

西部利得中证 1000 指数增强型证券投资基金
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：平安银行股份有限公司

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。

基金托管人平安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 4 月 25 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
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
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
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
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
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
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
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	16
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
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	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58

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	58
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	58
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	58
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	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	59
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
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	60
§ 9 开放式基金份额变动	61
§ 10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议	61
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	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
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	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
10.8 其他重大事件	63
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	63
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	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§ 12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	西部利得中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	西部利得中证 1000 指数增强	
基金主代码	018157	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 4 月 25 日	
基金管理人	西部利得基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,286,476,293.64 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	西部利得中证 1000 指数增强 A	西部利得中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	018157	018158
报告期末下属分级基金的份额总额	590,354,759.18 份	696,121,534.46 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型股票基金，在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。本基金力争日均跟踪误差的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8%。
投资策略	本基金以中证 1000 指数为标的指数，在控制投资组合与业绩比较基准跟踪误差的基础上，结合“自下而上”的选股方式对投资组合进行积极的管理与风险控制，力争获得超越业绩比较基准的收益。本基金可以将标的指数成份股及备选股之外的股票纳入基金股票池，并构建主动型投资组合。（详见《基金合同》）
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率*95%+活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为股票基金，理论上其预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金和货币市场基金。

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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵毅	李帅帅
	联系电话	021-38572888	0755-25878287
	电子邮箱	service@westleadfund.com	LISHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		4007-007-818	95511-3
传真		021-50710261	0755-82080387
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区耀	广东省深圳市罗湖区深南东路

	体路 276 号 901 室-908 室	5047 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	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座
邮政编码	200126	518001
法定代表人	何方	谢永林

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）-2023 年 6 月 30 日	
	西部利得中证 1000 指数增强 A	西部利得中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	1,361,739.31	1,104,344.12
本期利润	5,430,637.04	5,895,692.59
加权平均基金份额本期利润	0.0092	0.0085
本期加权平均净值利润率	0.93%	0.85%
本期基金份额净值增长率	0.92%	0.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	1,361,739.31	1,104,344.12
期末可供分配基金份额利润	0.0023	0.0016
期末基金资产净值	595,785,396.22	702,017,227.05

期末基金份额净值	1.0092	1.0085
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	0.92%	0.85%

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

西部利得中证 1000 指数增强 A

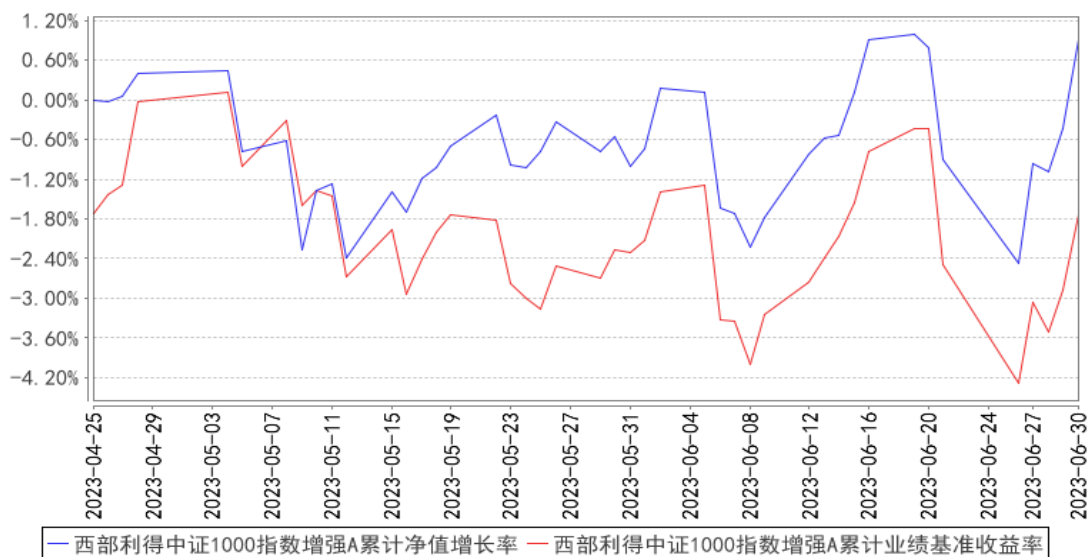
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.95%	0.93%	0.59%	0.99%	1.36%	-0.06%
自基金合同生效起至今	0.92%	0.78%	-1.73%	0.87%	2.65%	-0.09%

西部利得中证 1000 指数增强 C

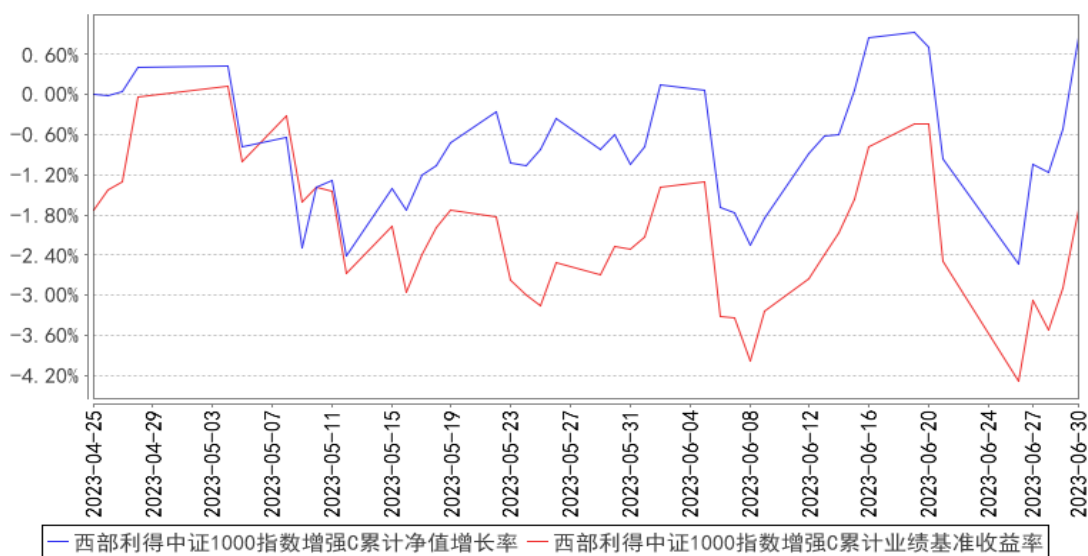
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.92%	0.93%	0.59%	0.99%	1.33%	-0.06%
自基金合同生效起至今	0.85%	0.78%	-1.73%	0.87%	2.58%	-0.09%

