

西部利得中证 500 指数增强型证券投资基  
金 (LOF)  
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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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	6
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	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
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	11
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	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
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	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>47</b>
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63

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 .....	63
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 .....	63
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 .....	63
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 .....	64
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	64
7.12 投资组合报告附注 .....	64
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>65</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	65
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	65
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	66
8.4 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 .....	66
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>66</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>67</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	67
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 .....	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	67
10.4 基金投资策略的改变 .....	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	67
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 .....	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	67
10.8 其他重大事件 .....	70
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>70</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 .....	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	70
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>70</b>
12.1 备查文件目录 .....	70
12.2 存放地点 .....	71
12.3 查阅方式 .....	71

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)	
基金简称	500 增强 LOF	
基金主代码	502000	
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)	
基金合同生效日	2020 年 2 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	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	1,599,156,191.13 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的 证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2020 年 2 月 19 日	
下属分级基金的基 金简称	西部利得中证 500 指数增强 A	西部利得中证 500 指数增强 C
下属分级基金的场 内简称	500 增强 LOF	-
下属分级基金的交 易代码	502000	009300
报告期末下属分级 基金的份额总额	1,163,329,956.57 份	435,826,234.56 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，追求基金净值增长率与业绩比较基准之间跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，同时力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金 80%以上非现金资产投资于中证 500 指数成分股，维持高股票仓位，在有效复制标的指数、控制投资组合与业绩比较基准跟踪误差的基础上，兼顾安全边际以及业绩的成长性，以期获得相对于

	该指数的超额收益。(详见《基金合同》)
业绩比较基准	本基金的标的指数为：中证 500 指数 本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*95%+商业银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。 本基金为指数型基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	西部利得基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	赵毅
	联系电话	021-38572888
	电子邮箱	service@westleadfund.com
客户服务电话	4007-007-818	95561
传真	021-50710261	021-62159217
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区耀 体路 276 号 901 室-908 室	福建省福州市台江区江滨中大 道 398 号兴业银行大厦
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区耀 体路 276 号 901 室-908 室	上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼
邮政编码	200126	200120
法定代表人	何方	吕家进

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
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	中国证券登记结算有限责任公 司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 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)	
	西部利得中证 500 指数增强 A	西部利得中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	64,923,931.35	12,600,813.69
本期利润	92,745,088.87	27,285,276.43

加权平均基金份额本期利润	0.0785	0.0805
本期加权平均净值利润率	4.87%	5.06%
本期基金份额净值增长率	4.96%	4.76%
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	-98,846,546.25	163,909,180.95
期末可供分配基金份额利润	-0.0850	0.3761
期末基金资产净值	1,869,524,058.60	691,614,898.18
期末基金份额净值	1.6070	1.5869
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	60.70%	70.52%

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 500 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	1.30%	0.79%	-0.77%	0.89%	2.07%	-0.10%
过去三个月	-1.44%	0.72%	-5.10%	0.78%	3.66%	-0.06%

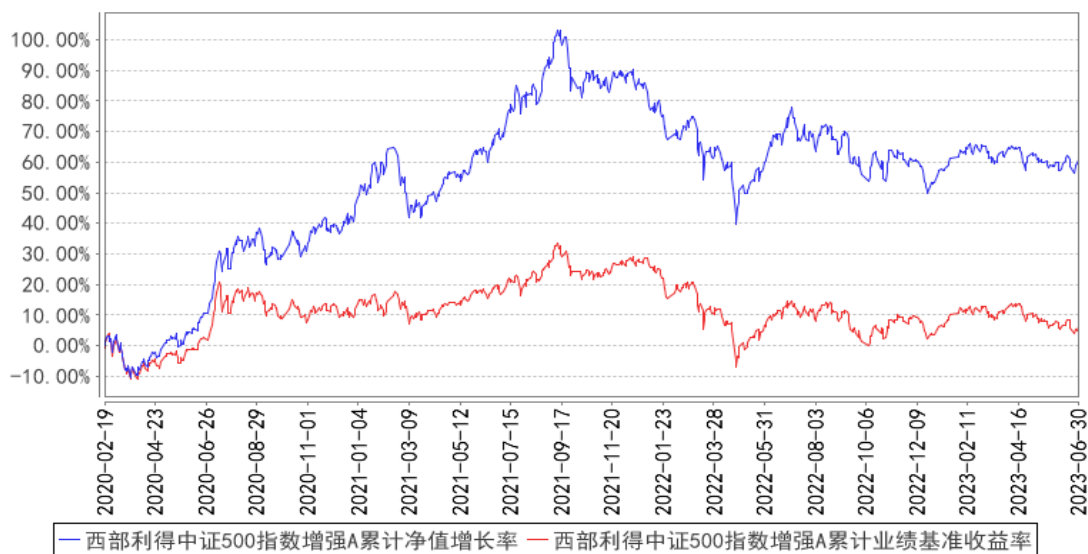
过去六个月	4.96%	0.69%	2.20%	0.75%	2.76%	-0.06%
过去一年	-7.82%	0.92%	-6.65%	0.91%	-1.17%	0.01%
过去三年	42.10%	1.23%	2.48%	1.13%	39.62%	0.10%
自基金合同生效起 至今	60.70%	1.27%	6.04%	1.18%	54.66%	0.09%

