

西部利得量化优选一年持有期混合型证券  
投资基金  
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：西部利得基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 28 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 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>44</b>
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55

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 .....	55
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 .....	55
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 .....	55
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 .....	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	56
7.12 投资组合报告附注 .....	56
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>57</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	57
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 .....	57
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>58</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>58</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	58
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 .....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	59
10.4 基金投资策略的改变 .....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	59
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 .....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	59
10.8 其他重大事件 .....	61
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>61</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 .....	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	61
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>61</b>
12.1 备查文件目录 .....	61
12.2 存放地点 .....	61
12.3 查阅方式 .....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	西部利得量化优选一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	西部利得量化优选一年持有期混合	
基金主代码	010779	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 1 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	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	526,254,047.44 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	西部利得量化优选一年持有期混合 A	西部利得量化优选一年持有期混合 C
下属分级基金的交易代码	010779	010780
报告期末下属分级基金的份额总额	413,252,735.28 份	113,001,312.16 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制组合下行风险的基础上，通过积极主动的投资管理，争取实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券的投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、融资交易策略等。（详见《基金合同》）
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*75%+中债综合全价（总值）指数收益率*25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。

### 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	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵毅
	联系电话	021-38572888
	电子邮箱	service@westleadfund.com
客户服务电话	4007-007-818	95595
传真	021-50710261	010-63639132
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区耀体路 276 号 901 室-908 室	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区耀体路 276 号 901 室-908 室	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码	200126	100033
法定代表人	何方	王江

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年1月1日-2023年6月30日)	
	西部利得量化优选一年持有期混合 A	西部利得量化优选一年持有期混合 C
本期已实现收益	21,129,389.59	5,559,644.87
本期利润	45,407,376.31	11,731,363.51
加权平均基金份额本期利润	0.1030	0.0971
本期加权平均净值利润率	10.86%	10.34%
本期基金份额净值增长率	11.27%	11.04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)	
	西部利得量化优选一年持有期混合 A	西部利得量化优选一年持有期混合 C
期末可供分配利润	-32,745,788.53	-10,042,490.16
期末可供分配基金份额利润	-0.0792	-0.0889
期末基金资产净值	406,107,194.33	109,953,946.82
期末基金份额净值	0.9827	0.9730
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
	西部利得量化优选一年持有期混合 A	西部利得量化优选一年持有期混合 C
基金份额累计净值增长率	3.10%	2.10%

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

西部利得量化优选一年持有期混合 A

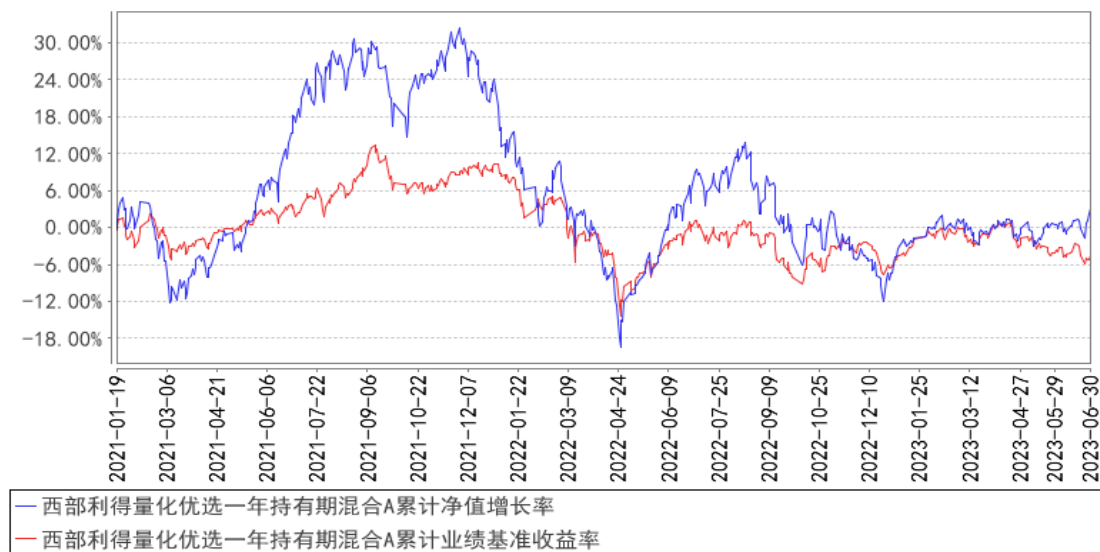
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.95%	0.93%	-0.55%	0.70%	3.50%	0.23%
过去三个月	3.36%	0.86%	-3.80%	0.62%	7.16%	0.24%
过去六个月	11.27%	0.83%	2.09%	0.59%	9.18%	0.24%
过去一年	-2.70%	1.22%	-4.82%	0.72%	2.12%	0.50%
自基金合同生效起至今	3.10%	1.47%	-4.46%	0.84%	7.56%	0.63%

西部利得量化优选一年持有期混合 C

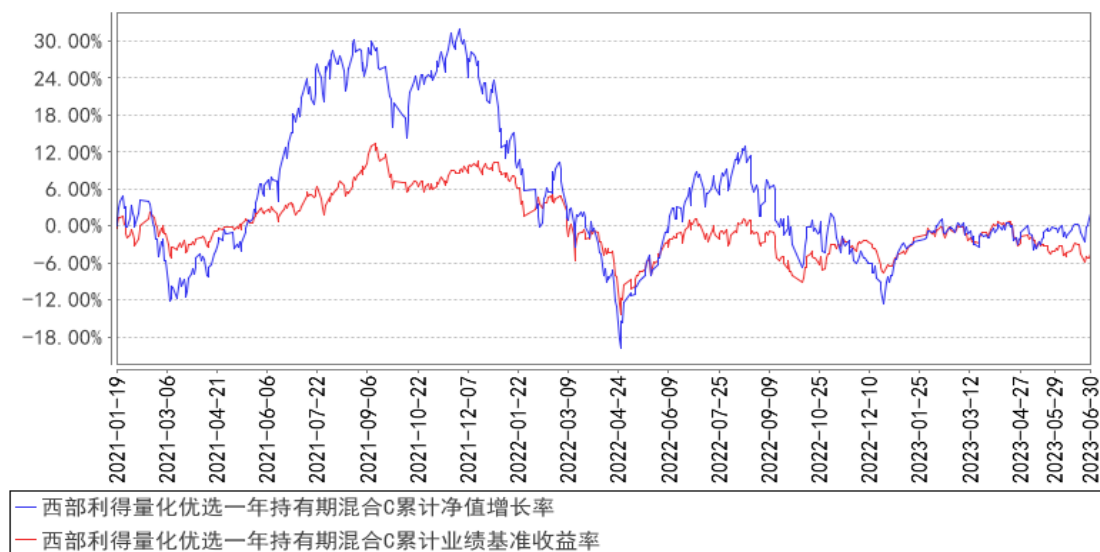
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.92%	0.93%	-0.55%	0.70%	3.47%	0.23%
过去三个月	3.25%	0.86%	-3.80%	0.62%	7.05%	0.24%
过去六个月	11.04%	0.83%	2.09%	0.59%	8.95%	0.24%
过去一年	-3.09%	1.22%	-4.82%	0.72%	1.73%	0.50%
自基金合同生效起至今	2.10%	1.47%	-4.46%	0.84%	6.56%	0.63%

