

西部利得量化成长混合型发起式证券投资  
基金  
2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 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：2025 年 3 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。本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 2025 年 3 月 26 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。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况</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	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 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	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>17</b>
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金资产组合情况	54

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	54
8.3 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.....	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	72
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	74
8.6 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.....	74
8.7 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.....	74
8.8 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.....	74
8.9 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.....	74
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	74
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	74
8.12 投资组合报告附注.....	74
<b>§ 9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>75</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	75
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	76
9.3 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.....	76
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	76
<b>§ 10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>77</b>
<b>§ 11 重大事件揭示.....</b>	<b>77</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	77
11.2 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.....	77
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	77
11.4 基金投资策略的改变.....	77
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	77
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	78
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	78
11.8 其他重大事件.....	80
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>81</b>
12.1 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.....	81
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	81
<b>§ 13 备查文件目录.....</b>	<b>81</b>
13.1 备查文件目录.....	81
13.2 存放地点.....	81
13.3 查阅方式.....	82

## § 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	586,868,174.44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	402,657,368.03份	184,210,806.41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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.westleadfund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2024 年		2023 年		2022 年	
	西部利得 量化成长 混合 A	西部利得 量化成长 混合 C	西部利得 量化成长 混合 A	西部利得 量化成长 混合 C	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	-672,082,786.77	-437,855,462.04	158,825,820.93	65,080,190.08	-260,718,603.97	-29,650,006.93
本期利润	-606,506,545.60	-466,783,575.87	191,050,572.27	42,784,841.44	-366,756,044.85	-36,015,665.99
加权平均基金份额本期利润	-0.9379	-1.4317	0.1687	0.0688	-0.4809	-0.3683
本期加权平均净值利润率	-53.93%	-82.91%	8.32%	3.45%	-24.32%	-18.96%
本期基金份额净值增长率	-7.01%	-7.77%	10.17%	9.31%	-18.79%	-19.42%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	185,426,253.74	74,258,606.52	1,219,667,409.35	855,201,740.66	492,373,648.94	64,935,061.83
期末可供分配基金份额利润	0.4605	0.4031	0.7659	0.7167	0.6268	0.5958

期末基金资产净值	773,475,258.30	342,787,828.57	3,289,545,541.52	2,407,294,427.77	1,472,850,463.68	201,160,965.96
期末基金份额净值	1.9209	1.8608	2.0656	2.0175	1.8749	1.8456
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
基金份额累计净值增长率	121.96%	-1.36%	138.68%	6.95%	116.64%	-2.17%

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

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
过去三个月	5.33%	1.78%	0.03%	1.52%	5.30%	0.26%
过去六个月	19.80%	1.65%	12.22%	1.51%	7.58%	0.14%
过去一年	-7.01%	1.59%	4.93%	1.37%	-11.94%	0.22%
过去三年	-16.80%	1.36%	-15.83%	1.05%	-0.97%	0.31%
过去五年	83.13%	1.43%	9.25%	1.03%	73.88%	0.40%
自基金合同生效起至今	121.96%	1.37%	6.20%	1.03%	115.76%	0.34%

西部利得量化成长混合 C

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	增长率①	增长率标准 差②	基准收益 率③	基准收益 率标准差 ④		
过去三个月	5.12%	1.78%	0.03%	1.52%	5.09%	0.26%
过去六个月	19.32%	1.65%	12.22%	1.51%	7.10%	0.14%
过去一年	-7.77%	1.59%	4.93%	1.37%	-12.70 %	0.22%
过去三年	-18.76%	1.36%	-15.83%	1.05%	-2.93%	0.31%
自基金合同生效 起至今	-1.36%	1.37%	-7.80%	0.98%	6.44%	0.39%

### 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



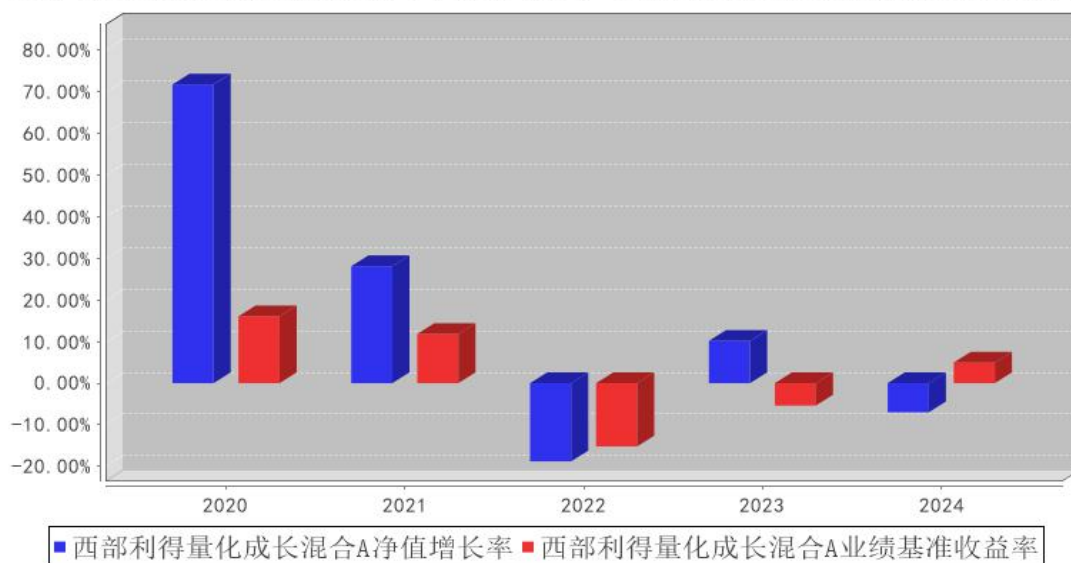


西部利得量化成长混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

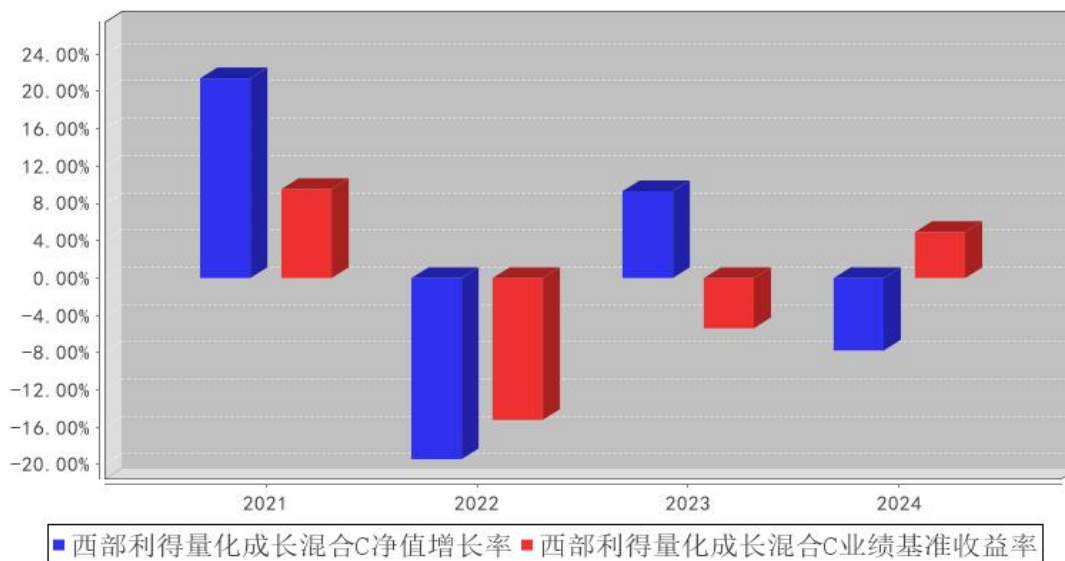


### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

西部利得量化成长混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



西部利得量化成长混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：自 2021 年 01 月 13 日起增设本基金的 C 类基金份额，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 3.3 其他指标

无

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行过利润分配。

## § 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	总经理助	2019 年 3	-	12 年	复旦大学计算机应用技术专业硕士。曾任

衍	理、投资 总监、主 动量化投 资部总经 理、基金 经理	月 19 日			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《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、本基金《基金合同》等法律文件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，力争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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规制定了《西部利得基金管理有限公司公平交易管理办法》。针对股票、债券等投资标的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动进行公平交易管理。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

##### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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参与的交易所公开竞价交易中，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现 2 次同日反向交易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。行业分散，市值分布均衡，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 2025 年上半年，影响 A 股的主要有三股力量。

其一是中国时代的来临

近年来中国在新能源、国防、核能、电信设备、无人机、机器人等领域主导技术进步，在高附加值领域的优势和在供应链中的主导地位迅速提升，在 AI、动画电影、3A 游戏等领域缩短和世界顶级技术的差距。全球投资者将逐步认识到中国时代的到来，其认知的提升或将带来跨境资本的流入。

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、民营企业部门、地方政府部门的杠杆率也阶段性见顶，形成通缩压力。短期稳经济可能主要依赖于中央和央企部门加杠杆，对冲通缩，稳定

物价。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很长一段时间的主旋律。被定义为高质量的行业发展提速，被定义为非高质量的行业发展相对减速。具体而言，国央企因其更符合高质量发展趋势而受益，而民企中硬科技占比高的企业受益；官方定位从低质量向高质量转变的行业因其边际变化可能有较高的股价弹性。央企股票不止是高股息资产，不少央企中小票也有较高投资价值，这部分市场未充分定价。科技股中市场认知和现实差较大的科技公司或有亮眼表现。

整体来看，当下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，其央企中小票定价并不充分。2024 年，小市值风格表现相对疲弱，但针对小市值公司和量化投资的政策已经出现调整，同时主题投资活跃。这些因素相互叠加，为央企中小票后续走势奠定了基础。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人始终坚持基金份额持有人利益优先原则，从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实。公司监察稽核部依据法律法规的规定及公司内部控制的整体要求，独立对公司经营、旗下投资组合及员工行为等的合规性进行了定期和不定期检查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，并定期向监管机构、公司董事会出具监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人的监察稽核主要工作如下：

- 一、结合公司业务开展的实际情况，进一步完善公司各项内部制度和细化各项业务流程；
- 二、落实内部监察稽核工作，对公司业务流程及管理的各项环节进行定期及不定期稽核；
- 三、根据法律法规及时、准确、完整的披露与本基金有关的各项法定信息披露文件，并在指定报刊和公司网站进行披露，确保基金投资人和公众及时、准确和完整地获取公司和本基金的各项公开信息；
- 四、继续加强反洗钱工作力度，进一步落实洗钱风险自评估工作和反洗钱异常报告筛选，并进一步完善工作流程。监察稽核部定期和不定期地向各监管机构按时提交报备各类反洗钱报告，并不断贯彻落实反洗钱法规及监管要求；
- 五、落实各项合规工作，确保公司各项业务及管理符合法律法规要求；
- 六、其他各类监察稽核工作。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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“7.4.11 利润分配情况”。