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

西部利得中证1000指数增强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



西部利得中证1000指数增强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



注：1. 本基金合同于 2023 年 4 月 25 日生效，截至本报告期末本基金合同生效未满一年。

2. 按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末本基金的各项投资组合比例符合本基金合同的有关约定。

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	2023 年 4 月 25 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遵规守信情况的说明

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，行业配置参考中证 1000 指数，股票持仓极为分散以此弱化个股黑天鹅的影响。本基金量化策略的特点是分域建模的基本面量化、专注于能力域、量化为舟主观为舵，投资过程中运用了 AI 工具。本基金努力通过选股获得相对于中证 1000 指数的超额收益，以期打造优质的中证 1000 指数增强基金，在接下去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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

§ 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：西部利得中证 1000 指数增强型证券投资基金

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
资产：		
银行存款	6.4.7.1	97,826,771.60
结算备付金		7,347,819.35
存出保证金		1,440,297.24
交易性金融资产	6.4.7.2	1,200,934,432.78
其中：股票投资		1,200,934,432.78
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		-
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		1,307,549,320.97
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日
负 债：		
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		6,078,301.32
应付赎回款		-
应付管理人报酬		1,260,475.55
应付托管费		210,079.27
应付销售服务费		227,293.04
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	1,970,548.52

负债合计		9,746,697.70
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	1,286,476,293.64
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	11,326,329.63
净资产合计		1,297,802,623.27
负债和净资产总计		1,307,549,320.97

注：本基金合同生效日为 2023 年 04 月 25 日，本报告期自基金合同生效日 2023 年 04 月 25 日起至 2023 年 06 月 30 日止。报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,286,476,293.64 份，其中西部利得中证 1000 指数增强 A 基金份额总额 590,354,759.18 份，基金份额净值 1.0092 元。西部利得中证 1000 指数增强 C 基金份额总额 696,121,534.46 份，基金份额净值 1.0085 元。

6.2 利润表

会计主体：西部利得中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 4 月 25 日（基金合同 生效日）至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		15,104,666.39
1. 利息收入		165,219.80
其中：存款利息收入	6.4.7.13	165,219.80
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）		6,079,200.39
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-884,596.04
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-120,029.96
股利收益	6.4.7.19	7,083,826.39
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	8,860,246.20
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	-
减：二、营业总支出		3, 778, 336. 76
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	2, 772, 389. 72
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	462, 064. 97
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	499, 971. 60
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		-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	43, 910. 47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11, 326, 329. 63
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11, 326, 329. 63
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		11, 326, 329. 63

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：西部利得中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）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）	-	-	-	-
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）	1, 286, 476, 293. 64	-	-	1, 286, 476, 293. 64
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	11, 326, 329. 63	11, 326, 329. 63
（一）、综合收益总额	-	-	11, 326, 329. 63	11, 326, 329. 63
（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)				
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(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)	1,286,476,293.64	-	11,326,329.63	1,297,802,623.27

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

西部利得中证 1000 指数增强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[2023]507 号《关于准予西部利得中证 1000 指数增强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《西部利得中证 1000 指数增强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 1,286,444,505.83 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 2300251 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《西部利得中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2023 年 4 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,286,476,293.64 份基金份额,其中认购资金利息折合 31,787.81 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,基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《西部利得中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为标的指数成份股及其备选成份股、其他国内依法发行上市的股票（包含主板、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（含超短期融资券）、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和转融通证券出借业务。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：本基金股票资产占基金资产的比例不低于 80%；投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、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。本基金的标的指数是中证 1000 指数。

本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率*95%+活期存款利率（税后）*5%。

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 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期未发生重大会计政策和会计估计变更。

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 6 月 30 日止。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务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业务模式。

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。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 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，参考类似金融工具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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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基金净值比例计算的金额。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基金净值比例计算的金额。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。

6.4.4.9 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变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且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。

6.4.4.10 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。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产款在资金实际占用期间按实际利率法逐日确认为利息支出。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《西部利得中证 1000 指数增强型证券投资基金合同》的规定。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基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。每一基金份额享有同等分配权。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。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。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，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《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上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），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

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

本基金在本报告期末发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间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	97,826,771.60
等于: 本金	97,816,318.09
加: 应计利息	10,453.51
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	97,826,771.60

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	1,192,096,346.58	-	1,200,934,432.78	8,838,086.20
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	1,192,096,346.58	-	1,200,934,432.78	8,838,086.20

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	7,867,600.00	-	-	
其中：股指期货投资	7,867,600.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	7,867,600.00	-	-	

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
IM2307	IM2307	6.00	7,889,760.00	22,160.00
合计				22,160.00
减：可抵销期货暂收款				22,160.00
净额				-

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资**6.4.7.5.1 债权投资情况**

本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末未持有债权投资。

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	1,927,038.05
其中：交易所市场	1,927,038.05
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	43,510.47
合计	1,970,548.52

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

西部利得中证 1000 指数增强 A

项目	本期 2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	590,354,759.18	590,354,759.18
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	590,354,759.18	590,354,759.18

西部利得中证 1000 指数增强 C

项目	本期 2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	696,121,534.46	696,121,534.46
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	696,121,534.46	696,121,534.46

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

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

西部利得中证 1000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,361,739.31	4,068,897.73	5,430,637.04
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,361,739.31	4,068,897.73	5,430,637.04

西部利得中证 1000 指数增强 C

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

基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,104,344.12	4,791,348.47	5,895,692.59
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,104,344.12	4,791,348.47	5,895,692.59

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年4月25日（基金合同生效日）至2023年6月30日	
活期存款利息收入	147,715.26	
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	15,375.65	
其他	2,128.89	
合计	165,219.80	

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4月25日（基金合同生效日）至2023年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入	-884,596.04	
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	-884,596.04	

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4月25日（基金合同生效日）至2023年6月30日	
卖出股票成交总额	1,054,133,296.77	
减：卖出股票成本总额	1,051,777,280.97	
减：交易费用	3,240,611.84	
买卖股票差价收入	-884,596.04	

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无股票出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期无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

本基金在本报告期内未持有贵金属。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金在本报告期内未持有贵金属。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内未持有贵金属。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内未持有贵金属。

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衍生工具。

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 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-120,029.96

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	7,083,826.39
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	7,083,826.39

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 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	8,838,086.20
股票投资	8,838,086.20
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	22,160.00
权证投资	-
期货投资	22,160.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	8,860,246.20

