绩比较基准下降 5% 的影响金额	-1,961,000.00	-1,985,000.00

## 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	28,375,618.87	28,524,082.50
第二层次	60,048,375.00	58,410,259.92
第三层次	-	-
合计	88,423,993.87	86,934,342.42

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

### 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	28,375,618.87	29.11
	其中：股票	28,375,618.87	29.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	60,048,375.00	61.59
	其中：债券	60,048,375.00	61.59
	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	8,368,195.17	8.58
8	其他各项资产	701,647.34	0.72
9	合计	97,493,836.38	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	279,654.00	0.31
B	采矿业	2,195,615.00	2.40
C	制造业	17,983,236.77	19.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,073,285.00	1.17
E	建筑业	346,599.00	0.38
F	批发和零售业	179,604.00	0.20
G	交通运输、仓储和邮政业	1,024,439.00	1.12
H	住宿和餐饮业	33,345.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,635,270.00	1.79
J	金融业	2,894,350.10	3.16
K	房地产业	87,036.00	0.10
L	租赁和商务服务业	271,091.00	0.30
M	科学研究和技术服务业	72,900.00	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	90,756.00	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	60,627.00	0.07
R	文化、体育和娱乐业	118,243.00	0.13
S	综合	29,568.00	0.03
	合计	28,375,618.87	31.00

### 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。

### 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	300750	宁德时代	6,860	1,235,005.80	1.35
2	601899	紫金矿业	67,600	1,187,732.00	1.30
3	002594	比亚迪	2,800	700,700.00	0.77
4	600036	招商银行	19,100	653,029.00	0.71
5	601318	中国平安	13,000	537,680.00	0.59
6	002475	立讯精密	11,900	467,789.00	0.51
7	600690	海尔智家	15,100	428,538.00	0.47
8	600309	万华化学	4,900	396,214.00	0.43
9	600276	恒瑞医药	9,300	357,678.00	0.39
10	300760	迈瑞医疗	1,200	349,092.00	0.38
11	601288	农业银行	78,600	342,696.00	0.37
12	000063	中兴通讯	11,200	313,264.00	0.34
13	002415	海康威视	9,700	299,827.00	0.33
14	600406	国电南瑞	10,800	269,568.00	0.29
15	601225	陕西煤业	10,100	260,277.00	0.28
16	600150	中国船舶	6,300	256,473.00	0.28
17	601985	中国核电	24,000	255,840.00	0.28
18	688981	中芯国际	5,500	253,550.00	0.28
19	601816	京沪高铁	46,700	250,779.00	0.27
20	603501	韦尔股份	2,400	238,488.00	0.26
21	002371	北方华创	700	223,923.00	0.24
22	300498	温氏股份	10,900	216,038.00	0.24
23	600489	XD 中金黄	13,700	202,760.00	0.22
24	601601	中国太保	7,100	197,806.00	0.22
25	601229	上海银行	27,200	197,472.00	0.22
26	300274	阳光电源	3,120	193,533.60	0.21
27	600941	中国移动	1,800	193,500.00	0.21
28	600795	国电电力	31,400	188,086.00	0.21
29	600938	中国海油	5,600	184,800.00	0.20
30	002352	顺丰控股	5,100	182,019.00	0.20
31	000338	潍柴动力	11,000	178,640.00	0.20
32	601766	中国中车	23,200	174,232.00	0.19
33	601668	中国建筑	32,800	174,168.00	0.19
34	000100	TCL 科技	39,400	170,208.00	0.19
35	600809	山西汾酒	800	168,704.00	0.18
36	002230	科大讯飞	3,800	163,210.00	0.18