西部利得中证 500 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	1.27%	0.79%	-0.77%	0.89%	2.04%	-0.10%
过去三个月	-1.54%	0.72%	-5.10%	0.78%	3.56%	-0.06%
过去六个月	4.76%	0.69%	2.20%	0.75%	2.56%	-0.06%
过去一年	-8.19%	0.92%	-6.65%	0.91%	-1.54%	0.01%
过去三年	40.43%	1.23%	2.48%	1.13%	37.95%	0.10%
自基金合同生效起 至今	70.52%	1.22%	14.72%	1.12%	55.80%	0.10%

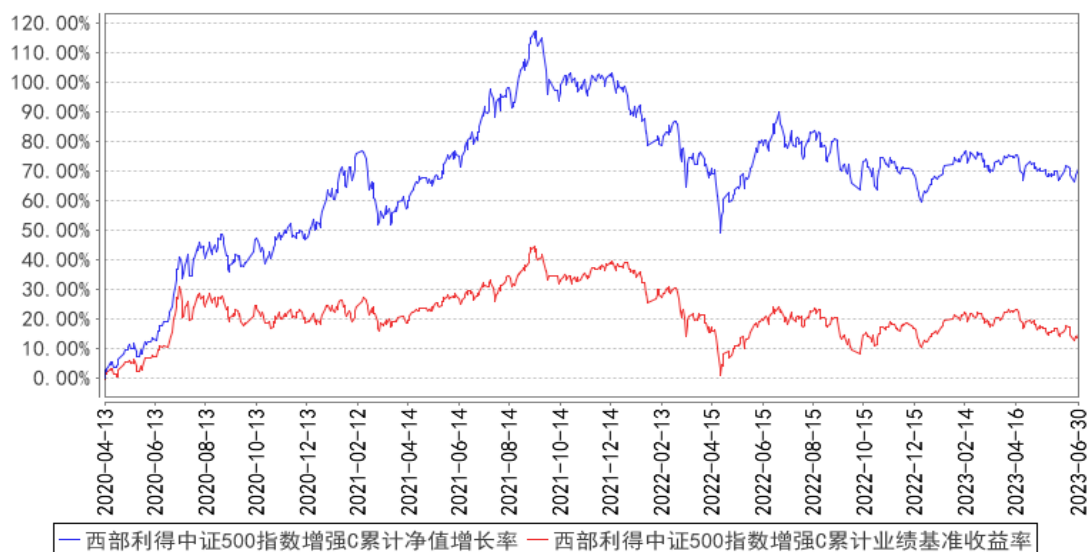
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

西部利得中证500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500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



### 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		
盛行	主动量化投资部总经理、投资总监、基金经理	2020 年 2 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。
陈元 陈骅	基金经理	2022 年 1 月 17 日	-	8 年	美国哥伦比亚大学金融数学硕士，曾任中信建投证券股份有限公司研究发展部金融工程分析师。2020 年 5 月 28 日加入本公司，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《证券法》、《证券投资基金法》、本基金《基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

投资策略上，本基金始终维持高股票仓位，行业配置参考中证 500 指数，股票持仓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，略添加了大宗折价策略。本基金努力通过选股获得相对于中证 500 指数的超额收益，以期打造优质的中证 500 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 年半年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及应用性的情况，以及在采用新投资策略或投资新品种时，估值委员会负责对所采用的估值模型、假设及参数的适当性进行重新评估或修订，必要时聘请会计师事务所进行审核并出具意见。针对个别投资品种的估值方法调整，均须通过托管银行复核。

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

可参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)

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	216,217,872.83	190,877,279.06
结算备付金		21,259,728.74	49,387,493.18
存出保证金		6,353,871.56	11,824,631.38
交易性金融资产	6.4.7.2	2,367,662,919.41	2,092,800,561.30
其中：股票投资		2,367,662,919.41	2,092,800,561.30
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		-	1,249,055.71
应收股利		-	-

应收申购款		3,057,903.95	3,260,611.42
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	370.00	370.00
资产总计		2,614,552,666.49	2,349,400,002.05
<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		40,085,046.77	19,856,395.55
应付赎回款		6,007,040.58	3,176,260.08
应付管理人报酬		2,056,688.89	2,020,046.85
应付托管费		411,337.74	404,009.34
应付销售服务费		225,332.44	185,230.00
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	4,628,263.29	4,860,794.57
负债合计		53,413,709.71	30,502,736.39
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	2,135,750,352.14	2,066,191,112.54
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	425,388,604.64	252,706,153.12
净资产合计		2,561,138,956.78	2,318,897,265.66
负债和净资产总计		2,614,552,666.49	2,349,400,002.05

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,599,156,191.13 份，其中西部利得中证 500 指数增强 A 基金份额总额 1,163,329,956.57 份，基金份额净值 1.6070 元。西部利得中证 500 指数增强 C 基金份额总额 435,826,234.56 份，基金份额净值 1.5869 元。

## 6.2 利润表

会计主体：西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)

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>		135,968,330.42	-182,986,946.91
1. 利息收入		472,681.35	593,526.21
其中：存款利息收入	6.4.7.13	472,681.35	593,526.21