6.4.7.21 其他收入

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

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

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期末产生信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	16,817.00
信息披露费	26,693.47
证券出借违约金	-
其他	400.00
合计	43,910.47

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

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《西部利得中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》、《西部利得中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》等规定，基金管理人西部利得基金管理有限公司于 2023 年 7 月 18 日（权益登记日），对本基金进行了分红除权。分红结果如下：权益登记日：2023 年 7 月 18 日，除息日 2023 年 7 月 18 日，现金红利发放日 2023 年 7 月 20 日，每 10 份西部利得中证 1000 指数增强 A 份额分红人民币 0.1000 元。每 10 份西部利得中证 1000 指数增强 C 份额分红人民币 0.1000 元。

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
平安银行股份有限公司	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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年4月25日（基金合同生效日）至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
西部证券	750,798,933.62	22.78

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期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

本基金本报告期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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年4月25日（基金合同生效日）至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
西部证券	323,831.51	16.80	323,831.51	16.80

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 2023年4月25日（基金合同生效日）至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,772,389.72
其中：支付销售机构的客户维护费	1,058,555.35

注：1. 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 1.20%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：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

2. 本基金合同生效日为 2023 年 04 月 25 日，无上年度可比期间对比数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	462,064.97

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 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	西部利得中证 1000 指数增强 A	西部利得中证 1000 指数增强 C	合计
平安银行	-	332,549.77	332,549.77
西部利得基金	-	3,983.11	3,983.11
西部证券	-	6,090.67	6,090.67
合计	-	342,623.55	342,623.55

注：1. 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。

2. 本基金合同生效日为 2023 年 4 月 25 日，无上年度可比期间对比数据。

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

本基金本报告期末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未与关联方进行转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

1. 本基金于本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

2. 本基金合同生效日为 2023 年 04 月 25 日，无上年度可比期间对比数据。

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

1. 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。
2. 本基金合同生效日为 2023 年 04 月 25 日，无上年度可比期间对比数据。

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 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
平安银行股份有限公司	97,826,771.60	147,715.26

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业利率计息。

2. 本基金通过“平安银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2023 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 7347819.35 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
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	-
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	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	锁定期	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
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	-
301261	恒工精密	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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-

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	4,820	277,921.20	277,921.20	-
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	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月	锁定期	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
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	-
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	-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	锁定期	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	锁定期	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
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	-
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有暂时停牌股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末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。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在信用良好的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在

银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金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
资产					
银行存款	97,826,771.60	-	-	-	97,826,771.60
结算备付金	7,347,819.35	-	-	-	7,347,819.35
存出保证金	1,440,297.24	-	-	-	1,440,297.24
交易性金融资产	-	-	-	-1,200,934,432.78	1,200,934,432.78
资产总计	106,614,888.19	-	-	-1,200,934,432.78	1,307,549,320.97
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,260,475.55	1,260,475.55
应付托管费	-	-	-	210,079.27	210,079.27
应付清算款	-	-	-	6,078,301.32	6,078,301.32
应付销售服务费	-	-	-	227,293.04	227,293.04
其他负债	-	-	-	1,970,548.52	1,970,548.52
负债总计	-	-	-	9,746,697.70	9,746,697.70
利率敏感度缺口	106,614,888.19	-	-	-1,191,187,735.08	1,297,802,623.27

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。

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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	1,200,934,432.78	92.54
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	1,200,934,432.78	92.54

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） 本期末（2023年6月30日）
	业绩比较基准上升 5%的影响金额	54,840,000.00
	业绩比较基准下降 5%的影响金额	-54,840,000.00

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
第一层次	1,199,892,085.68
第二层次	865,434.18
第三层次	176,912.92
合计	1,200,934,432.78

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。

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	1,200,934,432.78	91.85

	其中：股票	1,200,934,432.78	91.85
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	105,174,590.95	8.04
8	其他各项资产	1,440,297.24	0.11
9	合计	1,307,549,320.97	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	1,417,388.00	0.11
B	采矿业	35,684,430.55	2.75
C	制造业	787,129,406.59	60.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,430,649.00	1.50
E	建筑业	21,831,904.00	1.68
F	批发和零售业	34,879,240.12	2.69
G	交通运输、仓储和邮政业	12,818,769.00	0.99
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	75,509,031.50	5.82
J	金融业	27,384,109.40	2.11
K	房地产业	1,284,878.00	0.10
L	租赁和商务服务业	8,479,871.80	0.65
M	科学研究和技术服务业	11,998,642.00	0.92
N	水利、环境和公共设施管理业	9,243,973.80	0.71
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,544,044.00	0.50
R	文化、体育和娱乐业	12,004,004.00	0.92

S	综合	-	-
	合计	1,065,640,341.76	82.11

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	1,895,904.00	0.15
B	采矿业	-	-
C	制造业	94,347,979.40	7.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,219,444.00	0.48
E	建筑业	7,006,872.50	0.54
F	批发和零售业	8,967,017.20	0.69
G	交通运输、仓储和邮政业	3,066,449.00	0.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,327,188.44	0.26
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,606,453.00	0.12
L	租赁和商务服务业	1,323,781.00	0.10
M	科学研究和技术服务业	3,642,075.48	0.28
N	水利、环境和公共设施管理业	2,583,203.00	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	664,146.00	0.05
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	643,578.00	0.05
	合计	135,294,091.02	10.42

7.2.3 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

7.3.1 期末指数投资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	300123	亚光科技	2,005,900	14,602,952.00	1.13
2	300910	瑞丰新材	285,380	14,354,614.00	1.11