37	600089	特变电工	11,400	158,118.00	0.17
38	600519	贵州茅台	100	146,739.00	0.16
39	600436	片仔癀	700	145,019.00	0.16
40	600760	中航沈飞	3,600	144,360.00	0.16
41	600989	宝丰能源	8,200	142,106.00	0.16
42	600999	招商证券	10,200	141,882.00	0.16
43	002001	新和成	7,200	138,240.00	0.15
44	688041	海光信息	1,900	133,608.00	0.15
45	002027	分众传媒	21,800	132,108.00	0.14
46	603288	海天味业	3,700	127,539.00	0.14
47	600066	宇通客车	4,900	126,420.00	0.14
48	002252	上海莱士	16,000	125,120.00	0.14
49	600019	宝钢股份	18,700	124,355.00	0.14
50	002648	卫星化学	6,800	122,264.00	0.13
51	601901	方正证券	15,800	122,134.00	0.13
52	600233	圆通速递	7,200	112,680.00	0.12
53	600183	生益科技	5,300	111,618.00	0.12
54	300433	蓝思科技	6,100	111,325.00	0.12
55	605499	东鹏饮料	500	107,875.00	0.12
56	000538	云南白药	2,100	107,415.00	0.12
57	002028	思源电气	1,600	107,040.00	0.12
58	603986	兆易创新	1,100	105,182.00	0.11
59	601916	浙商银行	37,900	104,604.00	0.11
60	300628	亿联网络	2,800	102,956.00	0.11
61	000786	北新建材	3,400	100,844.00	0.11
62	600161	天坛生物	4,100	100,040.00	0.11
63	300408	三环集团	3,400	99,246.00	0.11
64	002311	海大集团	2,100	98,805.00	0.11
65	601872	招商轮船	11,300	95,485.00	0.10
66	002180	纳思达	3,600	95,112.00	0.10
67	601077	渝农商行	18,700	93,874.00	0.10
68	000400	许继电气	2,700	92,907.00	0.10
69	688008	澜起科技	1,600	91,456.00	0.10
70	002938	鹏鼎控股	2,300	91,448.00	0.10
71	000157	中联重科	11,900	91,392.00	0.10
72	688111	金山办公	400	91,000.00	0.10
73	601607	上海医药	4,700	89,817.00	0.10
74	600025	华能水电	8,300	89,474.00	0.10
75	300394	天孚通信	1,000	88,420.00	0.10
76	002409	雅克科技	1,400	88,074.00	0.10
77	688126	沪硅产业	6,300	87,003.00	0.10
78	002916	深南电路	800	84,616.00	0.09
79	000876	新希望	9,000	82,260.00	0.09

80	000423	东阿阿胶	1,300	81,380.00	0.09
81	601633	长城汽车	3,200	80,960.00	0.09
82	300832	新产业	1,200	80,928.00	0.09
83	002353	杰瑞股份	2,300	80,684.00	0.09
84	002601	龙佰集团	4,300	79,851.00	0.09
85	601128	常熟银行	10,530	79,712.10	0.09
86	600875	东方电气	4,300	79,335.00	0.09
87	600584	长电科技	2,500	79,275.00	0.09
88	688169	石头科技	200	78,520.00	0.09
89	600418	江淮汽车	4,900	77,616.00	0.08
90	603799	华友钴业	3,500	77,455.00	0.08
91	603160	汇顶科技	1,100	75,625.00	0.08
92	600426	华鲁恒升	2,800	74,592.00	0.08
93	300418	昆仑万维	2,300	74,152.00	0.08
94	601567	三星医疗	2,100	73,500.00	0.08
95	600845	宝信软件	2,300	73,439.00	0.08
96	601021	春秋航空	1,300	73,229.00	0.08
97	300347	泰格医药	1,500	72,900.00	0.08
98	601058	赛轮轮胎	5,200	72,800.00	0.08
99	600346	恒力石化	5,200	72,540.00	0.08
100	002128	电投能源	3,400	71,740.00	0.08
101	300751	迈为股份	600	71,688.00	0.08
102	002223	鱼跃医疗	1,900	71,440.00	0.08
103	600803	新奥股份	3,400	70,720.00	0.08
104	601360	三六零	9,200	70,656.00	0.08
105	002653	海思科	2,300	70,610.00	0.08
106	000683	远兴能源	10,200	70,482.00	0.08
107	002736	国信证券	8,100	70,389.00	0.08
108	600096	云天化	3,600	69,912.00	0.08
109	300207	欣旺达	4,600	69,782.00	0.08
110	600879	航天电子	8,900	69,153.00	0.08
111	002850	科达利	900	68,742.00	0.08
112	002138	顺络电子	2,500	68,650.00	0.08
113	603606	东方电缆	1,400	68,334.00	0.07
114	600398	海澜之家	7,300	67,452.00	0.07
115	600741	华域汽车	4,100	67,158.00	0.07
116	000999	华润三九	1,560	66,424.80	0.07
117	600968	海油发展	15,900	65,508.00	0.07
118	600600	青岛啤酒	900	65,493.00	0.07
119	000933	神火股份	3,200	64,736.00	0.07
120	300003	乐普医疗	4,300	63,812.00	0.07
121	688396	华润微	1,700	63,648.00	0.07
122	600642	申能股份	7,200	63,576.00	0.07