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）		92,550,417.69	-347,361,831.36
其中：股票投资收益	6.4.7.14	65,853,088.30	-371,537,280.51
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	1,056,415.56	-2,001,695.66
股利收益	6.4.7.19	25,640,913.83	26,177,144.81
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	42,505,620.26	162,985,255.60
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	439,611.12	796,102.64
<b>减：二、营业总支出</b>		15,937,965.12	16,813,358.56
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	12,118,729.96	12,734,156.83
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,423,745.95	2,546,831.34
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,069,190.34	1,228,732.06
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		8,091.49	-
8. 其他费用	6.4.7.23	318,207.38	303,638.33
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		120,030,365.30	-199,800,305.47
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		120,030,365.30	-199,800,305.47
<b>五、其他综合收益的税后</b>		-	-

净额			
六、综合收益总额		120,030,365.30	-199,800,305.47

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)

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）	2,066,191,112. 54	-	252,706,153.12	2,318,897,265.6 6
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）	2,066,191,112. 54	-	252,706,153.12	2,318,897,265.6 6
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	69,559,239.60	-	172,682,451.52	242,241,691.12
（一）、综合收益总额	-	-	120,030,365.30	120,030,365.30
（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）	69,559,239.60	-	52,652,086.22	122,211,325.82
其中：1. 基金申购款	662,688,441.41	-	208,353,515.42	871,041,956.83
2. 基金赎回款	-593,129,201.8 1	-	-155,701,429.2 0	-748,830,631.01
（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)	2,135,750,352.14	-	425,388,604.64	2,561,138,956.78
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)	2,172,833,511.86	-	830,340,000.13	3,003,173,511.99
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)	2,172,833,511.86	-	830,340,000.13	3,003,173,511.99
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-153,067,845.08	-	-253,622,781.19	-406,690,626.27
(一)、综合收益总额	-	-	-199,800,305.47	-199,800,305.47
(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)	-153,067,845.08	-	-53,822,475.72	-206,890,320.80
其中: 1. 基金申购款	785,358,192.36	-	247,166,620.07	1,032,524,812.43
2. 基金赎回款	-938,426,037.44	-	-300,989,095.79	-1,239,415,133.23
(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)	2,019,765,666.78	-	576,717,218.94	2,596,482,885.72

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>贺燕萍</u>	<u>贺燕萍</u>	<u>张皞骏</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”)是由西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金转型而来。原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[2014]1414 号《关于准予西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金的批复》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 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。原基金为契约型开放式基金,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 202,971,734.99 元,业经普华永道中天会计师事务所普华永道中天验字[2015]第 320 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 4 月 15 日正式生效,原基金合同生效日的基金份额总额为 202,990,676.07 份基金份额,其中认购资金利息折合 18,941.08 份基金份额。

根据原基金的基金管理人西部利得基金管理有限公司于 2020 年 2 月 19 日发布的《西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同等法律文件生效的公告》,自 2020 年 2 月 19 日起,原基金更名为西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF),《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同》失效,《西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同》于同日生效。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。本基金的基金管理人为西部利得基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括标的指数的成分股、备选成分股、其他国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、国债、央行票据、金融债、地方政府债、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场

工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以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:股票资产占基金资产的比例不低于 80%,其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更基金投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的标的指数为:中证 500 指数

本基金业绩比较基准为:中证 500 指数收益率\*95%+商业银行活期存款利率(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 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	216, 217, 872. 83

等于：本金	216,197,972.65
加：应计利息	19,900.18
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	216,217,872.83

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	2,420,511,119.80	-	2,367,662,919.41	-52,848,200.39
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	2,420,511,119.80	-	2,367,662,919.41	-52,848,200.39

#### 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	43,253,054.74	-	-	-
其中：股指期货投资	43,253,054.74	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	43,253,054.74	-	-	-

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	26.00	31,152,160.00	-303,734.74
IC2308	IC2308	10.00	11,960,800.00	163,640.00
合计				-140,094.74
减：可抵销期货暂收款				-140,094.74
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**

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应收利息	-
其他应收款	370.00
待摊费用	-
合计	370.00

**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	12,281.36
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	4,030,845.02
其中：交易所市场	4,030,845.02
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	159,178.95
应付指数使用费	425,957.96
合计	4,628,263.29

**6.4.7.10 实收基金**

金额单位：人民币元

西部利得中证 500 指数增强 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	1,188,335,162.73	1,736,462,349.31
本期申购	254,736,719.69	372,236,949.95
本期赎回 (以“-”号填列)	-279,741,925.85	-408,775,181.68
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	1,163,329,956.57	1,699,924,117.58

## 西部利得中证 500 指数增强 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	329,728,763.23	329,728,763.23
本期申购	290,451,491.46	290,451,491.46
本期赎回 (以“-”号填列)	-184,354,020.13	-184,354,020.13
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	435,826,234.56	435,826,234.56

注：申购含红利再投资、转换入份额；赎回含转换出份额。

## 6.4.7.11 其他综合收益

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

## 西部利得中证 500 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-163,254,482.74	246,200,659.54	82,946,176.80
本期利润	64,923,931.35	27,821,157.52	92,745,088.87
本期基金份额交易产生的变动数	-515,994.86	-5,575,329.79	-6,091,324.65
其中：基金申购款	-28,538,438.25	68,112,949.66	39,574,511.41
基金赎回款	28,022,443.39	-73,688,279.45	-45,665,836.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-98,846,546.25	268,446,487.27	169,599,941.02

## 西部利得中证 500 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	107,952,946.55	61,807,029.77	169,759,976.32

本期利润	12,600,813.69	14,684,462.74	27,285,276.43
本期基金份额交易产生的变动数	43,355,420.71	15,387,990.16	58,743,410.87
其中：基金申购款	108,673,738.03	60,105,265.98	168,779,004.01
基金赎回款	-65,318,317.32	-44,717,275.82	-110,035,593.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	163,909,180.95	91,879,482.67	255,788,663.62