### 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

西部利得量化优选一年持有期混合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



西部利得量化优选一年持有期混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### 3.3 其他指标

无

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

西部利得基金管理有限公司于 2010 年 7 月 20 日正式成立，公司总部设在上海，在北京、深圳设有分公司，是经中国证监会批准设立的第 60 家全国规范性基金管理公司，自成立以来逐步成



长为一家以绝对收益产品为特色的资产管理人。目前公司具有公募基金、特定客户资产管理、受托管理保险资金、合格境内机构投资者资格（获批筹建）等多类别资产管理业务。

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
盛 丰 衍	主动量化投资部总经理、投资总监、基金经理	2021 年 1 月 19 日	-	10 年	复旦大学计算机应用技术硕士，曾任光大证券股份有限公司权益投资助理、上海光大证券资产管理有限公司研究员、兴证证券资产管理有限公司量化研究员。2016 年 10 月加入本公司，具有基金从业资格，中国国籍。
翟 梓 舰	基金经理助理	2023 年 6 月 30 日	-	5 年	硕士毕业于美国哥伦比亚大学工业工程专业，曾任华泰证券股份有限公司算法工程师。2022 年 6 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。

#### 4.2 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 公平交易制度的执行情况

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

本基金管理人风险管理部负责对各账户公平交易进行事后监察，在每日公平交易报表中记录

不同投资组合当天整体收益率、分投资类别（股票、债券）同向（1日、3日、5日）交易价差分析、银行间交易价格偏离度分析；并分别于季度和年度末编制公平交易季度及年度收益率差异分析报告，对本基金管理人管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）不同时间窗口同向（1日、3日、5日）交易的交易价差以及 T 检验、银行间交易价格偏离度进行了分析。

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

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

投资策略上，本基金始终维持高股票仓位，量子策略选择上有一定灵活度，股票持仓分散以弱化个股黑天鹅的影响。本基金量化策略的特点是分域建模的基本面量化、专注于能力域、量化为舟主观为舵。本基金努力通过选股获得超额收益，以期打造成成长风格的优质量化基金，在接下来的投资管理中会坚持类似的投资风格。

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 2023 年三季度，影响 A 股的主要有三股力量。

其一是资本市场负债端变化

公募、私募、外资都是主要的资本市场资金来源，影响着市场的波动。其中公募、私募资金随着市场回暖，持有大票的基金或面临更大的赎回压力，主动权益类的新发私募公募基金中量化相关比重提升，这可能将推动小市值风格继续强势。外资的流入流出受中美利差影响较大，2022 年

及 2023 年上半年这个因素是负面的，而 2023 年下半年则要乐观许多。

其二上市公司 2023 年二季报业绩以及三季报展望

每年 4 月-10 月，上市公司盈利增速是 A 股行业配置的重要参考指标。

其三是经济的结构变化

能源安全，科技自强，内需消费，对外出口，地产托底都是重要的经济议题，而政策节奏上的轻重缓急对 A 股结构有很大影响，今年或以科技为主线。人工智能技术是显著改善人类生产力的革命性工具，和互联网变革相比只强不弱。今年这种工具的普及大幅加速，是人工智能飞入寻常百姓家的元年。站在 3 年的维度，持续看好人工智能板块，我们或将逐步看到整个行业从主题投资慢慢过度到有业绩支撑的成长股投资。

整体来看，A 股权益市场估值或已调整至历史低位区域，2022 年以来的负面因素（新冠疫情、美债利率、俄乌冲突、地产下行）已基本定价，所以当下非常看好 2023 年下半年、2024 年权益市场表现，结构上继续维持 2022 年 6 月以来看好小市值的判断。小市值的主要风险可能在于加速退市政策的落地，但目前未观察到相关进展。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

可参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

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

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在西部利得量化优选一年持有期混合型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

#### 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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

#### 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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《西部利得量化优选一年持有期混合型证券投资基金 2023 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：西部利得量化优选一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
银行存款	6.4.7.1	31,101,260.35	58,664,444.85
结算备付金		5,772,311.23	6,189,684.03
存出保证金		1,342,324.15	1,937,332.35
交易性金融资产	6.4.7.2	479,400,096.69	475,595,078.45
其中: 股票投资		479,400,096.69	475,595,078.45
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中: 债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		1,598,808.24	-
应收股利		-	-
应收申购款		8,174.35	17,654.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		519,222,975.01	542,404,194.58
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	8,350,269.21
应付赎回款		1,565,998.34	665,823.95
应付管理人报酬		627,050.64	690,994.12
应付托管费		83,606.75	92,132.56
应付销售服务费		35,395.40	37,586.89
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	849,782.73	1,320,359.89
负债合计		3,161,833.86	11,157,166.62
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	526,254,047.44	602,477,918.39
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-10,192,906.29	-71,230,890.43
净资产合计		516,061,141.15	531,247,027.96
负债和净资产总计		519,222,975.01	542,404,194.58

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，西部利得量化优选一年持有期混合 A 基金份额净值为 0.9827 元，基金份额总额为 413,252,735.28 份；西部利得量化优选一年持有期混合 C 基金份额净值为 0.9730 元，基金份额总额为 113,001,312.16 份。西部利得量化优选一年持有期混合基金总份额为 526,254,047.44 份。

## 6.2 利润表

会计主体：西部利得量化优选一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		61,943,319.75	-155,297,567.60
1. 利息收入		201,500.50	324,135.85
其中：存款利息收入	6.4.7.13	201,500.50	324,135.85
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		31,292,113.89	-244,255,501.88
其中：股票投资收益	6.4.7.14	26,804,736.77	-246,583,525.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	257,964.37	-1,905,611.93
股利收益	6.4.7.19	4,229,412.75	4,233,635.14
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）	6.4.7.20	30,449,705.36	88,633,798.43
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	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		4,804,579.93	7,020,889.80
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,956,476.40	5,840,767.78
2. 托管费	6.4.10.2.2	527,530.11	778,769.06
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	225,027.23	310,604.99
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		1,326.64	-
8. 其他费用	6.4.7.23	94,219.55	90,747.97
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		57,138,739.82	-162,318,457.40
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		57,138,739.82	-162,318,457.40
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		57,138,739.82	-162,318,457.40

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：西部利得量化优选一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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（基金净值）	602,477,918.39	-	-71,230,890.43	531,247,027.96
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产(基金净值)	602,477,918.39	-	-71,230,890.43	531,247,027.96
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-76,223,870.95	-	61,037,984.14	-15,185,886.81
(一)、综合收益总额	-	-	57,138,739.82	57,138,739.82
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-76,223,870.95	-	3,899,244.32	-72,324,626.63
其中：1. 基金申购款	6,612,290.89	-	-308,481.94	6,303,808.95
2. 基金赎回款	-82,836,161.84	-	4,207,726.26	-78,628,435.58
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	526,254,047.44	-	-10,192,906.29	516,061,141.15
项目	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022年6月30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(基金净值)	958,670,371.56	-	173,959,163.77	1,132,629,535.33
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	958,670,371.56	-	173,959,163.77	1,132,629,535.33
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-200,121,376.60	-	-167,270,443.24	-367,391,819.84