123	601000	唐山港	13,500	63,450.00	0.07
124	688223	晶科能源	8,900	63,190.00	0.07
125	000598	兴蓉环境	8,400	63,168.00	0.07
126	603568	伟明环保	3,000	61,740.00	0.07
127	300395	菲利华	2,000	61,500.00	0.07
128	601877	正泰电器	3,200	60,992.00	0.07
129	002920	德赛西威	700	60,963.00	0.07
130	002625	光启技术	3,500	60,725.00	0.07
131	688777	中控技术	1,600	60,320.00	0.07
132	002236	大华股份	3,900	60,294.00	0.07
133	000039	中集集团	6,500	60,190.00	0.07
134	300529	健帆生物	2,200	59,862.00	0.07
135	600177	雅戈尔	8,400	59,808.00	0.07
136	600282	南钢股份	12,000	59,760.00	0.07
137	300496	中科创达	1,300	59,267.00	0.06
138	600039	四川路桥	7,500	59,175.00	0.06
139	000830	鲁西化工	5,100	59,109.00	0.06
140	600885	宏发股份	2,100	58,128.00	0.06
141	300661	圣邦股份	700	57,946.00	0.06
142	002156	通富微电	2,500	55,975.00	0.06
143	002078	太阳纸业	4,000	55,800.00	0.06
144	002984	森麒麟	2,300	55,407.00	0.06
145	002493	荣盛石化	5,700	55,062.00	0.06
146	000703	恒逸石化	7,700	54,593.00	0.06
147	301269	华大九天	700	53,935.00	0.06
148	002595	豪迈科技	1,400	53,438.00	0.06
149	688099	晶晨股份	900	53,388.00	0.06
150	601717	郑煤机	3,600	53,280.00	0.06
151	601156	东航物流	2,600	52,910.00	0.06
152	000963	华东医药	1,900	52,839.00	0.06
153	301236	软通动力	1,500	52,815.00	0.06
154	603392	万泰生物	800	52,704.00	0.06
155	300413	芒果超媒	2,500	52,250.00	0.06
156	002007	华兰生物	3,300	52,107.00	0.06
157	688188	柏楚电子	280	51,674.00	0.06
158	603260	合盛硅业	1,100	51,381.00	0.06
159	002340	格林美	8,000	50,960.00	0.06
160	603087	甘李药业	1,100	50,952.00	0.06
161	300136	信维通信	2,600	50,908.00	0.06
162	300474	景嘉微	800	50,584.00	0.06
163	002966	苏州银行	6,700	50,250.00	0.05
164	603195	公牛集团	651	50,205.12	0.05
165	600873	梅花生物	5,000	50,100.00	0.05