#### 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	352,368.96	
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	96,125.34	
其他	24,187.05	
合计	472,681.35	

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	65,853,088.30	
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	65,853,088.30	

##### 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	7,142,898,337.45	
减：卖出股票成本总额	7,060,108,260.54	
减：交易费用	16,936,988.61	
买卖股票差价收入	65,853,088.30	

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无股票出借差价收入。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

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

本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无资产支持证券赎回差价收入。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无资产支持证券申购差价收入。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金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

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	1,056,415.56

## 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	25,640,913.83
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	25,640,913.83

## 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	39,503,955.00
股票投资	39,503,955.00
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	3,001,665.26
权证投资	-
期货投资	3,001,665.26
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	42,505,620.26

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	439,484.76
基金转换费收入	126.36
合计	439,611.12

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

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费不

低于 25% 的部分归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	717.71
指数使用费	218,310.72
合计	318,207.38

#### 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
兴业银行股份有限公司	基金托管人
西部证券股份有限公司	基金管理人的股东
利得科技有限公司	基金管理人的股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间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 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
当期发生的基金应支付的管理费	12,118,729.96	12,734,156.83
其中：支付销售机构的客户维护费	3,014,075.47	2,728,653.75

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 1.00% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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
当期发生的基金应支付的托管费	2,423,745.95	2,546,831.34

注：支付基金托管人兴业银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.2% 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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.2\% / \text{当年天数}。$$

#### 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		
	西部利得中证 500 指数 增强 A	西部利得中证 500 指数 增强 C	合计
西部利得基金	-	107,212.13	107,212.13
西部证券	-	1,138.15	1,138.15
兴业银行	-	-	-
合计	-	108,350.28	108,350.28
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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 500 指数 增强 A	西部利得中证 500 指数 增强 C	合计
西部利得基金	-	327,330.43	327,330.43
西部证券	-	1,721.41	1,721.41
兴业银行	-	-	-
合计	-	329,051.84	329,051.84

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 0.40% 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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

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

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

## 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## 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
兴业银行股份有限公司	216,217,872.83	352,368.96	294,326,033.88	489,701.19

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

2. 本基金通过“兴业银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2023年6月30日的相关余额为人民币6,156,193.57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	6个月	锁定期	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-



		日								
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	锁定期	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
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	海森药业	2023年3月30日	6个月	锁定期	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
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	-
002653	海思科	2023年4月27日	6个月	限售期股票	23.70	22.50	500,000	11,850,000.00	11,250,000.00	-
300070	碧水源	2023年2月7日	6个月	限售期股票	4.51	5.26	970,000	4,374,700.00	5,102,200.00	-
300682	朗新科技	2023年2月10日	6个月	限售期股	25.11	22.66	490,000	12,303,900.00	11,103,400.00	-

		日		票						
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	931	46,550.00	28,591.01	-

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	-
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	97	0.00	2,434.70	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	1,058	28,354.40	23,614.56	-
301305	朗坤	2023年5	6个月	锁定	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-

	环境	月 15 日		期						
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	绿通科技	2023 年 2 月 27 日	6 个月	锁定期	131.11	53.24	261	34,219.71	13,895.64	-
301322	绿通科技	2023 年 05 月 25 日	6 个月	锁定期	0.00	53.24	131	0.00	6,974.44	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	266	19,537.70	12,406.24	-
301355	南	2023	6 个月	锁	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-

	王科技	年6月2日		定期							
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	2,023	48,086.71	86,766.47	-	
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	-	
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	锁定期	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-	
301386	未来电器	2023年3月21日	6个月	锁定期	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-	
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	2023年5月	6个月	锁定期	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-	

	技	16 日									
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	949	18,970.51	16,038.10	-	
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	-	
601065	江盐集	2023 年 3 月	6 个月	锁定期	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-	

	团	31 日								
601133	柏 诚 股 份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	锁 定 期	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
603125	常 青 科 技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	锁 定 期	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
603135	中 重 科 技	2023 年 3 月 29 日	6 个月	锁 定 期	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
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	1,011	36,547.65	38,549.43	-
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	顾 中 科 技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	锁 定 期	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688429	时 创 能	2023 年 6 月	6 个月	锁 定 期	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-

	源	20 日								
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	锁定期	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	锁定期	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	锁定期	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-
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	150	36,834.00	18,316.50	-
688507	索辰科技	2023 年 06 月 20 日	6 个月	锁定期	0.00	122.11	72	0.00	8,791.92	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	-
688523	航天环宇	2023 年 5 月 26	6 个月	锁定期	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-



		日								
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月	锁定期	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
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	-
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	锁定期	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	锁定期	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	锁定期	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
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	-
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	178	22,406.64	15,448.62	-
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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600719	ST 热电	2023年6月21日	重大事项停牌	4.85	2023年7月5日	5.34	194,100	976,343.00	941,385.00	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