（一）、综合收益总额	-	-	-162,318,457.40	-162,318,457.40
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-200,121,376.60	-	-4,951,985.84	-205,073,362.44
其中：1. 基金申购款	30,690,465.15	-	20,710.36	30,711,175.51
2. 基金赎回款	-230,811,841.75	-	-4,972,696.20	-235,784,537.95
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	758,548,994.96	-	6,688,720.53	765,237,715.49

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

贺燕萍

贺燕萍

张皞骏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

西部利得量化优选一年持有期混合型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[2020]3017号《关于准予西部利得量化优选一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》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《西部利得量化优选一年持有期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402,595,060.25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2100001号验资报告予以验证。经

向中国证监会备案,《西部利得量化优选一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 1 月 19 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 402,667,413.30 份基金份额,其中认购资金利息折合 72,353.05 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,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《西部利得量化优选一年持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为国内依法发行上市的股票(包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、债券(包括国债、地方政府债券、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的二级资本债、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)及其他经中国证监会允许投资的债券或票据)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货、股票期权、国债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)。本基金还可根据法律法规参与融资。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。

基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的 60%-95%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权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。若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许,本基金管理人在履行适当程序后,可对上述资产配置比例进行调整。

本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率\*75%+中债综合全价(总值)指数收益率\*25%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》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和《资产管理产品相关会计处理规定》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要求,真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况、2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6

月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金本报告期未发生重大会计政策和会计估计变更。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期末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

根据财政部、国家税务总局财税[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《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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》、《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》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 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《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局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》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) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改

为缴纳增值税。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018 年 1 月 1 日(含)以后，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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入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。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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%计入个人所得税应纳税所得额。对基金从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，由挂牌公司代扣代缴 20%的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按 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。

(e) 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。

(f) 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。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日(含)以后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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2023 年 6 月 30 日
活期存款	31,101,260.35
等于：本金	31,093,056.28
加：应计利息	8,204.07
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	31,101,260.35

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			
	2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	479,116,306.92	-	479,400,096.69	283,789.77
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	479,116,306.92	-	479,400,096.69	283,789.77

### 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 2023 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	8,457,450.91	-	-	
其中：股指期货投资	8,457,450.91	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	8,457,450.91	-	-	

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
IC2307	IC2307	7.00	8,387,120.00	-70,330.91
合计				-70,330.91
减：可抵销期货暂收款				-70,330.91
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**

本基金本报告期末未持有债权投资。

**6.4.7.6 其他债权投资****6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

**6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

**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 2023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	755,563.18
其中：交易所市场	755,563.18
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	94,219.55
合计	849,782.73

**6.4.7.10 实收基金**

金额单位：人民币元

## 西部利得量化优选一年持有期混合 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	477,328,446.16	477,328,446.16
本期申购	6,186,659.17	6,186,659.17
本期赎回 (以“-”号填列)	-70,262,370.05	-70,262,370.05
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	413,252,735.28	413,252,735.28

## 西部利得量化优选一年持有期混合 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	125,149,472.23	125,149,472.23
本期申购	425,631.72	425,631.72
本期赎回 (以“-”号填列)	-12,573,791.79	-12,573,791.79
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	113,001,312.16	113,001,312.16

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

## 6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 西部利得量化优选一年持有期混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-61,355,618.10	5,611,605.78	-55,744,012.32
本期利润	21,129,389.59	24,277,986.72	45,407,376.31
本期基金份额交易产生的变动数	7,480,439.98	-4,289,344.92	3,191,095.06
其中：基金申购款	-659,191.85	375,925.63	-283,266.22
基金赎回款	8,139,631.83	-4,665,270.55	3,474,361.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-32,745,788.53	25,600,247.58	-7,145,540.95

## 西部利得量化优选一年持有期混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------



上年度末	-17,002,375.89	1,515,497.78	-15,486,878.11
本期利润	5,559,644.87	6,171,718.64	11,731,363.51
本期基金份额交易产生的变动数	1,400,240.86	-692,091.60	708,149.26
其中：基金申购款	-46,985.85	21,770.13	-25,215.72
基金赎回款	1,447,226.71	-713,861.73	733,364.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-10,042,490.16	6,995,124.82	-3,047,365.34

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	182,170.06
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	15,841.37
其他	3,489.07
合计	201,500.50

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	26,804,736.77
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	26,804,736.77

##### 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
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	1,388,881,333.95
减：卖出股票成本总额	1,358,605,061.35
减：交易费用	3,471,535.83
买卖股票差价收入	26,804,736.77

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无股票出借差价收入。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益。

##### 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

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 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投资收益。

##### 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投资收益。

#### 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

本基金在本报告期内未持有权证。

## 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	本期收益金额 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	257,964.37

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,229,412.75
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	4,229,412.75

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	30,069,476.27
股票投资	30,069,476.27
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	380,229.09
权证投资	-
期货投资	380,229.09
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	30,449,705.36

## 6.4.7.21 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

## 6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期未产生信用减值损失。

## 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	34,712.18

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	94,219.55

#### 6.4.7.24 分部报告

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
西部利得基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构
中国光大银行股份有限公司	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回购交易。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金于本报告期内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未有应支付关联方的佣金。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,956,476.40	5,840,767.78
其中：支付销售机构的客户维护费	1,481,543.94	2,150,086.10

注：支付基金管理人西部利得基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	527,530.11	778,769.06

注：支付基金托管人中国光大银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

##### 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		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	西部利得量化优选一年持有期混合 A	西部利得量化优选一年持有期混合 C	合计
光大银行	-	192,791.07	192,791.07
西部利得基金	-	501.72	501.72
西部证券	-	874.89	874.89
合计	-	194,167.68	194,167.68
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		

名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	西部利得量化优选一年持有期混合 A	西部利得量化优选一年持有期混合 C	合计
光大银行	-	275,112.06	275,112.06
西部利得基金	-	441.56	441.56
西部证券	-	1,184.79	1,184.79
合计	-	276,738.41	276,738.41

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 0.4% 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，再由西部利得基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.4% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

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

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本基金于本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	31,101,260.35	182,170.06	80,383,321.46	285,012.68

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人中国光大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“中国光大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 2023 年 06 月 30 日的相关余额为人民币 1,215,390.67 元。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023年5月15日	6个月	锁定期	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	锁定期	11.88	21.02	828	9,836.64	17,404.56	-
001324	长青科技	2023年5月12日	6个月	锁定期	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023年3月29日	6个月	锁定期	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	锁定期	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药	2023年3月30日	6个月	锁定期	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-