166	600060	海信视像	2,000	49,480.00	0.05
167	601577	长沙银行	6,000	49,080.00	0.05
168	600352	浙江龙盛	5,700	48,963.00	0.05
169	300979	华利集团	800	48,680.00	0.05
170	688009	中国通号	8,100	48,600.00	0.05
171	000883	湖北能源	8,000	48,080.00	0.05
172	300765	新诺威	1,900	47,937.00	0.05
173	002444	巨星科技	1,900	46,930.00	0.05
174	600332	白云山	1,600	46,928.00	0.05
175	600415	小商品城	6,300	46,746.00	0.05
176	600497	驰宏锌锗	8,700	46,458.00	0.05
177	688122	西部超导	1,200	45,984.00	0.05
178	002517	恺英网络	4,800	45,840.00	0.05
179	000408	藏格矿业	1,900	45,733.00	0.05
180	688363	华熙生物	800	45,256.00	0.05
181	300114	中航电测	1,000	45,250.00	0.05
182	600038	中直股份	1,100	45,221.00	0.05
183	603298	杭叉集团	2,300	45,172.00	0.05
184	002410	广联达	4,700	45,026.00	0.05
185	000960	锡业股份	2,900	44,921.00	0.05
186	601019	山东出版	3,800	44,916.00	0.05
187	002281	光迅科技	1,200	44,844.00	0.05
188	000708	中信特钢	3,300	44,781.00	0.05
189	002739	万达电影	3,700	44,733.00	0.05
190	002432	九安医疗	1,100	44,594.00	0.05
191	603345	安井食品	600	44,586.00	0.05
192	688187	时代电气	900	44,442.00	0.05
193	300001	特锐德	2,200	44,264.00	0.05
194	688180	君实生物	1,500	43,575.00	0.05
195	688065	凯赛生物	955	43,347.45	0.05
196	601231	环旭电子	2,700	43,335.00	0.05
197	601997	贵阳银行	8,200	43,214.00	0.05
198	600820	隧道股份	6,600	43,098.00	0.05
199	002262	恩华药业	1,800	42,732.00	0.05
200	600801	华新水泥	3,100	42,625.00	0.05
201	600895	张江高科	2,300	42,504.00	0.05
202	603225	新风鸣	2,700	42,093.00	0.05
203	002472	双环传动	1,900	41,838.00	0.05
204	002407	多氟多	3,400	41,582.00	0.05
205	601615	明阳智能	4,400	41,536.00	0.05
206	000513	丽珠集团	1,100	40,931.00	0.04
207	688385	复旦微电	1,300	40,794.00	0.04
208	600299	安迪苏	4,200	40,740.00	0.04

209	601555	东吴证券	6,900	40,710.00	0.04
210	300677	英科医疗	1,500	40,215.00	0.04
211	601298	青岛港	4,200	40,152.00	0.04
212	601808	中海油服	2,300	39,560.00	0.04
213	300567	精测电子	700	39,557.00	0.04
214	601665	齐鲁银行	8,000	39,280.00	0.04
215	688536	思瑞浦	400	39,124.00	0.04
216	300373	扬杰科技	1,000	38,900.00	0.04
217	600580	卧龙电驱	3,200	38,880.00	0.04
218	600131	国网信通	2,300	38,801.00	0.04
219	002064	华峰化学	5,400	38,718.00	0.04
220	300017	网宿科技	4,900	38,710.00	0.04
221	000539	粤电力 A	7,600	38,608.00	0.04
222	601016	节能风电	12,900	38,571.00	0.04
223	600583	海油工程	6,500	38,415.00	0.04
224	601059	信达证券	2,700	38,367.00	0.04
225	600008	首创环保	14,200	38,056.00	0.04
226	000729	燕京啤酒	4,300	37,969.00	0.04
227	688114	华大智造	800	37,928.00	0.04
228	002120	韵达股份	4,900	37,926.00	0.04
229	600763	通策医疗	700	37,835.00	0.04
230	300724	捷佳伟创	700	37,807.00	0.04
231	002508	老板电器	1,700	37,570.00	0.04
232	000818	航锦科技	1,700	37,536.00	0.04
233	300919	中伟股份	1,200	37,188.00	0.04
234	600511	国药股份	1,200	36,948.00	0.04
235	601456	国联证券	3,800	36,632.00	0.04
236	600298	安琪酵母	1,300	36,309.00	0.04
237	002465	海格通信	3,500	36,260.00	0.04
238	600970	中材国际	3,000	36,180.00	0.04
239	000066	中国长城	4,100	35,875.00	0.04
240	002831	裕同科技	1,400	35,826.00	0.04
241	600329	达仁堂	1,100	35,629.00	0.04
242	603893	瑞芯微	600	35,502.00	0.04
243	000831	中国稀土	1,400	35,490.00	0.04
244	600839	四川长虹	7,900	35,471.00	0.04
245	603650	彤程新材	1,200	35,460.00	0.04
246	603379	三美股份	900	35,226.00	0.04
247	600582	天地科技	5,100	35,139.00	0.04
248	600598	北大荒	2,800	34,972.00	0.04
249	300699	光威复材	1,400	34,762.00	0.04
250	600755	厦门国贸	4,800	34,416.00	0.04
251	601958	金钼股份	3,300	34,353.00	0.04