本基金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、组合在短期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	216,217,872.83	-	-	-	216,217,872.83
结算备付金	21,259,728.74	-	-	-	21,259,728.74
存出保证金	6,353,871.56	-	-	-	6,353,871.56
交易性金融资产	-	-	-	-2,367,662,919.41	2,367,662,919.41
应收申购款	-	-	-	3,057,903.95	3,057,903.95
其他资产	-	-	-	370.00	370.00
资产总计	243,831,473.13	-	-	-2,370,721,193.36	2,614,552,666.49
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,007,040.58	6,007,040.58
应付管理人报酬	-	-	-	2,056,688.89	2,056,688.89
应付托管费	-	-	-	411,337.74	411,337.74
应付清算款	-	-	-	40,085,046.77	40,085,046.77
应付销售服务费	-	-	-	225,332.44	225,332.44
其他负债	-	-	-	4,628,263.29	4,628,263.29
负债总计	-	-	-	53,413,709.71	53,413,709.71
利率敏感度缺口	243,831,473.13	-	-	-2,317,307,483.65	2,561,138,956.78
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
资产					
银行存款	190,877,279.06	-	-	-	190,877,279.06
结算备付金	49,387,493.18	-	-	-	49,387,493.18
存出保证金	11,824,631.38	-	-	-	11,824,631.38
交易性金融资产	-	-	-	-2,092,800,561.30	2,092,800,561.30
应收申购款	-	-	-	3,260,611.42	3,260,611.42
应收清算款	-	-	-	1,249,055.71	1,249,055.71
其他资产	-	-	-	370.00	370.00
资产总计	252,089,403.62	-	-	-2,097,310,598.43	2,349,400,002.05
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,176,260.08	3,176,260.08
应付管理人报酬	-	-	-	2,020,046.85	2,020,046.85
应付托管费	-	-	-	404,009.34	404,009.34
应付清算款	-	-	-	19,856,395.55	19,856,395.55
应付销售服务费	-	-	-	185,230.00	185,230.00
其他负债	-	-	-	4,860,794.57	4,860,794.57
负债总计	-	-	-	30,502,736.39	30,502,736.39
利率敏感度缺口	252,089,403.62	-	-	-2,066,807,862.04	2,318,897,265.66

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	2,367,662,919.41	92.45	2,092,800,561.30	90.25
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	2,367,662,919.41	92.45	2,092,800,561.30	90.25

##### 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）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准上升5%的影响金额	128,676,000.00	117,462,000.00
业绩比较基准下降5%的影响金额	-128,676,000.00	-117,462,000.00	

## 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	2,325,132,853.31	2,063,687,443.29
第二层次	1,806,819.18	-
第三层次	40,723,246.92	29,113,118.01
合计	2,367,662,919.41	2,092,800,561.30

#### 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	2,367,662,919.41	90.56
	其中：股票	2,367,662,919.41	90.56
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	237,477,601.57	9.08
8	其他各项资产	9,412,145.51	0.36
9	合计	2,614,552,666.49	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	49,343,833.00	1.93
B	采矿业	66,954,517.00	2.61
C	制造业	1,221,206,245.22	47.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	139,123,604.62	5.43
E	建筑业	21,835,775.00	0.85
F	批发和零售业	95,297,613.00	3.72
G	交通运输、仓储和邮政业	56,148,239.00	2.19
H	住宿和餐饮业	13,079,290.00	0.51
I	信息传输、软件和信息技术服务业	89,378,711.14	3.49
J	金融业	193,560,000.03	7.56
K	房地产业	27,212,383.83	1.06
L	租赁和商务服务业	31,653,203.32	1.24
M	科学研究和技术服务业	5,950,245.46	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	21,453,187.00	0.84
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-



R	文化、体育和娱乐业	63,859,833.00	2.49
S	综合	22,886,171.30	0.89
	合计	2,118,942,851.92	82.73

### 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	3,508,093.00	0.14
B	采矿业	1,954,503.00	0.08
C	制造业	173,968,558.61	6.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,330,336.20	0.25
E	建筑业	13,038,957.15	0.51
F	批发和零售业	17,960,955.97	0.70
G	交通运输、仓储和邮政业	7,616,513.00	0.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,565,349.56	0.18
J	金融业	-	-
K	房地产业	3,948,498.00	0.15
L	租赁和商务服务业	1,612,400.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	6,470,107.48	0.25
N	水利、环境和公共设施管理业	4,786,982.07	0.19
O	居民服务、修理和其他服务业	1,023,960.00	0.04
P	教育	1,167,925.59	0.05
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	743,145.00	0.03
	合计	248,720,067.49	9.71