	业	日								
001380	华纬科技	2023年5月9日	6个月	锁定期	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
300804	广康生化	2023年6月15日	6个月	锁定期	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	锁定期	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月	锁定期	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	锁定期	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	25.82	25.82	3,060	79,009.20	79,009.20	-
301203	国泰环保	2023年3月28日	6个月	锁定期	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	锁定期	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-
301225	恒勃股份	2023年6月8日	6个月	锁定期	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301246	宏源药业	2023年3月10日	6个月	锁定期	50.00	30.71	645	32,250.00	19,807.95	-
301261	恒工精	2023年6月29日	1个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,973	72,803.70	72,803.70	-



	密	日								
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	锁定期	44.18	25.10	241	10,647.38	6,049.10	-
301281	科源制药	2023年05月26日	6个月	锁定期	0.00	25.10	96	0.00	2,409.60	锁定期内送股
301292	海科新源	2023年6月29日	1个月内(含)	新股未上市	19.99	19.99	5,824	116,421.76	116,421.76	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	锁定期	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301295	美硕科技	2023年6月19日	6个月	锁定期	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月以上	新股未上市	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
301303	真兰仪表	2023年2月13日	6个月	锁定期	26.80	22.32	984	26,371.20	21,962.88	-
301305	朗坤环境	2023年5月15日	6个月	锁定期	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	锁定期	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301317	鑫磊股份	2023年1月12日	6个月	锁定期	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301322	绿通科	2023年2月27日	6个月	锁定期	131.11	53.24	184	24,124.24	9,796.16	-

	技	日								
301322	绿 通 科 技	2023 年 05 月 25 日	6 个月	锁定期	0.00	53.24	92	0.00	4,898.08	锁定期内 送股
301323	新 莱 福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	锁定期	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301332	德 尔 玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	锁定期	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚 华 电 子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	锁定期	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛 涛 车 业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	锁定期	73.45	46.64	209	15,351.05	9,747.76	-
301355	南 王 科 技	2023 年 6 月 2 日	6 个月	锁定期	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北 方 长 龙	2023 年 4 月 11 日	6 个月	锁定期	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301358	湖 南 裕 能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	锁定期	23.77	42.89	672	15,973.44	28,822.08	-
301373	凌 玮 科 技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	锁定期	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致 欧 科 技	2023 年 6 月 14 日	6 个月	锁定期	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301386	未 来 电	2023 年 3 月 21	6 个月	锁定期	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-

	器	日									
301395	仁信新材	2023年6月21日	1个月内(含)	新股未上市	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-	
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	锁定期	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-	
301399	英特科技	2023年5月16日	6个月	锁定期	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-	
301408	华人健康	2023年2月22日	6个月	锁定期	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-	
301419	阿莱德	2023年2月2日	6个月	锁定期	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-	
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	锁定期	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-	
301429	森泰股份	2023年4月10日	6个月	锁定期	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-	
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	锁定期	19.99	16.90	804	16,071.96	13,587.60	-	
301486	致尚科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	57.66	57.66	3,769	217,320.54	217,320.54	-	
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	1个月内(含)	新股未上市	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-	
301488	豪恩汽	2023年6月26日	6个月	锁定期	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-	

	电	日									
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	锁定期	10.36	11.84	655	6,785.80	7,755.20	-	
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	锁定期	11.66	12.26	550	6,413.00	6,743.00	-	
603135	中重科技	2023年3月29日	6个月	锁定期	17.80	17.89	584	10,395.20	10,447.76	-	
603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月	锁定期	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-	
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	锁定期	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-	
688146	中船特气	2023年4月13日	6个月	锁定期	36.15	38.13	549	19,846.35	20,933.37	-	
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	锁定期	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-	
688352	颀中科技	2023年4月11日	6个月	锁定期	12.10	12.07	1,578	19,093.80	19,046.46	-	
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	锁定期	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-	
688458	美芯晟	2023年5月15日	6个月	锁定期	75.00	90.76	214	16,050.00	19,422.64	-	
688469	中芯集	2023年4月28日	6个月	锁定期	5.69	5.41	6,231	35,454.39	33,709.71	-	

	成	日								
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	锁定期	11.10	17.04	2,275	25,252.50	38,766.00	-
688478	晶升股份	2023年4月13日	6个月	锁定期	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688479	友车科技	2023年5月4日	6个月	锁定期	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688507	索辰科技	2023年4月10日	6个月	锁定期	245.56	122.11	92	22,591.52	11,234.12	-
688507	索辰科技	2023年06月20日	6个月	锁定期	0.00	122.11	44	0.00	5,372.84	锁定期内送股
688512	慧智微	2023年5月8日	6个月	锁定期	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
688515	裕太微	2023年2月1日	6个月	锁定期	92.00	162.75	3,645	335,340.00	593,223.75	-
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	锁定期	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	锁定期	43.67	53.05	376	16,419.92	19,946.80	-
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	锁定期	21.17	23.50	751	15,898.67	17,648.50	-
688562	航天软	2023年5月15日	6个月	锁定期	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-

	件	日								
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	锁定期	125.80	118.03	139	17,486.20	16,406.17	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	锁定期	26.74	40.68	600	16,044.00	24,408.00	-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	锁定期	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688603	天承科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	55.00	55.00	1,391	76,505.00	76,505.00	-
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	锁定期	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	锁定期	125.88	86.79	143	18,000.84	12,410.97	-
688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月	锁定期	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	锁定期	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

#### 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暂时停牌股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无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。

#### 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。

##### 6.4.13.3 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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、存出保证金和结算备付金等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	31,101,260.35	-	-	-	31,101,260.35
结算备付金	5,772,311.23	-	-	-	5,772,311.23
存出保证金	1,342,324.15	-	-	-	1,342,324.15
交易性金融资产	-	-	-	-479,400,096.69	479,400,096.69
应收申购款	-	-	-	8,174.35	8,174.35
应收清算款	-	-	-	1,598,808.24	1,598,808.24
<b>资产总计</b>	<b>38,215,895.73</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-481,007,079.28</b>	<b>519,222,975.01</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	1,565,998.34	1,565,998.34
应付管理人报酬	-	-	-	627,050.64	627,050.64
应付托管费	-	-	-	83,606.75	83,606.75
应付销售服务费	-	-	-	35,395.40	35,395.40
其他负债	-	-	-	849,782.73	849,782.73
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>3,161,833.86</b>	<b>3,161,833.86</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>38,215,895.73</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-477,845,245.42</b>	<b>516,061,141.15</b>
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	58,664,444.85	-	-	-	58,664,444.85
结算备付金	6,189,684.03	-	-	-	6,189,684.03
存出保证金	1,937,332.35	-	-	-	1,937,332.35
交易性金融资产	-	-	-	-475,595,078.45	475,595,078.45
应收申购款	-	-	-	17,654.90	17,654.90
<b>资产总计</b>	<b>66,791,461.23</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-475,612,733.35</b>	<b>542,404,194.58</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	665,823.95	665,823.95
应付管理人报酬	-	-	-	690,994.12	690,994.12
应付托管费	-	-	-	92,132.56	92,132.56
应付清算款	-	-	-	8,350,269.21	8,350,269.21
应付销售服务费	-	-	-	37,586.89	37,586.89
其他负债	-	-	-	1,320,359.89	1,320,359.89
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>11,157,166.62</b>	<b>11,157,166.62</b>