252	601866	中远海发	13,300	34,314.00	0.04
253	000887	中鼎股份	2,800	34,272.00	0.04
254	002683	广东宏大	1,700	34,221.00	0.04
255	600872	中炬高新	1,500	34,035.00	0.04
256	601611	中国核建	4,200	33,978.00	0.04
257	000739	普洛药业	2,500	33,925.00	0.04
258	600486	扬农化工	600	33,870.00	0.04
259	600995	南网储能	3,500	33,810.00	0.04
260	002572	索菲亚	2,200	33,726.00	0.04
261	000800	一汽解放	4,300	33,669.00	0.04
262	600435	北方导航	3,900	33,618.00	0.04
263	600258	首旅酒店	2,700	33,345.00	0.04
264	600062	华润双鹤	1,700	33,286.00	0.04
265	600529	山东药玻	1,300	32,942.00	0.04
266	688234	天岳先进	700	32,844.00	0.04
267	600521	华海药业	1,900	32,395.00	0.04
268	600901	江苏金租	6,400	32,320.00	0.04
269	002019	亿帆医药	2,600	32,136.00	0.04
270	300285	国瓷材料	1,800	32,130.00	0.04
271	603786	科博达	500	32,075.00	0.04
272	600378	昊华科技	1,100	31,790.00	0.03
273	688520	神州细胞	800	31,480.00	0.03
274	603179	新泉股份	800	31,392.00	0.03
275	603899	晨光股份	1,000	31,280.00	0.03
276	600737	中粮糖业	3,200	30,688.00	0.03
277	003031	中瓷电子	660	30,518.40	0.03
278	600153	建发股份	3,400	30,362.00	0.03
279	600004	白云机场	3,200	30,336.00	0.03
280	002429	兆驰股份	6,300	30,303.00	0.03
281	002056	横店东磁	2,400	29,928.00	0.03
282	600032	浙江新能	4,100	29,848.00	0.03
283	688349	三一重能	1,200	29,808.00	0.03
283	688425	铁建重工	8,100	29,808.00	0.03
284	001203	大中矿业	3,100	29,791.00	0.03
285	603218	日月股份	2,900	29,783.00	0.03
286	688297	中无人机	900	29,727.00	0.03
287	002563	森马服饰	5,100	29,631.00	0.03
288	600673	东阳光	4,200	29,568.00	0.03
289	688521	芯原股份	1,100	29,425.00	0.03
290	688213	思特威	600	29,100.00	0.03
291	600612	老凤祥	500	29,095.00	0.03
292	000893	亚钾国际	1,800	29,088.00	0.03
293	002266	浙富控股	10,400	29,016.00	0.03