#### 4.9 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报告期内基金的投资运作，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 托管人对本年度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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2501817 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金(以下简称“该基金”) 财务报表,包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表、2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“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编制,公允反映了该基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“审计准则”)的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于该基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	该基金管理人西部利得基金管理有限公司(以下简称“该基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2024 年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我

	<p>们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 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编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应</p>



	当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。	
	(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	张楠	朱伊俐
会计师事务所的地址	北京市长安街1号东方广场毕马威大楼8层	
审计报告日期	2025年3月27日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	75,354,844.45	490,829,658.84
结算备付金		16,169,768.53	64,870,723.74
存出保证金		1,929,363.70	11,943,943.22
交易性金融资产	7.4.7.2	1,024,190,900.70	5,131,121,279.23
其中：股票投资		1,024,190,900.70	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		4,988,627.78	65,674,951.81
应收股利		-	-
应收申购款		476,424.71	41,608,454.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		1,123,109,929.87	5,806,049,011.69

负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	70,367,746.59
应付赎回款		3,326,843.02	23,472,785.16
应付管理人报酬		1,195,662.29	5,709,967.59
应付托管费		99,638.53	475,830.63
应付销售服务费		245,672.01	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	7.4.7.9	1,979,027.15	7,520,801.03
负债合计		6,846,843.00	109,209,042.40
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	586,868,174.44	2,785,758,194.44
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	529,394,912.43	2,911,081,774.85
净资产合计		1,116,263,086.87	5,696,839,969.29
负债和净资产总计		1,123,109,929.87	5,806,049,011.69

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 586,868,174.44 份，其中西部利得量化成长混合 A 份额总额 402,657,368.03 份，基金份额净值 1.9209 元；西部利得量化成长混合 C 份额总额 184,210,806.41 份，基金份额净值 1.8608 元。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-1,046,632,464.03	293,902,291.32
1. 利息收入		1,485,280.16	3,048,275.50
其中：存款利息收入	7.4.7.13	1,485,280.16	3,048,275.50
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)		-1,088,599,576.39	278,931,615.22
其中: 股票投资收益		-1,088,314,410.18	257,919,425.08
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资 收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-18,824,083.07	-10,596,267.87
股利收益	7.4.7.19	18,538,916.86	31,608,458.01
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产 生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	7.4.7.20	36,648,127.34	9,929,402.70
4. 汇兑收益(损失以“-” 号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-” 号填列)	7.4.7.21	3,833,704.86	1,992,997.90
<b>减: 二、营业总支出</b>		26,657,657.44	60,066,877.61
1. 管理人报酬		20,248,929.32	46,613,707.38
其中: 暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费		1,687,410.79	3,494,246.52
3. 销售服务费		4,509,557.04	9,717,896.27
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	5,539.57
8. 其他费用	7.4.7.23	211,760.29	235,487.87
<b>三、利润总额(亏损总     额以“-”号填列)</b>		-1,073,290,121.47	233,835,413.71
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以     “-”号填列)</b>		-1,073,290,121.47	233,835,413.71
<b>五、其他综合收益的税     后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-1,073,290,121.47	233,835,413.71

## 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	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	5,696,839,969.2 9
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,785,758,194. 44	-	2,911,081,774. 85	5,696,839,969.2 9
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,198,890,020 .00	-	-2,381,686,862 .42	-4,580,576,882. 42
(一)、综合收益总额	-	-	-1,073,290,121 .47	-1,073,290,121. 47
(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)	-2,198,890,020 .00	-	-1,308,396,740 .95	-3,507,286,760. 95
其中：1. 基金申购款	443,534,964.68	-	373,088,250.74	816,623,215.42
2. 基金赎回款	-2,642,424,984 .68	-	-1,681,484,991 .69	-4,323,909,976. 37
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-

四、本期期末净资产	586,868,174.44	-	529,394,912.43	1,116,263,086.87
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	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
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
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)	1,891,206,357.55	-	2,131,622,182.10	4,022,828,539.65
(一)、综合收益总额	-	-	233,835,413.71	233,835,413.71
(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)	1,891,206,357.55	-	1,897,786,768.39	3,788,993,125.94
其中：1.基金申购款	2,737,948,264.70	-	2,753,447,229.38	5,491,395,494.08
2.基金赎回款	-846,741,907.15	-	-855,660,460.99	-1,702,402,368.14
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,785,758,194.	-	2,911,081,774.	5,696,839,969.2

	44		85	9
--	----	--	----	---

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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%。

#### 7.4.2 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>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

#### 7.4.3 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 7.4.2 中所列示的中国证监会和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 12 月 31 日的财务状况、2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；

- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的商业模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。商业模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的商业模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

#### (b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

##### - 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

##### - 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### (a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。



#### (b) 后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

#### (c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

#### (d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，

是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则

规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

#### 投资收益

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

#### 公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金基金合同》的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 10 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；投资者可对 A 类基金份额和 C 类基金份额分别选择不同的收益分配方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后各类基金份额的基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求

履行适当程序后对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 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。

#### 7.4.5.2 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。

#### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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》、财政部 税务总局公告2024年第8号《关于延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》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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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附加。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	75,354,844.45	490,829,658.84
等于：本金	75,333,277.07	490,732,794.76
加：应计利息	21,567.38	96,864.08
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	75,354,844.45	490,829,658.84

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,050,246,861.64	-	1,024,190,900.70	-26,055,960.94
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		1,050,246,861.64	-	1,024,190,900.70	-26,055,960.94
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		5,193,309,867.51	-	5,131,121,279.23	-62,188,588.28
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		5,193,309,867.51	-	5,131,121,279.23	-62,188,588.28

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 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 12 月 31 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	12,125,400.00	-	-	-
其中：股指期货投资	12,125,400.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-



合计	12,125,400.00	-	-	-
项目	上年度末 2023年12月31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	85,543,380.00	-	-	-
其中：股指期货投资	85,543,380.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	85,543,380.00	-	-	-

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。

#### 7.4.7.3.2 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
IM2501	IM2501	10.00	11,911,600.00	-213,800.00
合计				-213,800.00
减：可抵销期货暂收款				-213,800.00
净额				-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 7.4.7.3.3 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。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度期末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度期末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明**

无。

**7.4.7.5 债权投资****7.4.7.5.1 债权投资情况**

本基金本报告期末及上年度期末均未持有债权投资。

**7.4.7.5.2 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。

**7.4.7.6 其他债权投资****7.4.7.6.1 其他债权投资情况**

本基金本报告期末及上年度期末均未持有其他债权投资。

**7.4.7.6.2 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。

**7.4.7.7 其他权益工具投资****7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

本基金本报告期末及上年度期末均未持有其他权益工具投资。

**7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

本基金本报告期末及上年度期末均未持有其他权益工具投资。

**7.4.7.8 其他资产**

本基金本报告期末及上年度期末均未持有其他资产。

**7.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	251.80	518.21
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,810,775.35	7,218,282.82
其中：交易所市场	1,810,775.35	7,218,282.82
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	168,000.00	302,000.00
合计	1,979,027.15	7,520,801.03

**7.4.7.10 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 12 月 31 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	181,206,538.48	181,206,538.48
本期赎回（以“-”号填列）	-1,371,074,196.22	-1,371,074,196.22
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	402,657,368.03	402,657,368.03

## 西部利得量化成长混合 C

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	262,328,426.20	262,328,426.20
本期赎回（以“-”号填列）	-1,271,350,788.46	-1,271,350,788.46
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	184,210,806.41	184,210,806.41

注：申购含红利再投资、转换入份额；赎回含转换出份额。

## 7.4.7.11 其他综合收益

无。

## 7.4.7.12 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
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,219,667,409.35	477,353,106.40	1,697,020,515.75
本期利润	-672,082,786.77	65,576,241.17	-606,506,545.60
本期基金份额交易产生的变动数	-362,158,368.84	-357,537,711.04	-719,696,079.88
其中：基金申购款	74,025,661.51	73,592,326.32	147,617,987.83
基金赎回款	-436,184,030.35	-431,130,037.36	-867,314,067.71
本期已分配利润	-	-	-

本期末	185,426,253.74	185,391,636.53	370,817,890.27
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
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	855,201,740.66	358,859,518.44	1,214,061,259.10
本期利润	-437,855,462.04	-28,928,113.83	-466,783,575.87
本期基金份额交易产生的变动数	-343,087,672.10	-245,612,988.97	-588,700,661.07
其中：基金申购款	119,862,162.11	105,608,100.80	225,470,262.91
基金赎回款	-462,949,834.21	-351,221,089.77	-814,170,923.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	74,258,606.52	84,318,415.64	158,577,022.16

#### 7.4.7.13 存款利息收入

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12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
活期存款利息收入	1,258,079.51	2,685,861.83
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	197,508.35	253,700.03
其他	29,692.30	108,713.64
合计	1,485,280.16	3,048,275.50

注：其他包括结算保证金利息收入以及销售款利息收入。

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

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12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,088,314,410.18	257,919,425.08
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	-1,088,314,410.18	257,919,425.08

#### 7.4.7.14.2 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12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 12月31日
卖出股票成交总额	15,743,258,867.40	18,352,014,048.92
减：卖出股票成本总额	16,808,312,194.46	18,056,215,273.58
减：交易费用	23,261,083.12	37,879,350.26
买卖股票差价收入	-1,088,314,410.18	257,919,425.08

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无股票出借差价收入。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

##### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖债券差价收入。

##### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券赎回差价收入。

##### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券申购差价收入。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖资产支持证券差价收入。

##### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券赎回差价收入。

**7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券申购差价收入。

**7.4.7.17 贵金属投资收益****7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**7.4.7.18 衍生工具收益****7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖权证差价收入。

**7.4.7.18.2 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12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12 月31日
股指期货投资收益	-18,824,083.07	-10,596,267.87

**7.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
股票投资产生的股利收益	18,538,916.86	31,608,458.01
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	18,538,916.86	31,608,458.01

**7.4.7.20 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 12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年12月31日
------	---------------------------------	--------------------------------------

1. 交易性金融资产	36,132,627.34	9,241,782.70
股票投资	36,132,627.34	9,241,782.70
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	515,500.00	687,620.00
权证投资	-	-
期货投资	515,500.00	687,620.00
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	36,648,127.34	9,929,402.70

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
基金赎回费收入	3,817,607.83	1,984,965.13
基金转换费收入	16,097.03	8,032.77
合计	3,833,704.86	1,992,997.90

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。

#### 7.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
审计费用	48,000.00	62,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	43,760.29	53,487.87
合计	211,760.29	235,487.87