利率敏感度缺口	66,791,461.23	-	-464,455,566.73	531,247,027.96
---------	---------------	---	-----------------	----------------

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 6 月 30 日，本基金主要投资于权益类金融工具，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响（2022 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

##### 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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	479,400,096.69	92.90	475,595,078.45	89.52
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	479,400,096.69	92.90	475,595,078.45	89.52

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	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	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%的影响金额		35,745,000.00
业绩比较基准下降 5%的影响金额		-35,745,000.00	-37,474,000.00

#### 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	477,123,139.45	473,326,415.92
第二层次	804,833.52	-
第三层次	1,472,123.72	2,268,662.53
合计	479,400,096.69	475,595,078.45

###### 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 2023 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（2022 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应收款项、买入返售金融资产、卖出回购金融资产

款和其他金融负债，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 2023 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	479,400,096.69	92.33
	其中：股票	479,400,096.69	92.33
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	36,873,571.58	7.10
8	其他各项资产	2,949,306.74	0.57
9	合计	519,222,975.01	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	1,512,830.00	0.29
B	采矿业	2,103,739.00	0.41
C	制造业	377,949,273.78	73.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,453,645.00	1.25
E	建筑业	8,861,161.01	1.72
F	批发和零售业	21,275,228.21	4.12
G	交通运输、仓储和邮政业	10,418,184.00	2.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,299,709.38	2.38
J	金融业	1,019,754.00	0.20
K	房地产业	2,777,243.00	0.54

L	租赁和商务服务业	9,638,524.50	1.87
M	科学研究和技术服务业	13,893,527.98	2.69
N	水利、环境和公共设施管理业	7,060,141.97	1.37
O	居民服务、修理和其他服务业	620,471.00	0.12
P	教育	530,865.00	0.10
Q	卫生和社会工作	2,985,798.86	0.58
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	479,400,096.69	92.90

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 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	001269	欧晶科技	86,980	6,395,639.40	1.24
2	300532	今天国际	289,800	5,958,288.00	1.15
3	603129	春风动力	36,800	5,957,920.00	1.15
4	688630	芯碁微装	65,723	5,522,046.46	1.07
5	605266	健之佳	65,800	5,516,014.00	1.07
6	605167	利柏特	545,500	5,280,440.00	1.02
7	300389	艾比森	257,500	5,245,275.00	1.02
8	300314	戴维医疗	246,900	5,219,466.00	1.01
9	300855	图南股份	147,680	5,216,057.60	1.01
10	688569	铁科轨道	122,177	5,139,986.39	1.00
11	002011	盾安环境	370,400	5,122,632.00	0.99
12	300856	科思股份	62,400	4,915,248.00	0.95
13	601333	广深铁路	1,207,400	4,781,304.00	0.93
14	300129	泰胜风能	497,600	4,771,984.00	0.92
15	688120	华海清科	18,930	4,771,306.50	0.92
16	603156	养元饮品	192,600	4,757,220.00	0.92
17	603100	川仪股份	122,000	4,740,920.00	0.92
18	002851	麦格米特	129,800	4,733,806.00	0.92
19	002600	领益智造	678,100	4,685,671.00	0.91
20	600481	双良节能	333,700	4,665,126.00	0.90
21	601702	华峰铝业	339,400	4,642,992.00	0.90
22	603040	新坐标	174,600	4,642,614.00	0.90
23	603508	思维列控	271,500	4,629,075.00	0.90
24	002478	常宝股份	618,800	4,610,060.00	0.89
25	600612	老凤祥	65,800	4,598,104.00	0.89
26	300360	炬华科技	255,800	4,573,704.00	0.89
27	601890	亚星锚链	394,300	4,565,994.00	0.88

28	002345	潮宏基	579,200	4,552,512.00	0.88
29	002956	西麦食品	290,000	4,532,700.00	0.88
30	301039	中集车辆	342,500	4,531,275.00	0.88
31	300756	金马游乐	235,400	4,500,848.00	0.87
32	600537	亿晶光电	581,400	4,441,896.00	0.86
33	300674	宇信科技	250,800	4,434,144.00	0.86
34	688186	广大特材	136,184	4,430,065.52	0.86
35	002154	报喜鸟	800,100	4,416,552.00	0.86
36	605009	豪悦护理	91,998	4,415,904.00	0.86
37	600211	西藏药业	73,700	4,377,780.00	0.85
38	300058	蓝色光标	450,400	4,355,368.00	0.84
39	002223	鱼跃医疗	120,300	4,329,597.00	0.84
40	300811	铂科新材	72,540	4,311,777.60	0.84
41	002568	百润股份	118,500	4,307,475.00	0.83
42	600329	达仁堂	95,300	4,278,017.00	0.83
43	000888	峨眉山 A	372,300	4,266,558.00	0.83
44	688551	科威尔	64,807	4,250,043.06	0.82
45	300232	洲明科技	463,600	4,237,304.00	0.82
46	600642	申能股份	605,900	4,235,241.00	0.82
47	603757	大元泵业	141,300	4,216,392.00	0.82
48	603551	奥普家居	325,400	4,207,422.00	0.82
49	600197	伊力特	154,700	4,203,199.00	0.81
50	002603	以岭药业	162,979	4,186,930.51	0.81
51	688029	南微医学	51,270	4,181,581.20	0.81
52	600419	天润乳业	257,530	4,177,136.60	0.81
53	688626	翔宇医疗	91,569	4,167,305.19	0.81
54	603567	珍宝岛	276,900	4,142,424.00	0.80
55	603027	千禾味业	195,916	4,137,745.92	0.80
56	600929	雪天盐业	520,100	4,129,594.00	0.80
57	300842	帝科股份	45,000	4,114,800.00	0.80
58	002852	道道全	313,600	4,054,848.00	0.79
59	300622	博士眼镜	171,700	4,052,120.00	0.79
60	300396	迪瑞医疗	123,300	4,006,017.00	0.78
61	002275	桂林三金	221,300	3,985,613.00	0.77
62	002959	小熊电器	47,600	3,974,600.00	0.77
63	003000	劲仔食品	315,300	3,969,627.00	0.77
64	688019	安集科技	23,892	3,938,118.36	0.76
65	300795	米奥会展	93,850	3,914,483.50	0.76
66	688621	阳光诺和	63,825	3,754,186.50	0.73
67	301087	可孚医疗	74,240	3,660,032.00	0.71
68	301257	普蕊斯	55,700	3,130,340.00	0.61
69	301239	普瑞眼科	30,200	2,962,016.00	0.57
70	002991	甘源食品	31,700	2,431,390.00	0.47