294	002299	圣农发展	2,100	28,644.00	0.03
295	300251	光线传媒	3,400	28,594.00	0.03
296	600566	济川药业	900	28,539.00	0.03
297	601636	旗滨集团	4,400	28,380.00	0.03
298	300357	我武生物	1,400	28,308.00	0.03
299	688778	厦钨新能	900	28,116.00	0.03
300	688172	燕东微	1,700	27,506.00	0.03
301	000785	居然之家	11,300	27,459.00	0.03
302	603529	爱玛科技	1,000	27,330.00	0.03
303	002368	太极股份	1,200	27,060.00	0.03
304	001872	招商港口	1,400	26,950.00	0.03
305	002568	百润股份	1,600	26,928.00	0.03
306	301165	锐捷网络	900	26,856.00	0.03
307	600884	杉杉股份	3,300	26,796.00	0.03
308	600956	新天绿能	3,200	26,144.00	0.03
309	601139	深圳燃气	3,900	26,052.00	0.03
310	688567	孚能科技	2,700	25,920.00	0.03
311	600399	抚顺特钢	4,600	25,898.00	0.03
312	002080	中材科技	2,000	25,800.00	0.03
313	600143	金发科技	3,900	25,779.00	0.03
314	002507	涪陵榨菜	2,100	25,725.00	0.03
315	300009	安科生物	3,000	25,620.00	0.03
316	600663	陆家嘴	2,900	25,578.00	0.03
317	603317	天味食品	2,200	25,102.00	0.03
318	601598	中国外运	4,300	24,209.00	0.03
319	688475	萤石网络	700	23,877.00	0.03
320	688281	华秦科技	280	23,329.60	0.03
321	002423	中粮资本	3,100	23,219.00	0.03
322	600315	上海家化	1,300	23,114.00	0.03
323	688301	奕瑞科技	200	23,046.00	0.03
324	300253	卫宁健康	3,900	23,010.00	0.03
325	688032	禾迈股份	200	22,956.00	0.03
326	000537	中绿电	2,400	22,872.00	0.02
327	301267	华夏眼科	1,100	22,792.00	0.02
328	603826	坤彩科技	780	22,596.60	0.02
329	603707	健友股份	1,900	22,572.00	0.02
330	600500	中化国际	6,400	22,336.00	0.02
331	688819	天能股份	900	21,474.00	0.02
332	688375	国博电子	300	21,192.00	0.02
333	001289	龙源电力	1,200	20,700.00	0.02
334	002791	坚朗五金	800	20,696.00	0.02
335	601158	重庆水务	4,100	19,680.00	0.02
336	301029	怡合达	1,000	19,660.00	0.02

337	603868	飞科电器	500	19,200.00	0.02
338	603305	旭升集团	1,800	19,008.00	0.02
339	000031	大悦城	8,100	18,954.00	0.02
340	688029	南微医学	300	18,468.00	0.02
341	688516	奥特维	40	1,672.40	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	601899	紫金矿业	1,490,536.00	1.59
2	000333	美的集团	1,112,824.00	1.19
3	002594	比亚迪	884,269.00	0.94
4	600276	恒瑞医药	877,744.00	0.94
5	300750	宁德时代	851,152.00	0.91
6	601318	中国平安	828,682.00	0.88
7	600036	招商银行	826,393.00	0.88
8	300498	温氏股份	755,596.00	0.81
9	300760	迈瑞医疗	753,410.00	0.80
10	601766	中国中车	734,243.00	0.78
11	600309	万华化学	734,198.00	0.78
12	600919	江苏银行	709,502.00	0.76
13	002415	海康威视	637,641.00	0.68
14	002475	立讯精密	636,276.00	0.68
15	601288	农业银行	635,505.00	0.68
16	600089	特变电工	569,944.00	0.61
17	600690	海尔智家	544,934.00	0.58
18	688981	中芯国际	527,413.35	0.56
19	000063	中兴通讯	499,174.00	0.53
20	601985	中国核电	491,450.00	0.52

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	000333	美的集团	1,995,789.00	2.13
2	600519	贵州茅台	1,474,062.00	1.57
3	600919	江苏银行	1,100,723.00	1.17
4	600276	恒瑞医药	985,234.00	1.05
5	601318	中国平安	853,093.00	0.91