3	301268	铭利达	337,800	14,143,686.00	1.09
4	300203	聚光科技	677,500	13,732,925.00	1.06
5	603979	金诚信	433,200	13,472,520.00	1.04
6	002782	可立克	863,200	13,198,328.00	1.02
7	688676	金盘科技	431,400	13,067,106.00	1.01
8	688711	宏微科技	184,720	10,776,564.80	0.83
9	603997	继峰股份	737,300	10,543,390.00	0.81
10	600583	海油工程	1,748,543	10,228,976.55	0.79
11	600151	航天机电	1,136,600	10,127,106.00	0.78
12	002123	梦网科技	722,900	9,607,341.00	0.74
13	688499	利元亨	146,578	9,310,634.56	0.72
14	688033	天宜上佳	472,500	9,034,200.00	0.70
15	603093	南华期货	817,100	8,898,219.00	0.69
16	600864	哈投股份	1,725,500	8,817,305.00	0.68
17	601567	三星医疗	693,800	8,762,694.00	0.68
18	600876	凯盛新能	526,600	8,404,536.00	0.65
19	600984	建设机械	1,819,560	8,224,411.20	0.63
20	688148	芳源股份	650,994	7,942,126.80	0.61
21	300525	博思软件	515,500	7,907,770.00	0.61
22	300366	创意信息	624,100	7,713,876.00	0.59
23	688127	蓝特光学	436,606	7,697,363.78	0.59
24	603520	司太立	461,300	7,694,484.00	0.59
25	688518	联赢激光	268,897	7,491,470.42	0.58
26	002283	天润工业	1,166,000	7,485,720.00	0.58
27	002928	华夏航空	885,700	7,484,165.00	0.58
28	002859	洁美科技	270,100	7,481,770.00	0.58
29	688235	百济神州	67,700	7,386,747.00	0.57
30	002583	海能达	1,267,900	7,366,499.00	0.57
31	000951	中国重汽	437,100	7,365,135.00	0.57
32	002036	联创电子	755,800	7,338,818.00	0.57
33	688206	概伦电子	258,600	7,251,144.00	0.56
34	603678	火炬电子	210,000	7,236,600.00	0.56
35	600869	远东股份	1,308,000	7,220,160.00	0.56
36	300343	联创股份	1,007,502	7,133,114.16	0.55
37	002747	埃斯顿	253,800	7,106,400.00	0.55
38	603609	禾丰股份	780,700	7,104,370.00	0.55
39	300428	立中集团	306,300	7,063,278.00	0.54
40	300738	奥飞数据	692,360	7,062,072.00	0.54
41	002456	欧菲光	1,251,600	7,008,960.00	0.54
42	000032	深桑达 A	210,900	6,938,610.00	0.53
43	600996	贵广网络	705,700	6,929,974.00	0.53
44	300767	震安科技	271,600	6,887,776.00	0.53
45	300602	飞荣达	444,400	6,883,756.00	0.53

46	000567	海德股份	535,070	6,859,597.40	0.53
47	688083	中望软件	47,050	6,817,074.50	0.53
48	002163	海南发展	681,500	6,815,000.00	0.53
49	002292	奥飞娱乐	682,500	6,811,350.00	0.52
50	603308	应流股份	367,400	6,723,420.00	0.52
51	301087	可孚医疗	136,180	6,713,674.00	0.52
52	605369	拱东医疗	118,000	6,612,720.00	0.51
53	002434	万里扬	738,600	6,610,470.00	0.51
54	603567	珍宝岛	440,800	6,594,368.00	0.51
55	000851	高鸿股份	1,205,000	6,555,200.00	0.51
56	002044	美年健康	920,400	6,544,044.00	0.50
57	600771	广誉远	185,300	6,535,531.00	0.50
58	000829	天音控股	717,400	6,485,296.00	0.50
59	300633	开立医疗	117,000	6,376,500.00	0.49
60	600977	中国电影	449,600	6,316,880.00	0.49
61	301367	怡和嘉业	42,500	6,304,450.00	0.49
62	003031	中瓷电子	46,400	6,176,768.00	0.48
63	000860	顺鑫农业	181,300	6,107,997.00	0.47
64	603208	江山欧派	167,370	6,095,615.40	0.47
65	301039	中集车辆	457,600	6,054,048.00	0.47
66	688578	艾力斯	224,051	6,038,174.45	0.47
67	603032	德新科技	173,000	5,975,420.00	0.46
68	603533	掌阅科技	215,300	5,968,116.00	0.46
69	002929	润建股份	136,600	5,929,806.00	0.46
70	603306	华懋科技	201,000	5,833,020.00	0.45
71	600184	光电股份	442,700	5,812,651.00	0.45
72	002023	海特高新	630,300	5,798,760.00	0.45
73	301031	中熔电气	42,100	5,713,391.00	0.44
74	603300	华铁应急	1,045,184	5,696,252.80	0.44
75	300382	斯莱克	428,105	5,646,704.95	0.44
76	300101	振芯科技	289,900	5,621,161.00	0.43
77	002967	广电计量	278,400	5,593,056.00	0.43
78	600742	一汽富维	682,700	5,591,313.00	0.43
79	002895	川恒股份	283,000	5,575,100.00	0.43
80	600812	华北制药	990,100	5,534,659.00	0.43
81	002335	科华数据	153,400	5,514,730.00	0.42
82	600110	诺德股份	748,848	5,421,659.52	0.42
83	000030	富奥股份	1,073,500	5,410,440.00	0.42
84	605388	均瑶健康	425,200	5,404,292.00	0.42
85	603588	高能环境	569,040	5,331,904.80	0.41
86	002837	英维克	175,160	5,244,290.40	0.40
87	003012	东鹏控股	632,400	5,116,116.00	0.39
88	603113	金能科技	626,900	5,071,621.00	0.39

89	000917	电广传媒	683,300	4,994,923.00	0.38
90	603989	艾华集团	227,000	4,780,620.00	0.37
91	003021	兆威机电	54,400	4,772,512.00	0.37
92	002488	金固股份	671,000	4,629,900.00	0.36
93	603595	东尼电子	106,400	4,556,048.00	0.35
94	002402	和而泰	264,000	4,482,720.00	0.35
95	603212	赛伍技术	215,000	4,474,150.00	0.34
96	688680	海优新材	36,700	4,470,794.00	0.34
97	002158	汉钟精机	178,617	4,458,280.32	0.34
98	603693	江苏新能	317,000	4,438,000.00	0.34
99	688707	振华新材	143,000	4,402,970.00	0.34
100	601700	风范股份	827,400	4,393,494.00	0.34
101	601311	骆驼股份	470,550	4,366,704.00	0.34
102	002701	奥瑞金	962,600	4,341,326.00	0.33
103	002053	云南能投	385,800	4,328,676.00	0.33
104	002635	安洁科技	312,800	4,316,640.00	0.33
105	300393	中来股份	307,300	4,314,492.00	0.33
106	603179	新泉股份	98,000	4,301,220.00	0.33
107	300119	瑞普生物	241,600	4,300,480.00	0.33
108	603363	傲农生物	468,200	4,293,394.00	0.33
109	688007	光峰科技	205,700	4,288,845.00	0.33
110	000426	兴业银锡	480,200	4,264,176.00	0.33
111	600403	大有能源	1,037,000	4,262,070.00	0.33
112	603466	风语筑	301,200	4,186,680.00	0.32
113	600129	太极集团	69,800	4,152,402.00	0.32
114	603025	大豪科技	330,480	4,084,732.80	0.31
115	688131	皓元医药	70,900	4,039,882.00	0.31
116	603733	仙鹤股份	192,200	4,007,370.00	0.31
117	603801	志邦家居	121,200	4,002,024.00	0.31
118	002664	信质集团	284,200	4,001,536.00	0.31
119	000652	泰达股份	963,001	3,967,564.12	0.31
120	000737	北方铜业	733,100	3,951,409.00	0.30
121	001696	宗申动力	550,700	3,898,956.00	0.30
122	600966	博汇纸业	653,800	3,870,496.00	0.30
123	600550	保变电气	753,500	3,797,640.00	0.29
124	600662	外服控股	658,500	3,766,620.00	0.29
125	300055	万邦达	517,300	3,724,560.00	0.29
126	600776	东方通信	251,900	3,589,575.00	0.28
127	601609	金田股份	547,500	3,553,275.00	0.27
128	002139	拓邦股份	253,000	3,301,650.00	0.25
129	002724	海洋王	379,500	3,294,060.00	0.25
130	601890	亚星锚链	270,300	3,130,074.00	0.24
131	688239	航宇科技	44,500	3,112,775.00	0.24