71	600436	片仔癀	8,000	2,290,880.00	0.44
72	603657	春光科技	106,200	1,863,810.00	0.36
73	603536	惠发食品	287,900	1,854,076.00	0.36
74	603499	翔港科技	192,300	1,834,542.00	0.36
75	603608	天创时尚	388,600	1,803,104.00	0.35
76	603637	镇海股份	215,600	1,778,700.00	0.34
77	603580	艾艾精工	122,900	1,748,867.00	0.34
78	603488	展鹏科技	212,000	1,702,360.00	0.33
79	603286	日盈电子	82,100	1,621,475.00	0.31
80	603332	苏州龙杰	146,700	1,603,431.00	0.31
81	603616	韩建河山	306,800	1,595,360.00	0.31
82	603696	安记食品	166,800	1,574,592.00	0.31
83	603615	茶花股份	162,700	1,535,888.00	0.30
84	603320	迪贝电气	105,600	1,535,424.00	0.30
85	603238	诺邦股份	115,700	1,458,977.00	0.28
86	603321	梅轮电梯	184,300	1,435,697.00	0.28
87	603316	诚邦股份	230,600	1,415,884.00	0.27
88	603389	亚振家居	266,100	1,415,652.00	0.27
89	301004	嘉益股份	35,600	1,381,280.00	0.27
90	603221	爱丽家居	171,400	1,331,778.00	0.26
91	603042	华脉科技	51,600	1,298,256.00	0.25
92	603506	南都物业	107,300	1,269,359.00	0.25
93	603356	华菱精工	89,500	1,261,950.00	0.24
94	603226	菲林格尔	237,700	1,212,270.00	0.23
95	600066	宇通客车	78,300	1,154,142.00	0.22
96	001965	招商公路	111,900	1,074,240.00	0.21
97	002459	晶澳科技	25,400	1,059,180.00	0.21
98	600697	欧亚集团	83,500	1,027,885.00	0.20
99	601939	建设银行	162,900	1,019,754.00	0.20
100	003012	东鹏控股	123,800	1,001,542.00	0.19
101	688488	艾迪药业	81,055	998,597.60	0.19
102	000858	五粮液	6,000	981,420.00	0.19
103	600998	九州通	92,380	958,904.40	0.19
104	601766	中国中车	147,000	955,500.00	0.19
105	688676	金盘科技	31,400	951,106.00	0.18
106	603725	天安新材	114,400	930,072.00	0.18
107	605258	协和电子	35,500	922,290.00	0.18
108	603709	中源家居	49,600	899,744.00	0.17
109	600583	海油工程	152,700	893,295.00	0.17
110	603883	老百姓	29,400	877,590.00	0.17
111	000913	钱江摩托	48,000	875,040.00	0.17
112	603301	振德医疗	28,600	847,132.00	0.16
113	603188	亚邦股份	240,900	838,332.00	0.16

114	603729	龙韵股份	55,700	831,601.00	0.16
115	605255	天普股份	50,900	804,220.00	0.16
116	301070	开勒股份	21,200	792,880.00	0.15
117	603726	朗迪集团	59,700	755,802.00	0.15
118	002806	华锋股份	56,800	727,040.00	0.14
119	603178	圣龙股份	57,900	713,328.00	0.14
120	300836	佰奥智能	23,700	708,156.00	0.14
121	603879	永悦科技	101,800	690,204.00	0.13
122	301079	邵阳液压	32,370	690,128.40	0.13
123	605178	时空科技	30,600	687,888.00	0.13
124	603716	塞力医疗	72,700	685,561.00	0.13
125	301043	绿岛风	21,300	680,961.00	0.13
126	603090	宏盛股份	30,300	674,175.00	0.13
127	600137	浪莎股份	35,000	671,300.00	0.13
128	600593	大连圣亚	40,700	666,666.00	0.13
129	002893	京能热力	61,200	659,124.00	0.13
130	300743	天地数码	41,900	658,668.00	0.13
131	300807	天迈科技	22,500	658,125.00	0.13
132	001209	洪兴股份	36,900	657,189.00	0.13
133	002921	联诚精密	36,300	653,763.00	0.13
134	001234	泰慕士	28,600	652,080.00	0.13
135	300823	建科机械	31,600	649,380.00	0.13
136	605300	佳禾食品	29,800	647,852.00	0.13
137	301131	聚赛龙	16,000	642,880.00	0.12
138	603958	哈森股份	82,900	635,843.00	0.12
139	002862	实丰文化	33,700	634,908.00	0.12
140	600148	长春一东	38,000	634,600.00	0.12
141	603813	原尚股份	43,900	633,477.00	0.12
142	300749	顶固集创	68,900	633,191.00	0.12
143	000638	万方发展	104,700	631,341.00	0.12
144	002494	华斯股份	136,300	631,069.00	0.12
145	002682	龙洲股份	154,300	629,544.00	0.12
146	605298	必得科技	39,400	628,824.00	0.12
147	603717	天域生态	92,600	628,754.00	0.12
148	301053	远信工业	24,700	626,639.00	0.12
149	301056	森赫股份	68,314	625,756.24	0.12
150	002820	桂发祥	55,100	624,834.00	0.12
151	300462	华铭智能	53,200	624,568.00	0.12
152	300621	维业股份	62,200	622,622.00	0.12
153	300851	交大思诺	23,100	622,314.00	0.12
154	002828	贝肯能源	75,700	622,254.00	0.12
155	300736	百邦科技	50,900	620,471.00	0.12
156	301007	德迈仕	40,200	620,286.00	0.12



157	000679	大连友谊	125,000	616,250.00	0.12
158	003017	大洋生物	18,300	615,795.00	0.12
159	603036	如通股份	58,100	614,698.00	0.12
160	002492	恒基达鑫	106,500	612,375.00	0.12
161	002780	三夫户外	45,000	612,000.00	0.12
162	600778	友好集团	90,000	612,000.00	0.12
163	301182	凯旺科技	26,600	611,002.00	0.12
164	603038	华立股份	69,100	608,080.00	0.12
165	002199	东晶电子	71,100	605,061.00	0.12
166	000955	欣龙控股	140,300	604,693.00	0.12
167	600538	国发股份	142,900	603,038.00	0.12
168	300717	华信新材	35,200	600,160.00	0.12
169	002899	英派斯	40,000	598,800.00	0.12
170	300665	飞鹿股份	68,800	597,872.00	0.12
171	300030	阳普医疗	79,800	596,106.00	0.12
172	002931	锋龙股份	45,500	593,775.00	0.12
173	688515	裕太微	3,645	593,223.75	0.11
174	002890	弘宇股份	39,900	589,323.00	0.11
175	002207	准油股份	89,800	588,190.00	0.11
176	301098	金埔园林	48,750	587,437.50	0.11
177	603059	倍加洁	25,800	586,692.00	0.11
178	600721	百花医药	88,000	586,080.00	0.11
179	600250	南纺股份	94,300	585,603.00	0.11
180	603159	上海亚虹	39,700	583,987.00	0.11
181	600689	上海三毛	62,300	582,505.00	0.11
182	301167	建研设计	32,760	579,852.00	0.11
183	300611	美力科技	59,700	575,508.00	0.11
184	300074	华平股份	133,500	575,385.00	0.11
185	603329	上海雅仕	43,400	575,050.00	0.11
186	603926	铁流股份	56,100	573,903.00	0.11
187	301259	艾布鲁	42,470	571,221.50	0.11
188	002357	富临运业	85,000	571,200.00	0.11
189	301113	雅艺科技	19,800	570,438.00	0.11
190	301042	安联锐视	16,800	570,360.00	0.11
191	605003	众望布艺	29,600	569,208.00	0.11
192	300535	达威股份	38,900	566,384.00	0.11
193	001296	长江材料	26,900	565,169.00	0.11
194	002691	冀凯股份	90,400	565,000.00	0.11
195	603928	兴业股份	46,800	564,876.00	0.11
196	603041	美思德	46,900	563,738.00	0.11
197	600243	青海华鼎	127,200	563,496.00	0.11
198	600099	林海股份	60,100	562,536.00	0.11
199	600630	龙头股份	98,100	561,132.00	0.11