#### 7.4.7.24 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。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 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。

###### 7.4.10.1.2 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。

###### 7.4.10.1.3 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。

###### 7.4.10.1.4 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。

###### 7.4.10.1.5 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。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	20,248,929.32	46,613,707.38



其中：应支付销售机构的客户维护费	4,666,437.55	7,826,430.73
应支付基金管理人的净管理费	15,582,491.77	38,787,276.65

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一定比例的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数（2023年1月1日至2023年7月30日）

日基金管理费=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数（自2023年7月31日起）。

#### 7.4.10.2.2 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12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,687,410.79	3,494,246.52

注：支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.10%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：

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

#### 7.4.10.2.3 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12月31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
中国农业银行股份有限公司	-	-	-
西部利得基金管理有限公司	-	1,646,027.95	1,646,027.95
西部证券股份有限公司	-	5,791.34	5,791.34
合计	-	1,651,819.29	1,651,819.29
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12月31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
中国农业银行股份有限公司	-	-	-

公司			
西部利得基金管理有限 公司	-	5,755,046.66	5,755,046.66
西部证券股份有限公司	-	7,400.46	7,400.46
合计	-	5,762,447.12	5,762,447.12

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：

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

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 7.4.10.4.2 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通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 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 12 月 31 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	4,959,458.06	-
报告期末持有的基金份额	2,670,477.41	-

报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.4550%	-
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	2,579,330.27	-
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	0.2739%	-

注：本基金管理人于本报告期及上年度可比区间未运用自有资金投资西部利得量化成长混合 C。

#### 7.4.10.5.2 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

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

#### 7.4.10.6 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	75,354,844.45	1,258,079.51	490,829,658.84	2,685,861.83

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 12 月 31 日的相关余额为人民币 8,435,303.31 元（2023 年 12 月 31 日：人民币 18,316,273.37 元）。

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.10.8 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。

## 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

## 7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001279	强邦新材	2024年9月27日	6个月	锁定期	9.68	27.91	265	2,565.20	7,396.15	-
001391	国货航	2024年12月23日	6个月	锁定期	2.30	6.80	4,686	10,777.80	31,864.80	-
301522	上大股份	2024年10月9日	6个月	锁定期	6.88	24.84	816	5,614.08	20,269.44	-
301556	托普云农	2024年10月10日	6个月	锁定期	14.50	59.05	267	3,871.50	15,766.35	-
301571	国科天成	2024年8月14日	6个月	锁定期	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-
301585	蓝宇股份	2024年12月10日	6个月	锁定期	23.95	35.85	210	5,029.50	7,528.50	-
301586	佳力奇	2024年8月21日	6个月	锁定期	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	-
301603	乔锋智能	2024年7月3日	6个月	锁定期	26.50	41.98	233	6,174.50	9,781.34	-
301606	绿	2024	6个月	锁定	21.21	36.49	396	8,399.16	14,450.04	-

	联科技	2024年7月17日		期						
301607	富特科技	2024年8月28日	6个月	锁定期	14.00	36.14	257	3,598.00	9,287.98	-
301608	博实结	2024年7月25日	6个月	锁定期	44.50	65.38	184	8,188.00	12,029.92	-
301611	珂玛科技	2024年8月7日	6个月	锁定期	8.00	56.10	804	6,432.00	45,104.40	-
301617	博苑股份	2024年12月3日	6个月	锁定期	27.76	39.79	253	7,023.28	10,066.87	-
301622	英思特	2024年11月26日	6个月	锁定期	22.36	44.92	306	6,842.16	13,745.52	-
301631	壹连科技	2024年11月12日	6个月	锁定期	72.99	101.96	153	11,167.47	15,599.88	-
603072	天和磁材	2024年12月24日	1个月内	新股未上市	12.30	12.30	2,029	24,956.70	24,956.70	-
603072	天和磁材	2024年12月24日	6个月	锁定期	12.30	12.30	226	2,779.80	2,779.80	-
603205	健尔康	2024年10月29日	6个月	锁定期	14.65	27.35	128	1,875.20	3,500.80	-
603207	小方制药	2024年8月19日	6个月	锁定期	12.47	26.65	185	2,306.95	4,930.25	-
603285	键	2024	6个月	锁定	18.65	22.61	129	2,405.85	2,916.69	-

	邦股份	年6月28日		期						
603310	魏华新材	2024年8月7日	6个月	锁定期	17.39	17.95	254	4,417.06	4,559.30	-
603350	安乃达	2024年6月26日	6个月	锁定期	20.56	36.17	106	2,179.36	3,834.02	-
603395	红四方	2024年11月19日	6个月	锁定期	7.98	35.77	154	1,228.92	5,508.58	-
688449	联芸科技	2024年11月20日	6个月	锁定期	11.25	29.44	1,406	15,817.50	41,392.64	-
688605	先锋精科	2024年12月4日	6个月	锁定期	11.29	53.68	744	8,399.76	39,937.92	-
688708	佳驰科技	2024年11月27日	6个月	锁定期	27.08	48.95	780	21,122.40	38,181.00	-
688710	益诺思	2024年8月27日	6个月	锁定期	19.06	33.58	332	6,327.92	11,148.56	-
688721	龙图光罩	2024年7月30日	6个月	锁定期	18.50	56.85	279	5,161.50	15,861.15	-
688750	金天钛业	2024年11月12日	6个月	锁定期	7.16	15.44	1,685	12,064.60	26,016.40	-

## 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名	停牌日期	停牌原	期末估值单价	复牌日	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	-----	------	-----	--------	-----	--------	-------	--------	--------	----

	称		因		期					
002252	上海莱士	2024年12月23日	重大事项停牌	7.22	2025年1月7日	6.93	484,800	3,675,609.50	3,500,256.00	-
002494	华斯股份	2024年12月30日	重大事项停牌	3.99	2025年1月14日	3.60	285,100	1,038,139.66	1,137,549.00	-
000777	中核科技	2024年12月30日	重大事项停牌	18.07	2025年1月14日	19.88	53,900	952,897.07	973,973.00	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 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。

##### 7.4.12.3.2 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。

#### 7.4.12.4 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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。

#### 7.4.13.3 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。

##### 7.4.13.3.1 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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：

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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	75,354,844.45	-	-	-	75,354,844.45
结算备付金	16,169,768.53	-	-	-	16,169,768.53
存出保证金	1,929,363.70	-	-	-	1,929,363.70
交易性金融资产	-	-	-	1,024,190,900.70	1,024,190,900.70
应收申购款	-	-	-	476,424.71	476,424.71
应收清算款	-	-	-	4,988,627.78	4,988,627.78
资产总计	93,453,976.68	-	-	1,029,655,953.19	1,123,109,929.87
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,326,843.02	3,326,843.02
应付管理人报酬	-	-	-	1,195,662.29	1,195,662.29

应付托管费	-	-	-	99,638.53	99,638.53
应付销售服务费	-	-	-	245,672.01	245,672.01
其他负债	-	-	-	1,979,027.15	1,979,027.15
负债总计	-	-	-	6,846,843.00	6,846,843.00
利率敏感度缺口	93,453,976.68	-	-	1,022,809,110.19	1,116,263,086.87
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，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2024 年 12 月 31 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）。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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 2024 年 12 月 31 日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 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	1,024,190,900.70	91.75	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	1,024,190,900.70	91.75	5,131,121,279.23	90.07

#### 7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 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	63,064,000.00	342,953,000.00
	业绩比较基准下降 5% 的影响金额	-63,064,000.00	-342,953,000.00

注：自 2024 年起，基金管理人对于基金产品成立后封闭期内的其他价格风险敏感性分析基础数据提升了数据精度。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 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12月31日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	1,018,114,992.10	5,057,518,136.44
第二层次	5,639,514.50	-
第三层次	436,394.10	73,603,142.79
合计	1,024,190,900.70	5,131,121,279.23

##### 7.4.14.2.2 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。

##### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	73,603,142.79	73,603,142.79
当期购买	-	87,979,511.03	87,979,511.03
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	126,867,913.00	126,867,913.00
当期利得或损失总额	-	-34,278,346.72	-34,278,346.72
其中：计入损益的利得或损失	-	-34,278,346.72	-34,278,346.72
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	436,394.10	436,394.10

期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	259,616.08	259,616.08
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,889,561.15	1,889,561.15
当期购买	-	65,003,353.06	65,003,353.06
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	3,201,927.14	3,201,927.14
当期利得或损失总额	-	9,912,155.72	9,912,155.72
其中：计入损益的利得或损失	-	9,912,155.72	9,912,155.72
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	73,603,142.79	73,603,142.79
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	9,612,059.35	9,612,059.35

## 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票	436,394.10	亚式期权模型	预期波动率	34.23%-574.44%	与公允价值反向变动
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票	73,603,142.79	亚式期权模型	预期波动率	18.55%-219.88%	与公允价值反向变动

## 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 12 月 31 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)。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2024 年 12 月 31 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	1,024,190,900.70	91.19
	其中：股票	1,024,190,900.70	91.19
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	91,524,612.98	8.15
8	其他各项资产	7,394,416.19	0.66
9	合计	1,123,109,929.87	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	12,484,274.48	1.12
B	采矿业	38,069,387.24	3.41
C	制造业	618,397,544.23	55.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,430,196.20	2.82
E	建筑业	21,430,795.00	1.92
F	批发和零售业	29,938,331.00	2.68
G	交通运输、仓储和邮政业	27,091,474.80	2.43
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,183,744.07	3.06
J	金融业	134,663,682.64	12.06
K	房地产业	14,580,234.00	1.31
L	租赁和商务服务业	12,467,488.00	1.12
M	科学研究和技术服务业	26,789,706.04	2.40
N	水利、环境和公共设施管理业	16,491,503.00	1.48
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,718,856.00	0.24
Q	卫生和社会工作	1,770,860.00	0.16
R	文化、体育和娱乐业	1,682,824.00	0.15
S	综合	-	-
	合计	1,024,190,900.70	91.75

### 8.2.2 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投资股票。

### 8.3 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	600019	宝钢股份	1,440,563	10,083,941.00	0.90
2	601658	邮储银行	1,659,000	9,423,120.00	0.84
3	601225	陕西煤业	357,400	8,313,124.00	0.74
4	600887	伊利股份	226,500	6,835,770.00	0.61
5	601816	京沪高铁	1,101,200	6,783,392.00	0.61
6	600489	中金黄金	546,400	6,573,192.00	0.59
7	600918	中泰证券	993,100	6,524,667.00	0.58
8	603296	华勤技术	90,200	6,399,690.00	0.57
9	601211	国泰君安	336,600	6,277,590.00	0.56
10	601857	中国石油	687,200	6,143,568.00	0.55
11	601628	中国人寿	135,000	5,659,200.00	0.51
12	601318	中国平安	106,100	5,586,165.00	0.50
13	601169	北京银行	907,600	5,581,740.00	0.50
14	601088	中国神华	126,400	5,495,872.00	0.49
15	601728	中国电信	751,600	5,426,552.00	0.49
16	601328	XD 交通银	642,200	4,989,894.00	0.45
17	601398	工商银行	716,200	4,956,104.00	0.44
18	601939	建设银行	558,300	4,907,457.00	0.44
19	002027	分众传媒	690,300	4,852,809.00	0.43
20	601059	信达证券	316,200	4,736,676.00	0.42
21	688223	晶科能源	648,100	4,607,991.00	0.41
22	000768	中航西飞	162,100	4,577,704.00	0.41