6	300498	温氏股份	837,433.00	0.89
7	601766	中国中车	837,314.00	0.89
8	600309	万华化学	750,603.00	0.80
9	601857	中国石油	741,331.00	0.79
10	600036	招商银行	740,245.00	0.79
11	601288	农业银行	711,588.00	0.76
12	601919	中远海控	674,947.00	0.72
13	300124	汇川技术	643,470.00	0.69
14	600089	特变电工	630,401.00	0.67
15	601211	国泰君安	614,304.00	0.65
16	000338	潍柴动力	590,213.00	0.63
17	688981	中芯国际	568,572.28	0.61
18	601816	京沪高铁	564,455.00	0.60
19	601899	紫金矿业	517,351.00	0.55
20	603993	洛阳钼业	516,384.00	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	69,697,886.85
卖出股票收入（成交）总额	69,164,745.80

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	60,048,375.00	65.61
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	60,048,375.00	65.61

#### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019735	24 国债 04	145,000	14,765,528.77	16.13
2	019734	24 国债 03	145,000	14,697,811.78	16.06
3	019729	23 国债 26	90,000	9,350,159.18	10.22
4	019728	23 国债 25	90,000	9,264,863.84	10.12
5	019710	23 国债 17	82,000	8,432,981.10	9.21

#### 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

在股指期货投资上，本基金以避险保值和有效管理为目标，在控制风险的前提下，谨慎、适当参与股指期货的投资，以管理组合系统性风险，改善收益特性。

风险控制：

（一）基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%。

（二）基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。

其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等。

（三）基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%。

整体操作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	510,976.44
2	应收清算款	190,170.90
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	500.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	701,647.34

### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 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

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 (%)
643	145,995.88	93,365,935.56	99.46	509,418.11	0.54

**8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	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	139,241.09	0.1483

**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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

**§ 9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2015年7月27日）基金份额总额	6,023,768,460.47
本报告期期初基金份额总额	96,871,714.52
本报告期基金总申购份额	219,430.76
减：本报告期基金总赎回份额	3,215,791.61
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	93,875,353.67

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 (%)	
太平洋证券	2	58,308,606.67	41.99	37,661.27	39.19	-
财信证券	1	20,036,891.64	14.43	14,945.49	15.55	-
中信建投	2	15,574,958.01	11.22	11,870.95	12.35	-
平安证券	2	12,232,159.49	8.81	9,124.01	9.49	-
中泰证券	3	9,135,628.20	6.58	6,814.57	7.09	-
民生证券	1	6,453,700.00	4.65	4,813.98	5.01	-
东吴证券	2	6,410,895.51	4.62	3,498.44	3.64	-
东北证券	2	3,888,234.47	2.80	1,733.90	1.80	-
广发证券	1	2,895,731.07	2.09	2,160.05	2.25	-
申万宏源	2	2,763,163.45	1.99	2,613.67	2.72	-
华金证券	2	1,023,295.14	0.74	763.34	0.79	-
招商证券	2	139,369.00	0.10	104.00	0.11	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-

银河证券	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 (%)
太平洋证券	31,078,943.00	16.10	6,000,000.00	13.79	-	-
财信证券	102,109,219.00	52.90	26,500,000.00	60.92	-	-
中信建投	1,000,030.00	0.52	2,000,000.00	4.60	-	-
平安证券	23,892,019.00	12.38	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	7,638,410.00	3.96	4,000,000.00	9.20	-	-
东北证券	11,017,481.00	5.71	5,000,000.00	11.49	-	-
广发证券	15,079,092.00	7.81	-	-	-	-
申万宏源	1,208,496.00	0.63	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

东兴证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
五矿证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-

## 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 (%)
产品	1	20240101-20240630	59,192,559.92	0.00	0.00	59,192,559.92	63.05
	2	20240101-20240630	19,455,252.92	0.00	0.00	19,455,252.92	20.72

#### 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。

西部利得基金管理有限公司

2024 年 8 月 29 日