132	603118	共进股份	234,200	3,112,518.00	0.24
133	688559	海目星	65,700	3,088,557.00	0.24
134	002960	青鸟消防	168,900	3,075,669.00	0.24
135	300827	上能电气	84,468	3,045,071.40	0.23
136	688333	铂力特	28,440	3,007,245.60	0.23
137	300224	正海磁材	231,900	2,982,234.00	0.23
138	000789	万年青	383,600	2,972,900.00	0.23
139	002048	宁波华翔	220,300	2,952,020.00	0.23
140	300900	广联航空	102,450	2,951,584.50	0.23
141	002759	天际股份	208,700	2,917,626.00	0.22
142	600058	五矿发展	296,600	2,915,578.00	0.22
143	300811	铂科新材	49,000	2,912,560.00	0.22
144	002378	章源钨业	499,210	2,905,402.20	0.22
145	002706	良信股份	258,200	2,904,750.00	0.22
146	600478	科力远	406,200	2,900,268.00	0.22
147	000811	冰轮环境	183,000	2,884,080.00	0.22
148	000550	江铃汽车	207,700	2,874,568.00	0.22
149	601369	陕鼓动力	314,600	2,866,006.00	0.22
150	000035	中国天楹	624,500	2,860,210.00	0.22
151	300723	一品红	97,500	2,856,750.00	0.22
152	603100	川仪股份	73,300	2,848,438.00	0.22
153	600933	爱柯迪	122,300	2,848,367.00	0.22
154	002484	江海股份	133,300	2,837,957.00	0.22
155	300080	易成新能	552,300	2,811,207.00	0.22
156	688023	安恒信息	16,000	2,795,360.00	0.22
157	605376	博迁新材	89,000	2,792,820.00	0.22
158	300662	科锐国际	78,700	2,783,619.00	0.21
159	300623	捷捷微电	153,400	2,779,608.00	0.21
160	300973	立高食品	40,600	2,777,852.00	0.21
161	601028	玉龙股份	258,100	2,774,575.00	0.21
162	000062	深圳华强	241,600	2,759,072.00	0.21
163	002918	蒙娜丽莎	178,000	2,748,320.00	0.21
164	002416	爱施德	370,300	2,732,814.00	0.21
165	000543	皖能电力	410,000	2,706,000.00	0.21
166	002911	佛燃能源	210,200	2,703,172.00	0.21
167	600997	开滦股份	452,700	2,702,619.00	0.21
168	300409	道氏技术	213,900	2,688,723.00	0.21
169	002440	闰土股份	401,600	2,678,672.00	0.21
170	300134	大富科技	260,300	2,668,075.00	0.21
171	000539	粤电力 A	356,100	2,599,530.00	0.20
172	000758	中色股份	495,800	2,340,176.00	0.18
173	300894	火星人	81,900	2,091,726.00	0.16
174	600075	新疆天业	428,000	2,015,880.00	0.16

175	600284	浦东建设	327,600	2,004,912.00	0.15
176	002233	塔牌集团	233,800	1,804,936.00	0.14
177	300942	易瑞生物	139,600	1,743,604.00	0.13
178	001269	欧晶科技	22,940	1,686,778.20	0.13
179	600480	凌云股份	211,000	1,658,460.00	0.13
180	603368	柳药集团	65,800	1,625,918.00	0.13
181	600335	国机汽车	141,400	1,611,960.00	0.12
182	002367	康力电梯	173,200	1,581,316.00	0.12
183	603713	密尔克卫	17,600	1,567,984.00	0.12
184	601279	英利汽车	277,200	1,535,688.00	0.12
185	603187	海容冷链	76,400	1,527,236.00	0.12
186	600746	江苏索普	232,400	1,517,572.00	0.12
187	600523	贵航股份	104,900	1,506,364.00	0.12
188	603103	横店影视	89,100	1,500,444.00	0.12
189	688776	国光电气	17,900	1,483,552.00	0.11
190	300416	苏试试验	68,100	1,468,236.00	0.11
191	605123	派克新材	13,500	1,466,775.00	0.11
192	301327	华宝新能	18,500	1,463,535.00	0.11
193	300358	楚天科技	97,900	1,461,647.00	0.11
194	002428	云南锗业	120,000	1,459,200.00	0.11
195	688330	宏力达	41,500	1,455,820.00	0.11
196	603985	恒润股份	69,400	1,455,318.00	0.11
197	688800	瑞可达	23,400	1,454,310.00	0.11
198	600821	金开新能	210,900	1,453,101.00	0.11
199	600172	黄河旋风	338,200	1,447,496.00	0.11
200	688733	壹石通	46,700	1,445,832.00	0.11
201	002106	莱宝高科	169,100	1,437,350.00	0.11
202	300762	上海瀚讯	121,400	1,428,878.00	0.11
203	002636	金安国纪	154,500	1,426,035.00	0.11
204	300323	华灿光电	207,800	1,423,430.00	0.11
205	000913	钱江摩托	77,900	1,420,117.00	0.11
206	605020	永和股份	55,000	1,419,550.00	0.11
207	002124	天邦食品	312,200	1,417,388.00	0.11
208	300332	天壕能源	123,400	1,415,398.00	0.11
209	000712	锦龙股份	113,100	1,411,488.00	0.11
210	600312	平高电气	113,900	1,411,221.00	0.11
211	600116	三峡水利	155,200	1,409,216.00	0.11
212	688696	极米科技	10,100	1,407,839.00	0.11
213	300821	东岳硅材	144,200	1,404,508.00	0.11
214	300737	科顺股份	152,600	1,397,816.00	0.11
215	600643	爱建集团	279,500	1,397,500.00	0.11
216	300327	中颖电子	49,800	1,392,408.00	0.11
217	002906	华阳集团	40,600	1,388,114.00	0.11