23	600015	华夏银行	550,624	4,410,498.24	0.40
24	000333	美的集团	57,800	4,347,716.00	0.39
25	000776	广发证券	261,100	4,232,431.00	0.38
26	600219	南山铝业	1,048,200	4,098,462.00	0.37
27	002938	鹏鼎控股	111,300	4,060,224.00	0.36
28	601669	中国电建	736,600	4,021,836.00	0.36
29	002594	比亚迪	14,100	3,985,506.00	0.36
30	600346	恒力石化	257,800	3,957,230.00	0.35
31	000617	中油资本	559,400	3,854,266.00	0.35
32	601319	中国人保	501,200	3,819,144.00	0.34
33	300750	宁德时代	13,800	3,670,800.00	0.33
34	601877	正泰电器	153,900	3,602,799.00	0.32
35	601818	光大银行	925,900	3,583,233.00	0.32
36	000408	藏格矿业	128,900	3,574,397.00	0.32
37	688009	中国通号	569,600	3,565,696.00	0.32
38	601668	中国建筑	591,600	3,549,600.00	0.32
39	000895	双汇发展	136,300	3,538,348.00	0.32
40	002252	上海莱士	484,800	3,500,256.00	0.31
41	601988	中国银行	631,300	3,478,463.00	0.31
42	002415	海康威视	113,000	3,469,100.00	0.31
43	300433	蓝思科技	158,400	3,468,960.00	0.31
44	600900	XD 长江电	117,132	3,461,250.60	0.31
45	600115	中国东航	859,900	3,439,600.00	0.31
46	688396	华润微	72,400	3,416,556.00	0.31
47	600089	特变电工	266,820	3,399,286.80	0.30
48	601006	大秦铁路	498,300	3,378,474.00	0.30
49	600025	华能水电	352,600	3,353,226.00	0.30
50	000425	徐工机械	418,400	3,317,912.00	0.30
51	600919	江苏银行	334,600	3,285,772.00	0.29
52	600150	中国船舶	90,900	3,268,764.00	0.29
53	002601	龙佰集团	183,100	3,235,377.00	0.29
54	601688	华泰证券	182,900	3,217,211.00	0.29
55	603195	公牛集团	45,600	3,202,944.00	0.29
56	002066	瑞泰科技	281,600	3,190,528.00	0.29
57	000963	华东医药	91,825	3,177,145.00	0.28
58	000800	一汽解放	387,200	3,175,040.00	0.28
59	600061	国投资本	421,600	3,170,432.00	0.28
60	002001	新 和 成	144,120	3,166,316.40	0.28
61	600875	东方电气	199,200	3,165,288.00	0.28
62	600415	小商品城	233,800	3,135,258.00	0.28
63	600362	江西铜业	146,200	3,017,568.00	0.27
64	000985	大庆华科	161,200	3,014,440.00	0.27
65	600099	林海股份	338,600	2,979,680.00	0.27



66	601766	中国中车	348,600	2,921,268.00	0.26
67	300950	德固特	178,600	2,884,390.00	0.26
68	600444	国机通用	186,900	2,842,749.00	0.25
69	300665	飞鹿股份	450,500	2,793,100.00	0.25
70	601888	中国中免	41,300	2,767,513.00	0.25
71	003011	海象新材	180,600	2,745,120.00	0.25
72	600455	博通股份	131,600	2,718,856.00	0.24
73	301258	富士莱	113,900	2,690,318.00	0.24
74	603860	中公高科	90,900	2,682,459.00	0.24
75	003042	中农联合	184,900	2,634,825.00	0.24
76	300610	晨化股份	262,800	2,628,000.00	0.24
77	300511	雪榕生物	743,300	2,579,251.00	0.23
78	600969	郴电国际	398,700	2,563,641.00	0.23
79	300408	三环集团	65,500	2,522,405.00	0.23
80	000166	申万宏源	468,500	2,506,475.00	0.22
81	600837	海通证券	223,300	2,483,096.00	0.22
82	301503	智迪科技	71,500	2,453,880.00	0.22
83	600438	通威股份	109,500	2,421,045.00	0.22
84	605180	华生科技	195,100	2,393,877.00	0.21
85	000725	京东方 A	538,400	2,363,576.00	0.21
86	300931	通用电梯	358,400	2,354,688.00	0.21
87	002591	恒大高新	475,800	2,340,936.00	0.21
88	601998	中信银行	333,200	2,325,736.00	0.21
89	600938	中国海油	78,600	2,319,486.00	0.21
90	603288	海天味业	50,259	2,306,888.10	0.21
91	600999	招商证券	120,200	2,303,032.00	0.21
92	603637	镇海股份	271,300	2,259,929.00	0.20
93	301300	远翔新材	87,400	2,248,802.00	0.20
94	600406	国电南瑞	88,250	2,225,665.00	0.20
95	300628	亿联网络	57,600	2,223,360.00	0.20
96	601336	新华保险	44,700	2,221,590.00	0.20
97	300919	中伟股份	61,100	2,206,932.00	0.20
98	600183	生益科技	90,000	2,164,500.00	0.19
99	002180	纳思达	76,800	2,163,456.00	0.19
100	600371	万向德农	248,800	2,147,144.00	0.19
101	000938	紫光股份	77,000	2,142,910.00	0.19
102	301448	开创电气	103,800	2,134,128.00	0.19
103	300509	新美星	306,959	2,127,225.87	0.19
104	301209	联合化学	78,100	2,112,605.00	0.19
105	603269	海鸥股份	193,700	2,078,401.00	0.19
106	603311	金海高科	206,000	2,057,940.00	0.18
107	002357	富临运业	289,600	2,056,160.00	0.18
108	603616	韩建河山	583,300	2,047,383.00	0.18

109	002736	国信证券	181,900	2,037,280.00	0.18
110	600561	江西长运	379,300	2,036,841.00	0.18
111	300865	大宏立	87,000	2,030,580.00	0.18
112	001324	长青科技	118,500	2,028,720.00	0.18
113	603080	新疆火炬	126,000	2,026,080.00	0.18
114	000803	山高环能	394,700	2,024,811.00	0.18
115	002909	集泰股份	406,800	2,021,796.00	0.18
116	300584	海辰药业	100,200	2,020,032.00	0.18
117	300599	雄塑科技	279,100	2,015,102.00	0.18
118	300074	华平股份	506,300	2,015,074.00	0.18
119	002370	亚太药业	659,900	2,012,695.00	0.18
120	300321	同大股份	97,700	2,008,712.00	0.18
121	300556	丝路视觉	105,400	2,007,870.00	0.18
122	600448	华纺股份	757,300	2,006,845.00	0.18
123	002795	永和智控	491,800	2,006,544.00	0.18
124	002114	罗平锌电	355,300	2,003,892.00	0.18
125	603316	诚邦股份	425,300	1,998,910.00	0.18
126	600689	上海三毛	186,800	1,998,760.00	0.18
127	600149	廊坊发展	489,800	1,998,384.00	0.18
128	300243	瑞丰高材	209,800	1,997,296.00	0.18
129	000593	德龙汇能	366,000	1,994,700.00	0.18
130	300615	欣天科技	173,300	1,991,217.00	0.18
131	301065	本立科技	106,150	1,990,312.50	0.18
132	601138	工业富联	92,300	1,984,450.00	0.18
133	301163	宏德股份	93,800	1,981,994.00	0.18
134	300743	天地数码	130,100	1,981,423.00	0.18
135	001278	一彬科技	121,900	1,980,875.00	0.18
136	300387	富邦科技	247,600	1,980,800.00	0.18
137	603320	迪贝电气	140,000	1,976,800.00	0.18
138	002806	华锋股份	174,679	1,970,379.12	0.18
139	300281	金明精机	352,100	1,968,239.00	0.18
140	002853	皮阿诺	178,200	1,954,854.00	0.18
141	301027	华蓝集团	121,600	1,952,896.00	0.17
142	301257	普蕊斯	72,153	1,945,244.88	0.17
143	600697	欧亚集团	151,300	1,944,205.00	0.17
144	300780	德恩精工	135,200	1,941,472.00	0.17
145	001965	招商公路	138,000	1,925,100.00	0.17
146	605208	永茂泰	249,100	1,920,561.00	0.17
147	300823	建科智能	147,600	1,920,276.00	0.17
148	300553	集智股份	69,700	1,916,750.00	0.17
149	002826	易明医药	182,600	1,891,736.00	0.17
150	000065	北方国际	192,200	1,879,716.00	0.17
151	603286	日盈电子	95,500	1,869,890.00	0.17

152	002780	三夫户外	146,100	1,848,165.00	0.17
153	002084	海鸥住工	641,700	1,848,096.00	0.17
154	300922	天秦装备	128,500	1,843,975.00	0.17
155	300564	筑博设计	149,000	1,841,640.00	0.16
156	300675	建科院	113,700	1,832,844.00	0.16
157	605069	正和生态	239,800	1,829,674.00	0.16
158	600050	中国联通	343,500	1,823,985.00	0.16
159	300980	祥源新材	78,863	1,805,962.70	0.16
160	600408	安泰集团	879,300	1,802,565.00	0.16
161	002209	达意隆	194,200	1,802,176.00	0.16
162	300329	海伦钢琴	350,100	1,799,514.00	0.16
163	600257	大湖股份	380,700	1,796,904.00	0.16
164	300650	太龙股份	156,200	1,796,300.00	0.16
165	603028	赛福天	296,400	1,796,184.00	0.16
166	000702	正虹科技	270,700	1,794,741.00	0.16
167	002571	德力股份	437,600	1,794,160.00	0.16
168	300756	金马游乐	120,400	1,792,756.00	0.16
169	603161	科华控股	172,400	1,791,236.00	0.16
170	301355	南王科技	135,100	1,786,022.00	0.16
171	300515	三德科技	149,800	1,784,118.00	0.16
172	601229	上海银行	194,900	1,783,335.00	0.16
173	600235	民丰特纸	314,400	1,782,648.00	0.16
174	600774	汉商集团	237,700	1,780,373.00	0.16
175	600000	浦发银行	172,800	1,778,112.00	0.16
176	300591	万里马	432,600	1,777,986.00	0.16
177	002524	光正眼科	486,500	1,770,860.00	0.16
178	300611	美力科技	167,400	1,769,418.00	0.16
179	605567	春雪食品	196,600	1,769,400.00	0.16
180	603681	永冠新材	136,700	1,762,063.00	0.16
181	002691	冀凯股份	348,100	1,761,386.00	0.16
182	301229	纽泰格	80,080	1,756,154.40	0.16
183	600023	浙能电力	309,700	1,752,902.00	0.16
184	002226	江南化工	323,300	1,752,286.00	0.16
185	300637	扬帆新材	190,300	1,750,760.00	0.16
186	301042	安联锐视	48,500	1,745,515.00	0.16
187	603221	爱丽家居	191,000	1,743,830.00	0.16
188	603183	建研院	452,800	1,743,280.00	0.16
189	002731	萃华珠宝	185,200	1,739,028.00	0.16
190	300789	唐源电气	116,282	1,737,253.08	0.16
191	300967	晓鸣股份	147,700	1,735,475.00	0.16
192	300640	德艺文创	307,500	1,734,300.00	0.16
193	002828	贝肯能源	202,400	1,732,544.00	0.16
194	300030	阳普医疗	313,200	1,728,864.00	0.15