### 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投资。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

### 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	002600	领益智造	6,527,607	45,105,764.37	1.76
2	002299	圣农发展	1,816,700	34,789,805.00	1.36
3	600066	宇通客车	2,219,200	32,711,008.00	1.28
4	002568	百润股份	839,696	30,522,949.60	1.19
5	000997	新大陆	1,588,000	30,013,200.00	1.17
6	600516	方大炭素	4,838,700	29,999,940.00	1.17
7	603156	养元饮品	1,185,400	29,279,380.00	1.14
8	000878	云南铜业	2,518,209	27,826,209.45	1.09
9	600329	达仁堂	588,800	26,431,232.00	1.03
10	600435	北方导航	2,275,700	26,147,793.00	1.02
11	601778	晶科科技	5,265,600	26,012,064.00	1.02
12	600642	申能股份	3,679,017	25,716,328.83	1.00
13	002739	万达电影	2,013,800	25,253,052.00	0.99
14	000729	燕京啤酒	1,963,495	24,484,782.65	0.96
15	002223	鱼跃医疗	664,900	23,929,751.00	0.93
16	300144	宋城演艺	1,923,500	23,851,400.00	0.93
17	688006	杭可科技	726,190	22,127,009.30	0.86
18	000937	冀中能源	3,456,400	22,051,832.00	0.86
19	000537	广宇发展	1,871,249	21,837,475.83	0.85
20	000027	深圳能源	3,281,516	21,625,190.44	0.84
21	600827	百联股份	1,546,700	20,679,379.00	0.81
22	688772	珠海冠宇	1,018,268	20,518,100.20	0.80
23	688819	天能股份	555,400	20,460,936.00	0.80
24	603225	新凤鸣	1,807,191	19,969,460.55	0.78
25	002249	大洋电机	3,409,600	19,434,720.00	0.76
26	603317	天味食品	1,248,810	18,245,114.10	0.71
27	601139	深圳燃气	2,484,600	18,112,734.00	0.71
28	300058	蓝色光标	1,841,596	17,808,233.32	0.70
29	600398	海澜之家	2,581,300	17,759,344.00	0.69
30	002926	华西证券	2,103,400	17,479,254.00	0.68
31	300866	安克创新	198,500	17,368,750.00	0.68
32	600699	均胜电子	973,000	17,163,720.00	0.67
33	603233	大参林	612,100	17,144,921.00	0.67
34	600316	洪都航空	728,400	17,080,980.00	0.67
35	600801	华新水泥	1,354,460	16,727,581.00	0.65
36	600673	东阳光	2,316,595	16,702,649.95	0.65
37	601958	金钼股份	1,473,500	16,429,525.00	0.64
38	603056	德邦股份	1,063,800	16,403,796.00	0.64
39	000089	深圳机场	2,351,900	16,345,705.00	0.64
40	600271	航天信息	1,190,700	16,300,683.00	0.64
41	600623	华谊集团	2,612,700	16,277,121.00	0.64
42	600109	国金证券	1,831,600	15,879,972.00	0.62
43	000728	国元证券	2,408,068	15,700,603.36	0.61

44	603939	益丰药房	403,220	14,919,140.00	0.58
45	601608	中信重工	3,536,100	14,886,981.00	0.58
46	600927	永安期货	913,200	14,848,632.00	0.58
47	601717	郑煤机	1,184,681	14,749,278.45	0.58
48	600487	亨通光电	1,001,000	14,674,660.00	0.57
49	603707	健友股份	1,079,400	14,571,900.00	0.57
50	002353	杰瑞股份	576,100	14,477,393.00	0.57
51	300136	信维通信	717,710	14,411,616.80	0.56
52	002078	太阳纸业	1,346,300	14,391,947.00	0.56
53	600707	彩虹股份	3,011,084	14,332,759.84	0.56
54	002508	老板电器	563,590	14,253,191.10	0.56
55	603885	吉祥航空	909,700	14,036,671.00	0.55
56	002183	怡亚通	2,714,700	13,844,970.00	0.54
57	601128	常熟银行	2,022,100	13,790,722.00	0.54
58	000967	盈峰环境	2,723,900	13,755,695.00	0.54
59	688777	中控技术	217,863	13,677,439.14	0.53
60	603218	日月股份	711,200	13,505,688.00	0.53
61	600820	隧道股份	2,207,300	13,265,873.00	0.52
62	603529	爱玛科技	409,350	13,189,257.00	0.51
63	688185	康希诺	161,271	13,143,586.50	0.51
64	300251	光线传媒	1,619,900	13,104,991.00	0.51
65	600258	首旅酒店	690,200	13,079,290.00	0.51
66	002268	电科网安	463,600	12,920,532.00	0.50
67	600655	豫园股份	1,883,400	12,920,124.00	0.50
68	002831	裕同科技	526,502	12,841,383.78	0.50
69	600737	中粮糖业	1,573,800	12,669,090.00	0.49
70	000400	许继电气	547,520	12,620,336.00	0.49
71	002531	天顺风能	827,200	12,598,256.00	0.49
72	688072	拓荆科技	31,500	12,105,450.00	0.47
73	600143	金发科技	1,344,800	11,740,104.00	0.46
74	600517	国网英大	2,025,000	11,542,500.00	0.45
75	603858	步长制药	559,700	11,524,223.00	0.45
76	601969	海南矿业	1,714,100	11,278,778.00	0.44
77	002653	海思科	500,000	11,250,000.00	0.44
78	600095	湘财股份	1,425,000	11,115,000.00	0.43
79	300682	朗新科技	490,000	11,103,400.00	0.43
80	000783	长江证券	1,893,800	10,984,040.00	0.43
81	000559	万向钱潮	2,001,800	10,909,810.00	0.43
82	002110	三钢闽光	2,577,600	10,877,472.00	0.42
83	688390	固德威	64,368	10,740,444.48	0.42
84	002572	索菲亚	601,200	10,472,904.00	0.41
85	300115	长盈精密	878,800	10,466,508.00	0.41
86	600126	杭钢股份	2,395,700	10,397,338.00	0.41