218	000016	深康佳 A	293,900	1,387,208.00	0.11
219	000761	本钢板材	345,500	1,382,000.00	0.11
220	002741	光华科技	81,500	1,375,720.00	0.11
221	688798	艾为电子	23,100	1,366,365.00	0.11
222	600073	上海梅林	186,900	1,364,370.00	0.11
223	600197	伊力特	50,200	1,363,934.00	0.11
224	603053	成都燃气	135,200	1,361,464.00	0.10
225	002727	一心堂	51,500	1,359,600.00	0.10
226	688639	华恒生物	15,000	1,357,200.00	0.10
227	300702	天宇股份	55,900	1,356,693.00	0.10
228	603983	丸美股份	41,900	1,355,465.00	0.10
229	688278	特宝生物	30,743	1,349,925.13	0.10
230	600098	广州发展	217,600	1,344,768.00	0.10
231	688100	威胜信息	45,000	1,341,450.00	0.10
232	603033	三维股份	65,700	1,336,995.00	0.10
233	000672	上峰水泥	145,800	1,331,154.00	0.10
234	002237	恒邦股份	122,000	1,328,580.00	0.10
235	600491	龙元建设	263,200	1,326,528.00	0.10
236	002212	天融信	136,400	1,323,080.00	0.10
237	603566	普莱柯	56,700	1,318,275.00	0.10
238	002242	九阳股份	87,800	1,312,610.00	0.10
239	600185	格力地产	187,300	1,284,878.00	0.10
240	300755	华致酒行	57,000	1,280,790.00	0.10
241	600841	动力新科	200,700	1,224,270.00	0.09
242	688368	晶丰明源	9,500	1,208,495.00	0.09
243	603766	隆鑫通用	220,900	1,166,352.00	0.09
244	000688	国城矿业	73,600	1,116,512.00	0.09
245	002573	清新环境	190,900	1,051,859.00	0.08
246	002946	新乳业	72,400	1,038,940.00	0.08
247	603098	森特股份	49,868	1,022,294.00	0.08
248	600955	维远股份	51,600	1,002,588.00	0.08
249	603060	国检集团	85,800	897,468.00	0.07
250	301177	迪阿股份	21,100	810,873.00	0.06
251	000612	焦作万方	165,300	800,052.00	0.06
252	603057	紫燕食品	25,800	648,354.00	0.05
253	301180	万祥科技	36,500	639,845.00	0.05
254	001322	箭牌家居	36,800	616,032.00	0.05
255	002481	双塔食品	115,000	512,900.00	0.04

7.3.2 期末积极投资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	300791	仙乐健康	179,700	5,218,488.00	0.40
2	000601	韶能股份	767,200	3,521,448.00	0.27

3	300487	蓝晓科技	43,950	2,743,359.00	0.21
4	300328	宜安科技	217,122	1,508,997.90	0.12
5	605339	南侨食品	67,000	1,333,970.00	0.10
6	300659	中孚信息	59,700	1,213,104.00	0.09
7	603042	华脉科技	45,000	1,132,200.00	0.09
8	300215	电科院	202,400	1,036,288.00	0.08
9	603178	圣龙股份	69,800	859,936.00	0.07
10	300594	朗进科技	32,800	845,584.00	0.07
11	300807	天迈科技	27,500	804,375.00	0.06
12	600137	浪莎股份	41,900	803,642.00	0.06
13	002806	华锋股份	60,000	768,000.00	0.06
14	300836	佰奥智能	25,600	764,928.00	0.06
15	300851	交大思诺	28,300	762,402.00	0.06
16	600593	大连圣亚	46,200	756,756.00	0.06
17	001209	洪兴股份	42,300	753,363.00	0.06
18	002890	弘宇股份	50,680	748,543.60	0.06
19	300611	美力科技	77,600	748,064.00	0.06
20	301163	宏德股份	23,400	738,270.00	0.06
21	300749	顶固集创	80,300	737,957.00	0.06
22	300707	威唐工业	46,900	733,047.00	0.06
23	300720	海川智能	57,900	732,435.00	0.06
24	002899	英派斯	48,600	727,542.00	0.06
25	301131	聚赛龙	18,100	727,258.00	0.06
26	301070	开勒股份	19,400	725,560.00	0.06
27	300823	建科机械	35,300	725,415.00	0.06
28	300717	华信新材	42,400	722,920.00	0.06
29	603488	展鹏科技	90,000	722,700.00	0.06
30	301178	天亿马	22,400	721,952.00	0.06
31	002780	三夫户外	53,000	720,800.00	0.06
32	603879	永悦科技	106,300	720,714.00	0.06
33	002691	冀凯股份	115,200	720,000.00	0.06
34	300743	天地数码	45,800	719,976.00	0.06
35	603321	梅轮电梯	92,400	719,796.00	0.06
36	600192	长城电工	124,200	719,118.00	0.06
37	002893	京能热力	66,700	718,359.00	0.06
38	002820	桂发祥	63,100	715,554.00	0.06
39	301037	保立佳	40,100	714,582.00	0.06
40	002209	达意隆	69,500	712,375.00	0.05
41	301042	安联锐视	20,900	709,555.00	0.05
42	002715	登云股份	48,300	709,527.00	0.05
43	603709	中源家居	39,000	707,460.00	0.05
44	002767	先锋电子	50,600	706,882.00	0.05
45	603089	正裕工业	79,500	706,755.00	0.05