195	002873	新天药业	182,400	1,727,328.00	0.15
196	000608	阳光股份	767,600	1,727,100.00	0.15
197	002883	中设股份	169,400	1,726,186.00	0.15
198	002648	卫星化学	91,800	1,724,922.00	0.15
199	301126	达嘉维康	165,200	1,724,688.00	0.15
200	301295	美硕科技	82,400	1,722,160.00	0.15
201	603696	安记食品	209,900	1,721,180.00	0.15
202	300254	仟源医药	196,700	1,721,125.00	0.15
203	002652	扬子新材	610,100	1,720,482.00	0.15
204	002715	登云股份	115,700	1,718,145.00	0.15
205	301063	海锅股份	108,100	1,716,628.00	0.15
206	603090	宏盛股份	97,900	1,714,229.00	0.15
207	002968	新大正	186,100	1,713,981.00	0.15
208	600791	京能置业	417,900	1,713,390.00	0.15
209	603326	我乐家居	279,800	1,712,376.00	0.15
210	300966	共同药业	106,100	1,711,393.00	0.15
211	001289	龙源电力	108,900	1,710,819.00	0.15
212	002767	先锋电子	128,700	1,710,423.00	0.15
213	600735	新华锦	374,200	1,706,352.00	0.15
214	301359	东南电子	76,200	1,705,356.00	0.15
215	300369	绿盟科技	237,100	1,704,749.00	0.15
216	002887	绿茵生态	244,500	1,704,165.00	0.15
217	301053	远信工业	87,200	1,701,272.00	0.15
218	301167	建研设计	133,700	1,696,653.00	0.15
219	300519	新光药业	127,800	1,695,906.00	0.15
220	601838	成都银行	99,100	1,695,601.00	0.15
221	001316	润贝航科	58,400	1,693,600.00	0.15
222	600028	中国石化	253,400	1,692,712.00	0.15
223	603172	万丰股份	128,300	1,688,428.00	0.15
224	301008	宏昌科技	89,600	1,687,168.00	0.15
225	300642	透景生命	119,400	1,685,928.00	0.15
226	301057	汇隆新材	134,700	1,683,750.00	0.15
227	002133	广宇集团	660,100	1,683,255.00	0.15
227	600156	华升股份	348,500	1,683,255.00	0.15
228	002858	力盛体育	147,100	1,682,824.00	0.15
229	300371	汇中股份	175,400	1,682,086.00	0.15
230	603810	丰山集团	186,000	1,681,440.00	0.15
231	002802	洪汇新材	141,800	1,680,330.00	0.15
232	300246	宝莱特	254,500	1,677,155.00	0.15
233	301079	邵阳液压	110,000	1,676,400.00	0.15
234	603818	曲美家居	616,100	1,675,792.00	0.15
235	300721	怡达股份	137,000	1,668,660.00	0.15
236	300549	优德精密	101,700	1,665,846.00	0.15

237	301314	科瑞思	47,200	1,663,800.00	0.15
238	601601	中国太保	48,800	1,663,104.00	0.15
239	003008	开普检测	92,730	1,661,721.60	0.15
240	300813	泰林生物	96,200	1,661,374.00	0.15
241	300626	华瑞股份	182,100	1,660,752.00	0.15
242	301512	智信精密	42,800	1,660,640.00	0.15
243	601009	南京银行	155,840	1,659,696.00	0.15
244	300979	华利集团	21,100	1,659,515.00	0.15
245	300385	雪浪环境	351,300	1,654,623.00	0.15
246	300535	达威股份	126,900	1,653,507.00	0.15
247	300645	正元智慧	112,300	1,649,687.00	0.15
248	301072	中捷精工	87,100	1,649,674.00	0.15
249	300845	捷安高科	128,200	1,642,242.00	0.15
250	300652	雷迪克	55,200	1,640,544.00	0.15
251	300710	万隆光电	91,800	1,639,548.00	0.15
252	601236	红塔证券	192,820	1,637,041.80	0.15
253	301125	腾亚精工	147,400	1,636,140.00	0.15
254	002898	赛隆药业	170,000	1,635,400.00	0.15
255	601916	浙商银行	560,700	1,631,637.00	0.15
256	600958	东方证券	154,500	1,631,520.00	0.15
257	601881	中国银河	107,000	1,629,610.00	0.15
258	600101	明星电力	181,800	1,599,840.00	0.14
259	601607	上海医药	75,700	1,589,700.00	0.14
260	603787	新日股份	151,800	1,581,756.00	0.14
261	600196	复星医药	63,600	1,580,460.00	0.14
262	301170	锡南科技	68,700	1,574,604.00	0.14
263	000537	中绿电	172,600	1,574,112.00	0.14
264	600926	杭州银行	107,360	1,568,529.60	0.14
265	002314	南山控股	655,400	1,559,852.00	0.14
266	600051	宁波联合	238,400	1,559,136.00	0.14
267	600690	海尔智家	54,200	1,543,074.00	0.14
268	002432	九安医疗	37,700	1,537,406.00	0.14
269	003023	彩虹集团	85,300	1,526,017.00	0.14
270	688323	瑞华泰	123,300	1,515,357.00	0.14
271	002061	浙江交科	370,700	1,512,456.00	0.14
272	300906	日月明	58,000	1,506,840.00	0.13
273	603679	华体科技	112,300	1,478,991.00	0.13
274	688655	迅捷兴	136,274	1,469,033.72	0.13
275	002250	联化科技	266,581	1,468,861.31	0.13
276	603829	洛凯股份	108,800	1,466,624.00	0.13
277	300717	华信新材	105,200	1,465,436.00	0.13
278	688681	科汇股份	135,700	1,461,489.00	0.13
279	688303	大全能源	60,400	1,458,056.00	0.13

280	002295	精艺股份	215,200	1,383,736.00	0.12
281	002495	佳隆股份	538,400	1,367,536.00	0.12
282	600111	北方稀土	63,800	1,353,836.00	0.12
283	001202	炬申股份	96,500	1,340,385.00	0.12
284	002942	新农股份	93,100	1,314,572.00	0.12
285	301107	瑜欣电子	51,200	1,311,232.00	0.12
286	001260	坤泰股份	81,000	1,286,280.00	0.12
287	605003	众望布艺	67,600	1,277,640.00	0.11
288	600941	中国移动	10,500	1,240,680.00	0.11
289	688511	天微电子	78,100	1,216,017.00	0.11
290	601989	中国重工	251,700	1,210,677.00	0.11
291	600036	招商银行	30,800	1,210,440.00	0.11
292	002179	中航光电	30,000	1,179,000.00	0.11
293	600469	风神股份	191,000	1,176,560.00	0.11
294	600845	宝信软件	40,200	1,176,252.00	0.11
295	688026	洁特生物	91,200	1,170,096.00	0.10
296	002603	以岭药业	72,100	1,154,321.00	0.10
297	603259	药明康德	20,900	1,150,336.00	0.10
298	000792	盐湖股份	69,200	1,139,032.00	0.10
299	002494	华斯股份	285,100	1,137,549.00	0.10
300	600029	南方航空	174,900	1,135,101.00	0.10
301	601390	中国中铁	175,500	1,121,445.00	0.10
302	002236	大华股份	69,500	1,112,000.00	0.10
303	601166	兴业银行	58,000	1,111,280.00	0.10
304	000063	中兴通讯	27,400	1,106,960.00	0.10
305	002048	宁波华翔	87,600	1,105,512.00	0.10
306	301158	德石股份	78,700	1,104,161.00	0.10
307	688098	申联生物	201,500	1,102,205.00	0.10
308	601898	中煤能源	89,900	1,094,982.00	0.10
309	603790	雅运股份	98,700	1,087,674.00	0.10
310	002444	巨星科技	32,700	1,057,845.00	0.09
311	002091	江苏国泰	142,800	1,045,296.00	0.09
312	600097	开创国际	101,200	1,026,168.00	0.09
313	601187	厦门银行	180,900	1,020,276.00	0.09
314	001230	劲旅环境	61,500	1,019,670.00	0.09
315	000962	东方钽业	74,400	1,019,280.00	0.09
316	002935	天奥电子	63,300	1,019,130.00	0.09
317	002003	伟星股份	71,800	1,017,406.00	0.09
318	603766	隆鑫通用	111,700	1,016,470.00	0.09
319	605580	恒盛能源	91,600	1,014,928.00	0.09
320	600282	南钢股份	216,400	1,014,916.00	0.09
321	002106	莱宝高科	93,000	1,014,630.00	0.09
322	002948	青岛银行	261,400	1,014,232.00	0.09