200	603045	福达合金	37,000	560,180.00	0.11
201	300243	瑞丰高材	63,600	559,680.00	0.11
202	300126	锐奇股份	86,200	559,438.00	0.11
203	603037	凯众股份	40,820	558,009.40	0.11
204	603828	柯利达	187,250	558,005.00	0.11
205	301037	保立佳	31,300	557,766.00	0.11
206	600202	哈空调	99,700	557,323.00	0.11
207	002811	郑中设计	70,100	555,893.00	0.11
208	605155	西大门	38,200	554,282.00	0.11
209	300562	乐心医疗	56,200	550,760.00	0.11
210	600444	国机通用	40,100	550,573.00	0.11
211	002883	中设股份	46,500	548,235.00	0.11
212	600753	东方银星	59,800	547,768.00	0.11
213	002826	易明医药	49,600	546,096.00	0.11
214	000605	渤海股份	86,400	546,048.00	0.11
215	002105	信隆健康	91,700	545,615.00	0.11
216	603022	新通联	57,600	542,016.00	0.11
217	002998	优彩资源	76,300	541,730.00	0.10
218	300321	同大股份	33,200	540,164.00	0.10
219	002767	先锋电子	38,600	539,242.00	0.10
220	300281	金明精机	100,400	538,144.00	0.10
221	301237	和顺科技	18,100	537,389.00	0.10
222	001211	双枪科技	24,500	537,285.00	0.10
223	000590	启迪药业	61,600	537,152.00	0.10
224	600539	狮头股份	80,400	537,072.00	0.10
225	603080	新疆火炬	37,800	536,382.00	0.10
226	001202	炬申股份	36,300	535,788.00	0.10
227	300640	德艺文创	89,100	535,491.00	0.10
228	600883	博闻科技	70,400	534,336.00	0.10
229	600356	恒丰纸业	68,200	534,006.00	0.10
230	605303	园林股份	48,100	533,910.00	0.10
231	002205	国统股份	50,400	533,736.00	0.10
232	002144	宏达高科	47,600	532,644.00	0.10
233	300854	中兰环保	33,441	531,711.90	0.10
234	300658	延江股份	81,120	531,336.00	0.10
235	600455	博通股份	23,500	530,865.00	0.10
236	603023	威帝股份	130,100	530,808.00	0.10
237	002718	友邦吊顶	34,800	527,568.00	0.10
238	301081	严牌股份	52,920	526,554.00	0.10
239	600768	宁波富邦	48,500	526,225.00	0.10
240	003003	天元股份	49,700	525,826.00	0.10
241	000856	冀东装备	60,500	525,140.00	0.10
242	600128	弘业股份	63,800	524,436.00	0.10

243	600791	京能置业	114,100	523,719.00	0.10
244	605180	华生科技	42,250	522,632.50	0.10
245	301055	张小泉	36,700	522,241.00	0.10
246	603089	正裕工业	58,600	520,954.00	0.10
247	600493	凤竹纺织	92,800	519,680.00	0.10
248	603150	万朗磁塑	19,700	519,292.00	0.10
249	600235	民丰特纸	95,800	519,236.00	0.10
250	605318	法狮龙	37,400	518,364.00	0.10
251	301065	本立科技	25,050	518,284.50	0.10
252	600615	丰华股份	59,000	517,430.00	0.10
253	002778	中晟高科	35,600	516,912.00	0.10
254	603079	圣达生物	40,300	516,243.00	0.10
255	003041	真爱美家	32,520	515,767.20	0.10
256	600272	开开实业	57,000	514,710.00	0.10
257	300329	海伦钢琴	72,500	512,575.00	0.10
258	002861	瀛通通讯	44,800	512,512.00	0.10
259	600712	南宁百货	138,100	512,351.00	0.10
260	600506	香梨股份	48,700	511,837.00	0.10
261	300819	聚杰微纤	37,300	511,383.00	0.10
262	600051	宁波联合	70,200	511,056.00	0.10
263	000929	兰州黄河	52,200	510,516.00	0.10
264	002802	洪汇新材	46,150	510,419.00	0.10
265	600355	精伦电子	147,400	510,004.00	0.10
266	300106	西部牧业	63,500	509,905.00	0.10
267	002836	新宏泽	62,520	509,538.00	0.10
268	603161	科华控股	34,900	508,493.00	0.10
269	600232	金鹰股份	93,100	508,326.00	0.10
270	600793	宜宾纸业	41,300	507,577.00	0.10
271	600561	江西长运	96,300	507,501.00	0.10
272	000702	正虹科技	92,500	506,900.00	0.10
273	603900	莱绅通灵	80,500	505,540.00	0.10
274	002209	达意隆	49,200	504,300.00	0.10
275	605081	太和水	33,700	501,793.00	0.10
276	002963	豪尔赛	34,400	500,520.00	0.10
277	605069	正和生态	57,100	499,625.00	0.10
278	600448	华纺股份	168,000	498,960.00	0.10
279	002830	名雕股份	38,900	498,309.00	0.10
280	600082	海泰发展	158,100	498,015.00	0.10
281	600119	长江投资	84,500	497,705.00	0.10
282	600692	亚通股份	89,100	497,178.00	0.10
283	300703	创源股份	52,100	495,992.00	0.10
284	000985	大庆华科	30,400	492,480.00	0.10
285	600678	四川金顶	92,200	492,348.00	0.10

286	603838	四通股份	87,400	492,062.00	0.10
287	600857	宁波中百	49,700	492,030.00	0.10
288	002696	百洋股份	78,700	491,088.00	0.10
289	000632	三木集团	116,000	490,680.00	0.10
290	600083	博信股份	69,100	489,919.00	0.09
291	000608	阳光股份	179,700	486,987.00	0.09
292	603139	康惠制药	29,700	486,486.00	0.09
293	002620	瑞和股份	93,100	484,120.00	0.09
294	002910	庄园牧场	43,900	482,900.00	0.09
295	600889	南京化纤	102,500	482,775.00	0.09
296	600281	华阳新材	117,900	477,495.00	0.09
297	600149	廊坊发展	85,000	476,850.00	0.09
298	600156	华升股份	108,200	476,080.00	0.09
299	300218	安利股份	50,300	473,826.00	0.09
300	600302	标准股份	89,800	473,246.00	0.09
301	600107	美尔雅	85,800	460,746.00	0.09
302	603021	山东华鹏	89,100	455,301.00	0.09
303	600234	科新发展	75,600	454,356.00	0.09
304	600319	亚星化学	88,000	441,760.00	0.09
305	600847	万里股份	35,200	429,792.00	0.08
306	301003	江苏博云	14,100	325,851.00	0.06
307	301486	致尚科技	3,769	217,320.54	0.04
308	002134	天津普林	19,200	196,608.00	0.04
309	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.03
310	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.02
311	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.02
312	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.02
313	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
314	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
315	301063	海锅股份	1,900	52,934.00	0.01
316	688472	阿特斯	2,275	38,766.00	0.01
317	688469	中芯集成	6,231	33,709.71	0.01
318	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.01
319	301358	湖南裕能	672	28,822.08	0.01
320	688582	芯动联科	600	24,408.00	0.00
321	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
322	301303	真兰仪表	984	21,962.88	0.00
323	688146	中船特气	549	20,933.37	0.00
324	688543	国科军工	376	19,946.80	0.00
325	301246	宏源药业	645	19,807.95	0.00
326	688458	美芯晟	214	19,422.64	0.00
327	688352	颀中科技	1,578	19,046.46	0.00
328	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00