46	603725	天安新材	86,800	705,684.00	0.05
47	603657	春光科技	40,200	705,510.00	0.05
48	300665	飞鹿股份	81,100	704,759.00	0.05
49	300462	华铭智能	59,800	702,052.00	0.05
50	300535	达威股份	48,200	701,792.00	0.05
51	603037	凯众股份	51,090	698,400.30	0.05
52	600250	南纺股份	112,400	698,004.00	0.05
53	600689	上海三毛	74,500	696,575.00	0.05
54	002861	瀛通通讯	60,800	695,552.00	0.05
55	600768	宁波富邦	64,000	694,400.00	0.05
56	600630	龙头股份	120,800	690,976.00	0.05
57	603608	天创时尚	148,900	690,896.00	0.05
58	603045	福达合金	45,600	690,384.00	0.05
59	600791	京能置业	150,200	689,418.00	0.05
60	603316	诚邦股份	112,000	687,680.00	0.05
61	603090	宏盛股份	30,900	687,525.00	0.05
62	300281	金明精机	127,900	685,544.00	0.05
63	603048	浙江黎明	42,500	684,250.00	0.05
64	603038	华立股份	77,600	682,880.00	0.05
65	300564	筑博设计	51,100	681,674.00	0.05
66	600202	哈空调	121,700	680,303.00	0.05
67	002199	东晶电子	79,900	679,949.00	0.05
68	603937	丽岛新材	58,500	678,015.00	0.05
69	000702	正虹科技	123,500	676,780.00	0.05
70	301016	雷尔伟	33,717	676,363.02	0.05
71	002205	国统股份	63,800	675,642.00	0.05
72	600302	标准股份	128,200	675,614.00	0.05
73	605180	华生科技	54,600	675,402.00	0.05
74	002357	富临运业	100,500	675,360.00	0.05
75	002830	名雕股份	52,700	675,087.00	0.05
76	300640	德艺文创	112,200	674,322.00	0.05
77	300218	安利股份	71,500	673,530.00	0.05
78	603059	倍加洁	29,600	673,104.00	0.05
79	003017	大洋生物	20,000	673,000.00	0.05
80	002998	优彩资源	94,600	671,660.00	0.05
81	600847	万里股份	55,000	671,550.00	0.05
82	600539	狮头股份	100,500	671,340.00	0.05
83	002963	豪尔赛	46,100	670,755.00	0.05
84	002862	实丰文化	35,600	670,704.00	0.05
85	301003	江苏博云	29,000	670,190.00	0.05
86	300030	阳普医疗	89,600	669,312.00	0.05
87	300329	海伦钢琴	94,600	668,822.00	0.05
88	605318	法狮龙	48,200	668,052.00	0.05

89	000929	兰州黄河	68,300	667,974.00	0.05
90	000605	渤海股份	105,600	667,392.00	0.05
91	003001	中岩大地	40,700	666,666.00	0.05
92	002802	洪汇新材	60,190	665,701.40	0.05
93	301237	和顺科技	22,400	665,056.00	0.05
94	300562	乐心医疗	67,800	664,440.00	0.05
95	600455	博通股份	29,400	664,146.00	0.05
96	600083	博信股份	93,600	663,624.00	0.05
97	002981	朝阳科技	27,500	662,750.00	0.05
98	301167	建研设计	37,380	661,626.00	0.05
99	003003	天元股份	62,500	661,250.00	0.05
100	301040	中环海陆	32,100	659,655.00	0.05
101	300703	创源股份	69,200	658,784.00	0.05
102	603161	科华控股	45,200	658,564.00	0.05
103	603080	新疆火炬	46,300	656,997.00	0.05
104	301098	金埔园林	54,450	656,122.50	0.05
105	002836	新宏泽	80,400	655,260.00	0.05
106	600149	廊坊发展	116,800	655,248.00	0.05
107	600356	恒丰纸业	83,600	654,588.00	0.05
108	002718	友邦吊顶	43,100	653,396.00	0.05
109	603580	艾艾精工	45,900	653,157.00	0.05
110	600883	博闻科技	86,000	652,740.00	0.05
111	603729	龙韵股份	43,700	652,441.00	0.05
112	002826	易明医药	59,100	650,691.00	0.05
113	002105	信隆健康	109,300	650,335.00	0.05
114	301057	汇隆新材	37,700	649,948.00	0.05
115	002144	宏达高科	58,000	649,020.00	0.05
116	300854	中兰环保	40,800	648,720.00	0.05
117	002494	华斯股份	139,800	647,274.00	0.05
118	600156	华升股份	146,800	645,920.00	0.05
119	603696	安记食品	68,300	644,752.00	0.05
120	000609	中迪投资	133,800	643,578.00	0.05
121	600128	苏豪弘业	78,100	641,982.00	0.05
122	600232	金鹰股份	117,500	641,550.00	0.05
123	603022	新通联	68,100	640,821.00	0.05
124	300658	延江股份	97,800	640,590.00	0.05
125	603139	康惠制药	39,100	640,458.00	0.05
126	600493	凤竹纺织	114,300	640,080.00	0.05
127	300106	西部牧业	79,700	639,991.00	0.05
128	600857	宁波中百	64,600	639,540.00	0.05
129	002696	百洋股份	102,400	638,976.00	0.05
130	000632	三木集团	150,900	638,307.00	0.05
131	002682	龙洲股份	156,400	638,112.00	0.05

132	600051	宁波联合	87,100	634,088.00	0.05
133	000590	启迪药业	72,700	633,944.00	0.05
134	600778	友好集团	93,000	632,400.00	0.05
135	603616	韩建河山	121,400	631,280.00	0.05
136	600538	国发股份	149,500	630,890.00	0.05
137	002883	中设股份	53,500	630,765.00	0.05
138	301130	西点药业	22,900	629,292.00	0.05
139	603637	镇海股份	75,900	626,175.00	0.05
140	603536	惠发食品	97,000	624,680.00	0.05
141	603716	塞力医疗	66,200	624,266.00	0.05
142	600697	欧亚集团	50,700	624,117.00	0.05
143	603810	丰山集团	45,200	622,404.00	0.05
144	600272	开开实业	68,700	620,361.00	0.05
145	300621	维业股份	61,800	618,618.00	0.05
146	600119	长江投资	105,000	618,450.00	0.05
147	603036	如通股份	58,400	617,872.00	0.05
148	603860	中公高科	21,600	617,328.00	0.05
149	600234	科新发展	102,700	617,227.00	0.05
150	600506	统一股份	58,700	616,937.00	0.05
151	000619	海螺新材	100,900	615,490.00	0.05
152	600561	江西长运	116,600	614,482.00	0.05
153	600193	创兴资源	116,600	612,150.00	0.05
154	603717	天域生态	90,100	611,779.00	0.05
155	002910	庄园牧场	55,400	609,400.00	0.05
156	600712	南宁百货	164,000	608,440.00	0.05
157	300074	华平股份	141,100	608,141.00	0.05
158	002620	瑞和股份	116,200	604,240.00	0.05
159	301259	艾布鲁	44,720	601,484.00	0.05
160	600107	美尔雅	110,200	591,774.00	0.05
161	600753	庚星股份	63,400	580,744.00	0.04
162	603955	大千生态	38,000	577,600.00	0.04
163	605081	太和水	38,700	576,243.00	0.04
164	000856	冀东装备	65,600	569,408.00	0.04
165	301023	江南奕帆	12,000	557,400.00	0.04
166	301007	德迈仕	35,200	543,136.00	0.04
167	002921	联诚精密	29,900	538,499.00	0.04
168	603506	南都物业	44,500	526,435.00	0.04
169	300240	飞力达	83,900	518,502.00	0.04
170	002931	锋龙股份	39,600	516,780.00	0.04
171	600319	亚星化学	101,000	507,020.00	0.04
172	603188	亚邦股份	145,000	504,600.00	0.04
173	603356	华菱精工	34,300	483,630.00	0.04
174	301079	邵阳液压	22,620	482,258.40	0.04