323	600664	哈药股份	245,500	1,013,915.00	0.09
324	603585	苏利股份	84,400	1,010,268.00	0.09
325	001234	泰慕士	60,200	1,009,554.00	0.09
326	002401	中远海科	63,400	1,006,792.00	0.09
327	600449	宁夏建材	66,900	1,004,838.00	0.09
328	600745	闻泰科技	25,800	1,000,524.00	0.09
329	601226	华电科工	147,800	999,128.00	0.09
330	600660	福耀玻璃	16,000	998,400.00	0.09
331	603908	牧高笛	45,100	996,710.00	0.09
332	600343	航天动力	94,900	996,450.00	0.09
333	002608	江苏国信	129,200	990,964.00	0.09
334	301175	中科环保	182,500	985,500.00	0.09
335	002138	顺络电子	31,300	985,324.00	0.09
336	605507	国邦医药	47,300	985,259.00	0.09
337	000698	沈阳化工	291,900	983,703.00	0.09
338	300620	光库科技	20,200	981,720.00	0.09
339	301048	金鹰重工	104,700	981,039.00	0.09
340	601860	紫金银行	342,200	975,270.00	0.09
341	002836	新宏泽	132,500	975,200.00	0.09
342	002475	立讯精密	23,900	974,164.00	0.09
343	000777	中核科技	53,900	973,973.00	0.09
344	000819	岳阳兴长	58,200	973,686.00	0.09
345	000151	中成股份	69,000	973,590.00	0.09
346	603013	亚普股份	64,900	972,202.00	0.09
347	000922	佳电股份	86,100	972,069.00	0.09
348	000758	中色股份	196,700	971,698.00	0.09
349	000798	中水渔业	130,728	968,694.48	0.09
350	601996	丰林集团	451,600	966,424.00	0.09
351	002059	云南旅游	178,000	959,420.00	0.09
352	002105	信隆健康	192,200	959,078.00	0.09
353	000050	深天马 A	106,000	957,180.00	0.09
354	603506	南都物业	112,400	956,524.00	0.09
355	000920	沃顿科技	107,100	955,332.00	0.09
356	002140	东华科技	96,600	954,408.00	0.09
357	300516	久之洋	28,200	954,006.00	0.09
358	601997	贵阳银行	158,500	951,000.00	0.09
359	300970	华绿生物	79,900	950,810.00	0.09
360	002020	京新药业	74,200	949,760.00	0.09
361	600259	广晟有色	34,100	948,321.00	0.08
362	000685	中山公用	102,600	946,998.00	0.08
363	301058	中粮科工	89,500	944,225.00	0.08
364	601137	博威合金	46,500	943,950.00	0.08
365	002116	中国海诚	94,500	943,110.00	0.08

366	000856	冀东装备	136,400	941,160.00	0.08
367	001227	兰州银行	382,300	940,458.00	0.08
368	301137	哈焊华通	53,800	939,886.00	0.08
369	000635	英力特	120,700	939,046.00	0.08
370	600195	中牧股份	139,920	938,863.20	0.08
371	002017	东信和平	90,500	938,485.00	0.08
372	600640	国脉文化	78,600	938,484.00	0.08
373	600622	光大嘉宝	290,200	937,346.00	0.08
374	300797	钢研纳克	79,300	936,533.00	0.08
375	600521	华海药业	52,400	936,388.00	0.08
376	600495	晋西车轴	245,900	934,420.00	0.08
377	600523	贵航股份	78,300	933,336.00	0.08
378	001211	双枪科技	48,100	933,140.00	0.08
379	301353	普莱得	34,000	932,960.00	0.08
380	603060	国检集团	127,500	932,025.00	0.08
381	600268	国电南自	138,600	931,392.00	0.08
382	688425	铁建重工	211,600	931,040.00	0.08
383	000862	银星能源	188,400	930,696.00	0.08
384	600961	株冶集团	118,200	930,234.00	0.08
385	600081	东风科技	90,600	928,650.00	0.08
386	301311	昆船智能	51,300	928,017.00	0.08
387	600379	宝光股份	97,800	926,166.00	0.08
388	000026	飞亚达	89,300	926,041.00	0.08
389	600230	沧州大化	86,300	925,136.00	0.08
390	600058	五矿发展	129,900	924,888.00	0.08
391	600262	北方股份	50,500	924,655.00	0.08
392	688597	煜邦电力	95,000	924,350.00	0.08
393	600176	中国巨石	81,100	923,729.00	0.08
394	300305	裕兴股份	168,800	919,960.00	0.08
395	688586	江航装备	96,100	919,677.00	0.08
396	301370	国科恒泰	85,100	919,080.00	0.08
397	002462	嘉事堂	71,100	918,612.00	0.08
398	688257	新锐股份	50,400	917,784.00	0.08
399	600191	华资实业	132,300	915,516.00	0.08
400	603315	福鞍股份	85,300	914,416.00	0.08
401	300854	中兰环保	74,800	914,056.00	0.08
402	688132	邦彦技术	53,800	913,524.00	0.08
403	603969	银龙股份	135,100	913,276.00	0.08
404	300388	节能国祯	120,600	910,530.00	0.08
405	600125	铁龙物流	153,500	910,255.00	0.08
406	002440	闰土股份	135,300	907,863.00	0.08
407	001366	播恩集团	86,700	907,749.00	0.08
408	000652	泰达股份	218,900	906,246.00	0.08



409	000928	中钢国际	142,200	905,814.00	0.08
410	601369	陕鼓动力	104,100	905,670.00	0.08
411	000157	中联重科	125,200	905,196.00	0.08
412	600744	华银电力	291,000	905,010.00	0.08
413	603329	上海雅仕	70,200	904,878.00	0.08
414	603583	捷昌驱动	36,600	904,386.00	0.08
415	603280	南方路机	43,300	904,104.00	0.08
416	000969	安泰科技	81,000	903,150.00	0.08
417	688130	晶华微	34,300	902,090.00	0.08
418	600704	物产中大	178,200	901,692.00	0.08
419	603260	合盛硅业	16,200	900,072.00	0.08
420	300523	辰安科技	45,400	898,466.00	0.08
421	000898	鞍钢股份	373,700	896,880.00	0.08
422	600801	华新水泥	73,900	894,190.00	0.08
423	600184	光电股份	86,600	893,712.00	0.08
424	000977	浪潮信息	17,200	892,336.00	0.08
425	000881	中广核技	121,700	892,061.00	0.08
426	002958	青农商行	293,400	891,936.00	0.08
427	603176	汇通集团	200,400	891,780.00	0.08
428	000786	北新建材	29,400	891,114.00	0.08
429	600501	航天晨光	49,100	890,674.00	0.08
430	688663	新风光	41,000	890,110.00	0.08
431	002871	伟隆股份	91,800	889,542.00	0.08
432	300455	航天智装	68,600	889,056.00	0.08
433	002273	水晶光电	40,000	888,800.00	0.08
434	600018	上港集团	145,000	887,400.00	0.08
435	002463	沪电股份	22,300	884,195.00	0.08
436	002096	易普力	74,400	883,872.00	0.08
437	688186	广大特材	57,500	882,625.00	0.08
438	001336	楚环科技	50,200	882,516.00	0.08
438	002910	庄园牧场	117,200	882,516.00	0.08
439	002057	中钢天源	122,200	882,284.00	0.08
440	000932	华菱钢铁	211,000	881,980.00	0.08
441	002777	久远银海	51,200	881,664.00	0.08
442	000001	平安银行	75,300	881,010.00	0.08
443	300002	神州泰岳	76,000	880,840.00	0.08
444	600267	海正药业	106,100	880,630.00	0.08
445	002984	森麒麟	35,700	880,362.00	0.08
446	603698	航天工程	56,500	879,140.00	0.08
447	601966	玲珑轮胎	48,700	878,548.00	0.08
448	603979	金诚信	24,200	878,460.00	0.08
449	600135	乐凯胶片	133,100	877,129.00	0.08
450	002241	歌尔股份	33,900	874,959.00	0.08

451	002204	大连重工	175,100	871,998.00	0.08
452	000417	合百集团	136,600	871,508.00	0.08
453	600636	国新文化	93,900	871,392.00	0.08
454	002275	桂林三金	57,700	870,693.00	0.08
455	600990	四创电子	40,900	870,352.00	0.08
456	600369	西南证券	186,000	868,620.00	0.08
457	600908	无锡银行	146,800	867,588.00	0.08
458	301298	东利机械	62,900	866,762.00	0.08
459	301002	崧盛股份	51,000	866,490.00	0.08
460	605287	德才股份	71,200	865,080.00	0.08
461	002555	三七互娱	55,300	864,892.00	0.08
462	300308	中际旭创	7,000	864,570.00	0.08
463	603307	扬州金泉	24,100	862,780.00	0.08
464	603699	纽威股份	38,800	860,196.00	0.08
465	002367	康力电梯	125,200	860,124.00	0.08
466	600487	亨通光电	49,900	859,278.00	0.08
467	601899	紫金矿业	56,827	859,224.24	0.08
468	688345	博力威	47,171	857,097.07	0.08
469	002649	博彦科技	70,700	856,884.00	0.08
470	002798	帝欧家居	195,600	856,728.00	0.08
471	603798	康普顿	96,900	855,627.00	0.08
472	600335	国机汽车	137,300	855,379.00	0.08
473	688182	灿勤科技	47,800	854,664.00	0.08
474	002825	纳尔股份	109,292	854,663.44	0.08
475	002921	联诚精密	78,100	854,414.00	0.08
476	002760	凤形股份	50,100	851,700.00	0.08
477	301234	五洲医疗	33,800	850,070.00	0.08
478	301086	鸿富瀚	16,700	849,529.00	0.08
479	300326	凯利泰	130,300	846,950.00	0.08
480	601399	国机重装	274,900	846,692.00	0.08
481	301233	盛帮股份	18,600	845,370.00	0.08
482	002743	富煌钢构	128,300	842,931.00	0.08
483	300482	万孚生物	37,600	842,616.00	0.08
484	000686	东北证券	106,100	842,434.00	0.08
485	688509	正元地信	212,100	842,037.00	0.08
486	603165	荣晟环保	68,700	840,888.00	0.08
487	688191	智洋创新	49,400	840,788.00	0.08
488	688081	兴图新科	53,400	840,516.00	0.08
489	301023	江南奕帆	17,800	840,160.00	0.08
490	603687	大胜达	115,200	839,808.00	0.08
491	002939	长城证券	102,400	839,680.00	0.08
492	301130	西点药业	31,800	834,750.00	0.07
493	301235	华康医疗	41,300	834,673.00	0.07