87	600161	天坛生物	382,100	10,374,015.00	0.41
88	601869	长飞光纤	279,312	10,337,337.12	0.40
89	600038	中直股份	259,324	10,326,281.68	0.40
90	000636	风华高科	672,400	10,314,616.00	0.40
91	600259	广晟有色	285,200	10,307,128.00	0.40
92	600909	华安证券	2,194,789	10,249,664.63	0.40
93	002745	木林森	1,112,000	10,230,400.00	0.40
94	603883	老百姓	339,500	10,134,075.00	0.40
95	600060	海信视像	407,375	10,082,531.25	0.39
96	600885	宏发股份	315,200	10,039,120.00	0.39
97	603688	石英股份	87,600	9,972,384.00	0.39
98	002939	长城证券	1,225,900	9,966,567.00	0.39
99	603786	科博达	150,400	9,881,280.00	0.39
100	002273	水晶光电	825,800	9,860,052.00	0.38
101	002056	横店东磁	540,100	9,835,221.00	0.38
102	002422	科伦药业	324,300	9,625,224.00	0.38
103	688082	盛美上海	86,262	9,523,324.80	0.37
104	001872	招商港口	542,100	9,362,067.00	0.37
105	300474	景嘉微	103,451	9,309,555.49	0.36
106	688002	睿创微纳	207,404	9,291,699.20	0.36
107	600998	九州通	886,550	9,202,389.00	0.36
108	000581	威孚高科	567,000	8,930,250.00	0.35
109	688099	晶晨股份	105,900	8,929,488.00	0.35
110	300888	稳健医疗	212,650	8,861,125.50	0.35
111	000998	隆平高科	569,000	8,734,150.00	0.34
112	002156	通富微电	386,000	8,723,600.00	0.34
113	002081	金螳螂	1,900,200	8,569,902.00	0.33
114	002250	联化科技	790,300	8,266,538.00	0.32
115	000060	中金岭南	1,705,800	8,102,550.00	0.32
116	688029	南微医学	97,348	7,939,702.88	0.31
117	601966	玲珑轮胎	347,100	7,712,562.00	0.30
118	002409	雅克科技	103,600	7,550,368.00	0.29
119	688256	寒武纪	39,019	7,335,572.00	0.29
120	300604	长川科技	152,400	7,237,476.00	0.28
121	600339	中油工程	1,692,200	6,887,254.00	0.27
122	002608	江苏国信	907,100	6,866,747.00	0.27
123	600378	昊华科技	180,600	6,797,784.00	0.27
124	002670	国盛金控	762,518	6,694,908.04	0.26
125	601233	桐昆股份	492,800	6,529,600.00	0.25
126	002625	光启技术	416,500	6,355,790.00	0.25
127	601179	中国西电	1,170,500	6,332,405.00	0.25
128	600062	华润双鹤	362,500	6,314,750.00	0.25
129	000887	中鼎股份	482,100	6,310,689.00	0.25

130	002797	第一创业	1,097,100	6,275,412.00	0.25
131	600166	福田汽车	1,845,100	6,273,340.00	0.24
132	000623	吉林敖东	391,100	6,273,244.00	0.24
133	600032	浙江新能	497,100	6,243,576.00	0.24
134	601198	东兴证券	775,500	6,219,510.00	0.24
135	600390	五矿资本	1,155,500	6,216,590.00	0.24
136	601108	财通证券	858,000	6,211,920.00	0.24
137	600906	财达证券	862,700	6,211,440.00	0.24
138	601991	大唐发电	1,873,967	6,202,830.77	0.24
139	600995	南网储能	561,700	6,184,317.00	0.24
140	000009	中国宝安	512,305	6,183,521.35	0.24
141	600027	华电国际	923,400	6,177,546.00	0.24
142	600418	江淮汽车	490,300	6,172,877.00	0.24
143	600021	上海电力	571,054	6,150,251.58	0.24
144	600863	内蒙华电	1,481,200	6,146,980.00	0.24
145	002500	山西证券	1,097,100	6,121,818.00	0.24
146	600056	中国医药	471,000	6,113,580.00	0.24
147	603596	伯特利	77,100	6,110,946.00	0.24
148	601555	东吴证券	879,500	6,103,730.00	0.24
149	601136	首创证券	422,600	5,988,242.00	0.23
150	000987	越秀资本	938,500	5,959,475.00	0.23
151	688105	诺唯赞	195,154	5,950,245.46	0.23
152	600598	北大荒	436,600	5,819,878.00	0.23
153	300009	安科生物	570,300	5,703,000.00	0.22
154	000012	南玻 A	952,800	5,678,688.00	0.22
155	002203	海亮股份	467,300	5,612,273.00	0.22
156	603000	人民网	184,900	5,399,080.00	0.21
157	002244	滨江集团	609,400	5,374,908.00	0.21
158	603866	桃李面包	520,700	5,269,484.00	0.21
159	000703	恒逸石化	757,900	5,138,562.00	0.20
160	301029	怡合达	114,970	5,136,859.60	0.20
161	300070	碧水源	970,000	5,102,200.00	0.20
162	600507	方大特钢	1,020,600	4,725,378.00	0.18
163	603160	汇顶科技	99,800	4,615,750.00	0.18
164	688200	华峰测控	28,900	4,421,700.00	0.17
165	603893	瑞芯微	59,700	4,349,145.00	0.17
166	002221	东华能源	483,700	4,184,005.00	0.16
167	300257	开山股份	269,909	4,094,519.53	0.16
168	300373	扬杰科技	95,300	3,866,321.00	0.15
169	603868	飞科电器	60,000	3,785,400.00	0.15
170	600167	联美控股	528,700	3,685,039.00	0.14
171	002408	齐翔腾达	463,000	2,949,310.00	0.12
172	002266	浙富控股	628,400	2,595,292.00	0.10