329	688552	航天南湖	751	17,648.50	0.00
330	001287	中电港	828	17,404.56	0.00
331	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
332	688507	索辰科技	136	16,606.96	0.00
333	688581	安杰思	139	16,406.17	0.00
334	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
335	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
336	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
337	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
338	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
339	301322	绿通科技	276	14,694.24	0.00
340	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
341	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
342	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
343	301210	金杨股份	281	13,816.77	0.00
344	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
345	301439	泓淋电力	804	13,587.60	0.00
346	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
347	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
348	688623	双元科技	143	12,410.97	0.00
349	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
350	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
351	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
352	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
353	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
354	603135	中重科技	584	10,447.76	0.00
355	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
356	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
357	301345	涛涛车业	209	9,747.76	0.00
358	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
359	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
360	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
361	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
362	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
363	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
364	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
365	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
366	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
367	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
368	601065	江盐集团	655	7,755.20	0.00
369	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
370	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
371	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00

372	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
373	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
374	601133	柏诚股份	550	6,743.00	0.00
375	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
376	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
377	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
378	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
379	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
380	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
381	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
382	603172	万丰股份	122	1,967.86	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	300777	中简科技	14,069,929.00	2.65
2	688556	高测股份	13,696,515.11	2.58
3	603605	珀莱雅	13,628,336.00	2.57
4	688072	拓荆科技	12,065,465.65	2.27
5	603338	浙江鼎力	11,719,500.00	2.21
6	603027	千禾味业	11,442,789.12	2.15
7	002603	以岭药业	11,404,443.73	2.15
8	603871	嘉友国际	11,200,815.61	2.11
9	688019	安集科技	11,108,490.02	2.09
10	003000	劲仔食品	10,970,947.00	2.07
11	600066	宇通客车	10,615,356.00	2.00
12	688295	中复神鹰	9,947,461.01	1.87
13	002959	小熊电器	9,427,487.70	1.77
14	300795	米奥会展	9,303,518.50	1.75
15	300811	铂科新材	8,730,370.41	1.64
16	002937	兴瑞科技	8,341,798.00	1.57
17	300073	当升科技	8,326,937.00	1.57
18	002273	水晶光电	8,323,900.00	1.57
19	002126	银轮股份	8,318,540.00	1.57
20	300820	英杰电气	8,298,312.97	1.56

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(%)
----	------	------	----------	----------------

	码			
1	002273	水晶光电	17,898,137.02	3.37
2	601882	海天精工	16,568,278.00	3.12
3	688295	中复神鹰	15,592,262.16	2.94
4	605060	联德股份	14,236,169.00	2.68
5	688556	高测股份	13,818,796.18	2.60
6	301268	铭利达	13,532,182.24	2.55
7	300777	中简科技	13,347,607.00	2.51
8	688072	拓荆科技	13,087,797.24	2.46
9	603605	珀莱雅	12,812,470.00	2.41
10	001228	永泰运	12,642,640.00	2.38
11	002965	祥鑫科技	11,916,649.00	2.24
12	002463	沪电股份	11,491,410.00	2.16
13	603871	嘉友国际	11,326,516.28	2.13
14	002997	瑞鹄模具	11,160,155.28	2.10
15	300820	英杰电气	11,145,597.00	2.10
16	002518	科士达	10,932,934.00	2.06
17	603338	浙江鼎力	10,845,373.00	2.04
18	300607	拓斯达	10,771,436.72	2.03
19	300452	山河药辅	10,718,331.70	2.02
20	601567	三星医疗	10,631,209.00	2.00

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	1,332,340,603.32
卖出股票收入（成交）总额	1,388,881,333.95

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金报告期末未持有债券。

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

本基金报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金于本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

## 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	1,342,324.15
2	应收清算款	1,598,808.24
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,174.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,949,306.74

### 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

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 (%)
西部利得量化优选一年持有期混合 A	13,660	30,252.76	6,937,913.85	1.68	406,314,821.43	98.32
西部利得量化优选一年持有期混合 C	829	136,310.39	-	-	113,001,312.16	100.00
合计	14,414	36,509.92	6,937,913.85	1.32	519,316,133.59	98.68

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

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

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	西部利得量化优选一年持有期混合 A	6,081,671.61	1.4717
	西部利得量化优选一年持有期混合 C	40,267.70	0.0356
	合计	6,121,939.31	1.1633

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	------	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	西部利得量化优选一年持有期混合 A	50~100
	西部利得量化优选一年持有期混合 C	-
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	西部利得量化优选一年持有期混合 A	>100
	西部利得量化优选一年持有期混合 C	-
	合计	>100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	西部利得量化优选一年持有期混合 A	西部利得量化优选一年持有期混合 C
基金合同生效日 (2021 年 1 月 19 日) 基金份额总额	266,149,101.37	136,518,311.93
本报告期期初基金份额总额	477,328,446.16	125,149,472.23
本报告期基金总申购份额	6,186,659.17	425,631.72
减：本报告期基金总赎回份额	70,262,370.05	12,573,791.79
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	413,252,735.28	113,001,312.16

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

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产的诉讼事项。

本报告期内未涉及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 (%)	
五矿证券	2	554,044,081.13	20.44	405,169.56	21.73	-
江海证券	2	413,407,597.50	15.25	302,324.18	16.22	-
财通证券	2	399,000,068.76	14.72	291,795.28	15.65	-
浙商证券	2	392,511,058.53	14.48	169,295.88	9.08	-
华宝证券	2	343,198,609.15	12.66	250,980.11	13.46	-
中泰证券	1	339,220,580.43	12.51	248,059.31	13.30	-
东兴证券	2	214,025,762.38	7.90	156,517.44	8.39	-
西藏东方财富	2	55,110,501.66	2.03	40,302.56	2.16	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-

华泰证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

注：1. 基金租用席位的选择标准是：(1) 资质雄厚，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 (%)
五矿证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
世纪证	-	-	-	-	-	-

券						
银河证 券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 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民商基金销售（上海）有限公司办理相关销售业务的提示性公告	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	2023 年 4 月 6 日
2	西部利得基金管理有限公司关于即将终止浦领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	2023 年 6 月 1 日

## § 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

本报告期内，本基金未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 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

2023 年 8 月 30 日