175	605258	协和电子	17,500	454,650.00	0.04
176	300126	锐奇股份	68,200	442,618.00	0.03
177	001296	长江材料	20,800	437,008.00	0.03
178	603023	威帝股份	106,300	433,704.00	0.03
179	300243	瑞丰高材	48,400	425,920.00	0.03
180	600243	青海华鼎	95,000	420,850.00	0.03
181	603726	朗迪集团	32,500	411,450.00	0.03
182	600235	民丰特纸	75,100	407,042.00	0.03
183	600889	南京化纤	86,100	405,531.00	0.03
184	000985	大庆华科	24,800	401,760.00	0.03
185	603150	万朗磁塑	14,880	392,236.80	0.03
186	600692	亚通股份	70,000	390,600.00	0.03
187	600678	四川金顶	71,500	381,810.00	0.03
188	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.02
189	300162	雷曼光电	34,700	243,594.00	0.02
190	301022	海泰科	8,720	221,052.00	0.02
191	002134	天津普林	21,200	217,088.00	0.02
192	300283	温州宏丰	33,400	197,060.00	0.02
193	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.01
194	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
195	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
196	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
197	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
198	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
199	301063	海锅股份	2,100	58,506.00	0.00
200	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
201	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
202	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
203	301210	金杨股份	281	13,816.77	0.00
204	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
205	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
206	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
207	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
208	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
209	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
210	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
211	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
212	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
213	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
214	603885	吉祥航空	100	1,543.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	603032	德新科技	18,134,200.88	1.40
2	688711	宏微科技	17,853,755.50	1.38
3	300203	聚光科技	16,316,972.00	1.26
4	600583	海油工程	15,775,935.40	1.22
5	688676	金盘科技	15,131,206.22	1.17
6	688037	芯源微	14,619,057.46	1.13
7	603520	司太立	14,604,796.00	1.13
8	300910	瑞丰新材	14,450,772.00	1.11
9	603979	金诚信	14,330,381.25	1.10
10	300123	亚光科技	14,325,957.00	1.10
11	000567	海德股份	14,236,666.23	1.10
12	301268	铭利达	12,897,939.30	0.99
13	301039	中集车辆	12,860,083.00	0.99
14	002782	可立克	12,820,823.00	0.99
15	002335	科华数据	12,106,442.00	0.93
16	002911	佛燃能源	11,667,403.20	0.90
17	688127	蓝特光学	11,582,773.00	0.89
18	002746	仙坛股份	11,554,017.25	0.89
19	603300	华铁应急	11,500,126.30	0.89
20	002918	蒙娜丽莎	11,233,185.00	0.87

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	688037	芯源微	14,379,453.73	1.11
2	603032	德新科技	11,727,562.80	0.90
3	300298	三诺生物	10,997,101.40	0.85
4	002746	仙坛股份	10,910,304.04	0.84
5	002911	佛燃能源	9,178,251.00	0.71
6	300455	航天智装	8,533,923.00	0.66
7	301078	孩子王	8,502,377.40	0.66
8	601137	博威合金	8,297,406.00	0.64
9	002865	钧达股份	8,122,557.32	0.63
10	300981	中红医疗	7,905,650.60	0.61
11	002918	蒙娜丽莎	7,817,763.88	0.60
12	300679	电连技术	7,786,957.16	0.60
13	002063	远光软件	7,731,095.60	0.60
14	600312	平高电气	7,688,898.00	0.59

15	002099	海翔药业	7,658,044.00	0.59
16	300423	昇辉科技	7,656,331.80	0.59
17	000539	粤电力 A	7,618,389.00	0.59
18	000966	长源电力	7,594,247.00	0.59
19	301155	海力风电	7,531,491.00	0.58
20	300102	乾照光电	7,502,001.00	0.58

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	2,243,873,627.55
卖出股票收入（成交）总额	1,054,133,296.77

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

本基金于本报告期末未持有债券投资。

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

本基金于本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货不在本基金投资范围内。

7.11.2 本期国债期货投资评价

国债期货不在本基金投资范围内。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,440,297.24
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,440,297.24

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

7.12.5.1 期末指数投资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。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
西部利得 中证 1000 指数增强 A	5,198	113,573.44	59,236,744.42	10.03	531,118,014.76	89.97
西部利得 中证 1000 指数增强 C	8,424	82,635.51	51,072,126.41	7.34	645,049,408.05	92.66
合计	13,497	95,315.72	110,308,870.83	8.57	1,176,167,422.81	91.43

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	西部利得中证 1000 指数增强 A	1,317,182.72	0.2231
	西部利得中证 1000 指数增强 C	2,246,016.34	0.3226
	合计	3,563,199.06	0.2770

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	西部利得中证 1000 指数增强 A	50~100
	西部利得中证 1000 指数增强 C	0~10
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	西部利得中证 1000 指数增强 A	—
	西部利得中证 1000 指数增强 C	10~50
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	西部利得中证 1000 指数增强 A	西部利得中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日 (2023 年 4 月 25 日) 基金份额总额	590,354,759.18	696,121,534.46
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	-	-
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额	-	-
本报告期末基金份 额总额	590,354,759.18	696,121,534.46

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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受到稽查或处罚等情况。

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 (%)	
中信建投	2	1,685,387,915.70	51.14	1,232,530.11	63.96	-
国盛证券	2	755,003,426.68	22.91	325,637.78	16.90	-
西部证券	2	750,798,933.62	22.78	323,831.51	16.80	-
中信证券	2	104,430,704.32	3.17	45,038.65	2.34	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名	债券交易	债券回购交易	权证交易
-----	------	--------	------

称	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 (%)
中信建投	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

10.8 其他重大事件

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