494	002160	常铝股份	223,900	832,908.00	0.07
495	002996	顺博合金	125,000	830,000.00	0.07
496	300683	海特生物	34,800	829,632.00	0.07
497	300658	延江股份	160,000	828,800.00	0.07
498	301379	天山电子	41,000	828,200.00	0.07
499	603700	宁水集团	82,700	827,827.00	0.07
500	301279	金道科技	41,000	827,790.00	0.07
501	002372	伟星新材	65,500	827,265.00	0.07
502	301109	军信股份	49,500	825,660.00	0.07
503	001299	美能能源	66,300	824,772.00	0.07
504	601992	金隅集团	462,500	823,250.00	0.07
505	688347	华虹公司	17,700	822,519.00	0.07
506	688707	振华新材	75,000	821,250.00	0.07
507	600658	电子城	186,700	817,746.00	0.07
508	000059	华锦股份	168,800	808,552.00	0.07
509	603373	安邦护卫	27,000	807,030.00	0.07
510	002817	黄山胶囊	128,900	806,914.00	0.07
511	300932	三友联众	55,300	806,827.00	0.07
512	002787	华源控股	102,200	805,336.00	0.07
513	600962	国投中鲁	61,200	804,780.00	0.07
514	300234	开尔新材	172,100	803,707.00	0.07
515	301196	唯科科技	24,400	802,028.00	0.07
516	000411	英特集团	75,200	800,880.00	0.07
517	603903	中持股份	124,200	798,606.00	0.07
518	301215	中汽股份	134,200	798,490.00	0.07
519	301373	凌玮科技	31,400	796,932.00	0.07
520	603538	美诺华	62,700	796,917.00	0.07
521	300373	扬杰科技	18,300	796,416.00	0.07
522	301390	经纬股份	23,600	794,612.00	0.07
523	001367	海森药业	29,100	792,684.00	0.07
524	002479	富春环保	167,200	792,528.00	0.07
525	301156	美农生物	62,510	790,751.50	0.07
526	600075	新疆天业	181,300	788,655.00	0.07
527	688485	九州一轨	91,300	787,919.00	0.07
528	002030	达安基因	138,600	787,248.00	0.07
529	688557	兰剑智能	41,000	785,970.00	0.07
530	301500	飞南资源	43,500	783,000.00	0.07
531	688061	灿瑞科技	27,100	782,648.00	0.07
532	603856	东宏股份	70,800	782,340.00	0.07
533	301212	联盛化学	37,600	777,192.00	0.07
534	688217	睿昂基因	41,900	772,636.00	0.07
535	301356	天振股份	48,960	771,609.60	0.07
536	002365	永安药业	96,400	770,236.00	0.07

537	002998	优彩资源	121,500	767,880.00	0.07
538	601609	金田股份	129,600	764,640.00	0.07
539	688022	瀚川智能	69,100	757,336.00	0.07
540	688393	安必平	43,400	751,254.00	0.07
541	301148	嘉戎技术	41,000	750,300.00	0.07
542	605068	明新旭腾	55,700	749,165.00	0.07
543	000718	苏宁环球	316,700	747,412.00	0.07
544	001368	通达创智	39,500	744,970.00	0.07
545	603725	天安新材	115,900	744,078.00	0.07
546	301227	森鹰窗业	45,700	740,340.00	0.07
547	601919	中远海控	47,500	736,250.00	0.07
548	301081	严牌股份	86,600	734,368.00	0.07
549	002566	益盛药业	106,500	726,330.00	0.07
550	002811	郑中设计	84,400	723,308.00	0.06
551	002332	仙琚制药	72,700	722,638.00	0.06
552	688330	宏力达	27,500	721,600.00	0.06
553	301056	森赫股份	87,700	717,386.00	0.06
554	605255	天普股份	56,700	713,853.00	0.06
555	603993	洛阳钼业	107,000	711,550.00	0.06
556	605155	西大门	70,700	711,242.00	0.06
557	603159	上海亚虹	45,700	709,264.00	0.06
558	300749	顶固集创	115,200	708,480.00	0.06
559	300614	百川畅银	74,500	706,260.00	0.06
560	300871	回盛生物	69,900	703,194.00	0.06
561	000726	鲁泰 A	107,800	702,856.00	0.06
562	688573	信宇人	45,000	701,550.00	0.06
563	300819	聚杰微纤	53,900	700,700.00	0.06
564	002548	金新农	172,900	686,413.00	0.06
565	002483	润邦股份	131,300	684,073.00	0.06
566	600128	苏豪弘业	84,200	683,704.00	0.06
567	000900	现代投资	154,900	683,109.00	0.06
568	600261	阳光照明	208,300	681,141.00	0.06
569	002545	东方铁塔	96,800	680,504.00	0.06
570	003030	祖名股份	44,200	679,796.00	0.06
571	600208	衢州发展	229,600	679,616.00	0.06
572	601188	龙江交通	188,700	679,320.00	0.06
573	002950	奥美医疗	77,800	679,194.00	0.06
574	603577	汇金通	84,800	677,552.00	0.06
575	001231	农心科技	40,300	672,607.00	0.06
576	301287	康力源	23,600	670,476.00	0.06
577	601083	锦江航运	70,300	669,256.00	0.06
578	601002	晋亿实业	153,800	669,030.00	0.06
579	600366	宁波韵升	90,500	666,080.00	0.06

580	603928	兴业股份	80,400	665,712.00	0.06
581	600592	龙溪股份	67,300	664,924.00	0.06
582	002696	百洋股份	140,200	663,146.00	0.06
583	600853	龙建股份	165,500	662,000.00	0.06
584	600216	浙江医药	41,700	661,362.00	0.06
585	300955	嘉亨家化	41,800	660,440.00	0.06
586	601177	杭齿前进	79,700	659,916.00	0.06
587	002718	友邦吊顶	53,900	659,197.00	0.06
588	603909	建发合诚	71,900	658,604.00	0.06
589	002753	永东股份	104,900	657,723.00	0.06
590	600665	天地源	209,500	655,735.00	0.06
591	300907	康平科技	31,000	652,240.00	0.06
592	002772	众兴菌业	88,400	651,508.00	0.06
593	688163	赛伦生物	37,100	651,476.00	0.06
594	301305	朗坤环境	36,900	650,178.00	0.06
595	000897	津滨发展	274,100	649,617.00	0.06
596	603301	振德医疗	29,500	648,705.00	0.06
597	002144	宏达高科	62,200	647,502.00	0.06
598	000638	万方发展	138,500	645,410.00	0.06
599	600731	湖南海利	113,100	644,670.00	0.06
600	002224	三力士	149,200	644,544.00	0.06
601	688335	复活环保	76,400	644,052.00	0.06
602	301331	恩威医药	27,700	639,870.00	0.06
603	600419	天润乳业	68,700	639,597.00	0.06
604	300838	浙江力诺	50,100	634,266.00	0.06
605	603102	百合股份	18,000	631,800.00	0.06
606	002136	安纳达	64,600	629,850.00	0.06
607	300999	金龙鱼	19,300	629,373.00	0.06
608	300505	川金诺	43,700	629,280.00	0.06
609	002982	湘佳股份	35,200	628,320.00	0.06
610	300434	金石亚药	75,900	626,175.00	0.06
611	301276	嘉曼服饰	30,700	624,745.00	0.06
612	002562	兄弟科技	146,500	622,625.00	0.06
613	300004	南风股份	100,600	618,690.00	0.06
614	301003	江苏博云	28,300	617,789.00	0.06
615	301077	星华新材	23,000	614,790.00	0.06
616	301112	信邦智能	26,300	614,631.00	0.06
617	300759	康龙化成	23,900	614,230.00	0.06
618	300126	锐奇股份	119,700	614,061.00	0.06
619	001259	利仁科技	28,400	613,440.00	0.05
620	688089	嘉必优	32,000	608,960.00	0.05
621	000691	亚太实业	175,300	601,279.00	0.05
622	605122	四方新材	56,200	597,406.00	0.05

623	001331	胜通能源	54,160	596,301.60	0.05
624	600027	华电国际	105,400	591,294.00	0.05
625	300920	润阳科技	34,900	590,508.00	0.05
626	688310	迈得医疗	54,500	588,600.00	0.05
627	301192	泰祥股份	33,800	588,458.00	0.05
628	301518	长华化学	36,500	586,555.00	0.05
629	603192	汇得科技	39,400	584,696.00	0.05
630	688296	和达科技	51,800	581,196.00	0.05
631	603089	正裕工业	64,200	575,874.00	0.05
632	301006	迈拓股份	43,100	568,058.00	0.05
633	605055	迎丰股份	114,800	564,816.00	0.05
634	001210	金房能源	39,500	551,815.00	0.05
635	605151	西上海	34,400	550,744.00	0.05
636	600423	柳化股份	186,300	547,722.00	0.05
637	688501	青达环保	39,000	547,170.00	0.05
638	003017	大洋生物	28,900	538,118.00	0.05
639	603059	倍加洁	23,000	536,590.00	0.05
640	002360	同德化工	108,300	532,836.00	0.05
641	603321	梅轮电梯	75,900	531,300.00	0.05
642	603685	晨丰科技	44,700	525,672.00	0.05
643	688562	航天软件	33,000	525,030.00	0.05
644	603041	美思德	48,700	520,603.00	0.05
645	600383	金地集团	117,400	514,212.00	0.05
646	300014	亿纬锂能	11,000	514,140.00	0.05
647	001338	永顺泰	47,200	513,536.00	0.05
648	688600	皖仪科技	38,000	511,100.00	0.05
649	300837	浙矿股份	25,300	510,048.00	0.05
650	688069	德林海	33,400	501,668.00	0.04
651	001225	和泰机电	15,400	497,728.00	0.04
652	002809	红墙股份	62,600	496,418.00	0.04
653	301429	森泰股份	31,900	495,726.00	0.04
654	603331	百达精工	55,000	495,550.00	0.04
655	301037	保立佳	47,200	486,632.00	0.04
656	603022	新通联	65,200	475,960.00	0.04
657	301113	雅艺科技	20,200	472,276.00	0.04
658	600137	浪莎股份	33,559	471,503.95	0.04
659	001268	联合精密	26,900	469,674.00	0.04
660	603968	醋化股份	50,600	469,062.00	0.04
661	688669	聚石化学	30,200	466,288.00	0.04
662	003816	中国广核	110,800	457,604.00	0.04
663	002830	名雕股份	36,600	457,134.00	0.04
664	603137	恒尚节能	42,700	452,620.00	0.04
665	601368	绿城水务	94,800	451,248.00	0.04

666	001218	丽臣实业	26,000	447,980.00	0.04
667	002890	弘宇股份	44,930	443,009.80	0.04
668	605189	富春染织	35,300	428,895.00	0.04
669	603709	中源家居	39,400	428,278.00	0.04
670	300241	瑞丰光电	77,200	423,828.00	0.04
671	603150	万朗磁塑	15,600	413,556.00	0.04
672	301043	绿岛风	13,700	392,231.00	0.04
673	603926	铁流股份	41,000	362,850.00	0.03
674	603073	彩蝶实业	24,100	352,101.00	0.03
675	003018	金富科技	36,200	335,212.00	0.03
676	603132	金徽股份	29,800	334,654.00	0.03
677	600433	冠豪高新	104,250	330,472.50	0.03
678	688552	航天南湖	19,700	328,990.00	0.03
679	605033	美邦股份	27,200	327,216.00	0.03
680	301105	鸿铭股份	11,500	319,700.00	0.03
681	603578	三星新材	26,500	314,025.00	0.03
682	603813	原尚股份	27,000	312,930.00	0.03
683	600585	海螺水泥	13,000	309,140.00	0.03
684	000858	五粮液	2,200	308,088.00	0.03
685	600519	贵州茅台	200	304,800.00	0.03
686	688334	西高院	18,500	302,105.00	0.03
687	601968	宝钢包装	60,700	300,465.00	0.03
688	688553	汇宇制药	17,100	259,920.00	0.02
689	688184	帕瓦股份	18,600	255,006.00	0.02
690	688459	哈铁科技	23,800	229,432.00	0.02
691	688329	艾隆科技	16,600	227,254.00	0.02
692	600162	香江控股	116,900	224,448.00	0.02
693	300335	迪森股份	43,600	210,152.00	0.02
694	688466	金科环境	15,400	208,670.00	0.02
695	601633	长城汽车	6,500	171,145.00	0.02
696	002732	燕塘乳业	10,100	158,671.00	0.01
697	688093	世华科技	7,700	155,463.00	0.01
698	000568	泸州老窖	1,200	150,240.00	0.01
699	603677	奇精机械	9,600	129,408.00	0.01
700	603949	雪龙集团	9,500	113,905.00	0.01
701	688670	金迪克	9,200	111,504.00	0.01
702	601156	东航物流	5,100	86,037.00	0.01
703	688607	康众医疗	6,092	80,719.00	0.01
704	000544	中原环保	8,300	72,459.00	0.01
705	002774	快意电梯	9,600	66,528.00	0.01
706	301611	珂玛科技	804	45,104.40	0.00
707	688449	联芸科技	1,406	41,392.64	0.00
708	688605	先锋精科	744	39,937.92	0.00

709	000591	太阳能	8,200	39,032.00	0.00
710	688708	佳驰科技	780	38,181.00	0.00
711	001391	国货航	4,686	31,864.80	0.00
712	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.00
713	688750	金天钛业	1,685	26,016.40	0.00
714	301522	上大股份	816	20,269.44	0.00
715	000027	深圳能源	3,000	19,440.00	0.00
716	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.00
717	301556	托普云农	267	15,766.35	0.00
718	301631	壹连科技	153	15,599.88	0.00
719	301606	绿联科技	396	14,450.04	0.00
720	301571	国科天成	350	14,290.50	0.00
721	600276	恒瑞医药	300	13,770.00	0.00
722	301622	英思特	306	13,745.52	0.00
723	301608	博实结	184	12,029.92	0.00
724	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
725	688710	益诺思	332	11,148.56	0.00
726	301617	博苑股份	253	10,066.87	0.00
727	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
728	301607	富特科技	257	9,287.98	0.00
729	301585	蓝宇股份	210	7,528.50	0.00
730	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.00
731	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
732	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
733	603310	巍华新材	254	4,559.30	0.00
734	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
735	603205	健尔康	128	3,500.80	0.00
736	603285	键邦股份	129	2,916.69	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	601857	中国石油	58,416,058.00	1.03
2	600519	贵州茅台	54,015,066.00	0.95
3	600489	中金黄金	37,585,552.60	0.66
4	601601	中国太保	36,431,255.00	0.64
5	600019	宝钢股份	35,275,088.68	0.62
6	601377	兴业证券	34,864,839.59	0.61
7	600362	江西铜业	32,878,957.00	0.58
8	600015	华夏银行	32,459,216.76	0.57
9	600050	中国联通	31,794,535.00	0.56
10	600183	生益科技	31,200,981.00	0.55



11	601328	XD 交通银	30,807,012.00	0.54
12	603185	弘元绿能	30,606,455.04	0.54
13	600406	国电南瑞	30,532,207.07	0.54
14	601229	上海银行	30,393,667.34	0.53
15	000800	一汽解放	30,054,955.00	0.53
16	603396	金辰股份	29,999,960.53	0.53
17	600941	中国移动	29,148,526.82	0.51
18	000651	格力电器	28,235,340.00	0.50
19	601998	中信银行	28,122,514.00	0.49
20	002736	国信证券	26,751,096.00	0.47

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。

#### 8.4.2 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	601857	中国石油	55,911,369.00	0.98
2	600519	贵州茅台	53,319,368.20	0.94
3	600050	中国联通	50,749,237.33	0.89
4	601398	工商银行	50,241,118.00	0.88
5	601998	中信银行	48,401,203.06	0.85
6	601607	上海医药	48,374,532.40	0.85
7	601166	兴业银行	46,899,865.56	0.82
8	601728	中国电信	46,621,718.00	0.82
9	600741	华域汽车	46,287,234.46	0.81
10	002938	鹏鼎控股	46,163,390.20	0.81
11	000333	美的集团	45,950,253.67	0.81
12	601319	中国人保	43,957,485.46	0.77
13	600036	招商银行	39,896,919.38	0.70
14	601800	中国交建	39,532,967.53	0.69
15	600030	中信证券	38,695,882.90	0.68
16	000538	云南白药	38,250,619.14	0.67
17	601698	中国卫通	37,940,462.74	0.67
18	601601	中国太保	37,848,856.00	0.66
19	601988	中国银行	37,745,087.00	0.66
20	600015	华夏银行	36,421,697.00	0.64

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。

#### 8.4.3 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	12,665,249,188.59
--------------	-------------------

卖出股票收入（成交）总额	15,743,258,867.40
--------------	-------------------

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。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

### 8.6 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

本基金本报告期末未持有债券投资。

### 8.7 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。

### 8.8 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投资。

### 8.9 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。

### 8.10 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。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货不在本基金投资范围内。

#### 8.11.2 本期国债期货投资评价

国债期货不在本基金投资范围内。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 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中，中泰证券股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 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	1,929,363.70
2	应收清算款	4,988,627.78
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	476,424.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,394,416.19

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 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。

### 8.12.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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	38,270	10,521.49	108,167,296.70	26.86	294,490,071.33	73.14
西部利得量化成长混合 C	51,282	3,592.11	75,537,085.20	41.01	108,673,721.21	58.99
合计	88,393	6,639.31	183,704,381.90	31.30	403,163,792.54	68.70

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）。

## 9.2 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	7,242,340.89	1.7986
	西部利得量化成长混合 C	2,007,042.74	1.0895
	合计	9,249,383.63	1.5761

## 9.3 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、基金投资和研究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	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	西部利得量化成长混合 A	10~50
	西部利得量化成长混合 C	-
	合计	10~50

## 9.4 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	2,670,477.41	0.46	91,147.14	0.02	36 个月
基金管理人高级管理人员	4,249,116.09	0.72	-	-	-
基金经理等人员	230,273.64	0.04	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	2,794,858.52	0.48	-	-	-
合计	9,944,725.66	1.70	91,147.14	0.02	36 个月

## § 10 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	181,206,538.48	262,328,426.20
减：本报告期基金总 赎回份额	1,371,074,196.22	1,271,350,788.46
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	402,657,368.03	184,210,806.41

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。

## § 11 重大事件揭示

## 11.1 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。

## 11.2 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的重大人事变动如下：

根据基金管理人第二届董事会第三十九次会议决议，自2024年10月24日起总经理贺燕萍代为履行首席信息官职责，免去艾书莘首席信息官职务。

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。

## 11.3 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。

## 11.4 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。

## 11.5 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。本报告期应支付毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计费人民币48,000.00元。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 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。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	5,341,291,564.40	18.86	1,313,463.39	9.68	-
广发证券	2	3,352,172,299.37	11.84	1,653,212.54	12.18	-
中泰证券	3	3,214,625,057.13	11.35	1,848,537.30	13.62	-
长江证券	1	3,177,377,231.29	11.22	1,416,822.33	10.44	-
西南证券	2	2,505,339,761.17	8.85	1,117,144.46	8.23	-
民生证券	1	2,496,325,027.51	8.82	1,862,014.39	13.72	-
国信证券	2	2,241,089,288.83	7.91	1,505,895.13	11.09	-
方正证券	2	2,225,565,165.09	7.86	1,214,950.24	8.95	-
中邮证券	2	2,042,870,070.45	7.21	706,642.16	5.21	-
东北证券	3	1,218,120,066.68	4.30	710,243.43	5.23	-
海通证券	2	319,554,243.68	1.13	142,491.83	1.05	-
东方证券	2	183,284,503.18	0.65	81,725.23	0.60	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

注：1. 本基金交易单元的选择标准主要包括：(1) 主体指标，包括证券公司的财务状况评估、经营规范评估、合规内控评估；(2) 研究服务指标，包括证券公司的研究资源评估、研究能力评估、研究合规性持续评估等。选择程序主要如下：基于上述评估指标，公司定期开展券商准入评估，结合负面剔除情形，形成研究服务准入白名单，对于进入研究服务准入白名单且综合研究服务能力达到分佣要求的券商可根据业务需要推动交易席位租用流程，与对应券商签订席位租用协议。

2. 上表为本基金通过证券公司进行股票投资及佣金支付情况，报告期间为 2024 年 1 月 1 日-2024 年 12 月 31 日。

### 11.7.2 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	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
光大证	-	-	-	-	-	-

券						
湘财证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
英大证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	西部利得基金管理有限公司关于即将终止北京中期时代基金销售有限公司办理相关销售业务并为投资者办理转托管业务的提示性公告	基金管理人公司网站、中国证监会基金电子披露网站及本基金选定的信息披露报纸	2024年2月1日
2	西部利得基金管理有限公司关于即将终止华融融达期货股份有限公司办理相关销售业务并为投资者办理转托管业务的提示性公告	同上	2024年3月11日
3	西部利得基金管理有限公司关于即将终止喜鹊财富基金销售有限公司办理相关销售业务并为投资者办理转托管业务的提示性公告	同上	2024年7月31日
4	西部利得基金管理有限公司关于客户服务中心（含直销中心）变更办公地址的公告	同上	2024年8月9日
5	西部利得基金管理有限公司关于深圳分公司地址变更的公告	同上	2024年8月12日
6	西部利得基金管理有限公司关于北京分公司负责人变更的公告	同上	2024年8月24日
7	西部利得基金管理有限公司关于提醒投资者注意防范不法分子冒用西部利得基金名义进行诈骗活动的提示性公告	同上	2024年8月29日
8	西部利得基金管理有限公司关于即将终止上海凯石财富基金销售有限公司办理相关销售业务并为投资者办理转托管业务的提示性公告	同上	2024年9月30日
9	西部利得基金管理有限公司关于即将终止海银基金销售有限公司办理相关销售业务并为投资者办理转托管业务的提示性公告	同上	2024年10月23日
10	西部利得基金管理有限公司基金行	同上	2024年10月26日



	业高级管理人员变更公告		
11	西部利得基金管理有限公司关于旗下部分基金的销售机构由北京中植基金销售有限公司变更为华源证券股份有限公司的公告	同上	2024 年 12 月 12 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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							
<p>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。</p>							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。
----

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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) 本基金更新的《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) 报告期内涉及本基金公告的各项原稿。

### 13.2 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

### 13.3 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

2025 年 3 月 28 日