173	688107	安路科技	43,100	2,387,309.00	0.09
174	000156	华数传媒	189,700	1,650,390.00	0.06

### 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	603042	华脉科技	124,400	3,129,904.00	0.12
2	002209	达意隆	214,600	2,199,650.00	0.09
3	300807	天迈科技	53,700	1,570,725.00	0.06
4	301079	邵阳液压	71,500	1,524,380.00	0.06
5	001209	洪兴股份	85,100	1,515,631.00	0.06
6	002199	东晶电子	172,700	1,469,677.00	0.06
7	300749	顶固集创	157,600	1,448,344.00	0.06
8	603038	华立股份	159,600	1,404,480.00	0.05
9	300717	华信新材	81,300	1,386,165.00	0.05
10	002780	三夫户外	101,000	1,373,600.00	0.05
11	002820	桂发祥	120,300	1,364,202.00	0.05
12	300074	华平股份	316,300	1,363,253.00	0.05
13	300030	阳普医疗	181,600	1,356,552.00	0.05
14	300535	达威股份	92,600	1,348,256.00	0.05
15	300780	德恩精工	74,300	1,338,886.00	0.05
16	301098	金埔园林	111,000	1,337,550.00	0.05
17	600243	青海华鼎	299,800	1,328,114.00	0.05
18	002921	联诚精密	73,400	1,321,934.00	0.05
19	002861	瀛通通讯	114,600	1,311,024.00	0.05
20	002357	富临运业	191,000	1,283,520.00	0.05
21	301007	德迈仕	80,600	1,243,658.00	0.05
22	000856	冀东装备	141,800	1,230,824.00	0.05
23	300743	天地数码	77,600	1,219,872.00	0.05
24	603161	科华控股	83,600	1,218,052.00	0.05
25	002718	友邦吊顶	80,300	1,217,348.00	0.05
26	000590	启迪药业	138,900	1,211,208.00	0.05
27	600493	凤竹纺织	214,700	1,202,320.00	0.05
28	600137	浪莎股份	62,500	1,198,750.00	0.05
29	603389	亚振家居	224,600	1,194,872.00	0.05
30	603900	莱绅通灵	189,200	1,188,176.00	0.05
31	600455	博通股份	51,701	1,167,925.59	0.05
32	600128	弘业股份	142,000	1,167,240.00	0.05
33	300462	华铭智能	99,000	1,162,260.00	0.05
34	002836	新宏泽	141,480	1,153,062.00	0.05
35	002862	实丰文化	61,000	1,149,240.00	0.04
36	300703	创源股份	120,700	1,149,064.00	0.04
37	603286	日盈电子	58,100	1,147,475.00	0.04
38	300851	交大思诺	42,500	1,144,950.00	0.04

39	600889	南京化纤	241,300	1,136,523.00	0.04
40	300254	仟源医药	153,800	1,135,044.00	0.04
41	300707	威唐工业	72,600	1,134,738.00	0.04
42	002910	庄园牧场	102,500	1,127,500.00	0.04
43	002715	登云股份	76,400	1,122,316.00	0.04
44	002806	华锋股份	87,400	1,118,720.00	0.04
45	002893	京能热力	103,300	1,112,541.00	0.04
46	600148	长春一东	66,500	1,110,550.00	0.04
47	600099	林海股份	117,900	1,103,544.00	0.04
48	002963	豪尔赛	75,300	1,095,615.00	0.04
49	300611	美力科技	113,300	1,092,212.00	0.04
50	603657	春光科技	62,200	1,091,610.00	0.04
51	603320	迪贝电气	75,000	1,090,500.00	0.04
52	603798	康普顿	107,250	1,089,660.00	0.04
53	301113	雅艺科技	37,800	1,089,018.00	0.04
54	301163	宏德股份	34,500	1,088,475.00	0.04
55	002899	英派斯	72,400	1,083,828.00	0.04
56	603023	威帝股份	265,400	1,082,832.00	0.04
57	300652	雷迪克	47,100	1,072,467.00	0.04
58	301043	绿岛风	33,400	1,067,798.00	0.04
59	002931	锋龙股份	81,600	1,064,880.00	0.04
60	301131	聚赛龙	26,500	1,064,770.00	0.04
61	603709	中源家居	58,600	1,063,004.00	0.04
62	600192	长城电工	182,500	1,056,675.00	0.04
63	002767	先锋电子	75,400	1,053,338.00	0.04
64	300823	建科机械	51,100	1,050,105.00	0.04
65	600202	哈空调	186,400	1,041,976.00	0.04
66	600302	标准股份	197,300	1,039,771.00	0.04
67	300816	艾可蓝	35,200	1,039,456.00	0.04
68	600689	上海三毛	111,100	1,038,785.00	0.04
69	300281	金明精机	193,800	1,038,768.00	0.04
70	603238	诺邦股份	82,300	1,037,803.00	0.04
71	603090	宏盛股份	46,600	1,036,850.00	0.04
72	603725	天安新材	127,300	1,034,949.00	0.04
73	000702	正虹科技	188,200	1,031,336.00	0.04
74	600250	南纺股份	166,000	1,030,860.00	0.04
75	001210	金房能源	45,720	1,026,871.20	0.04
76	003001	中岩大地	62,600	1,025,388.00	0.04
77	300665	飞鹿股份	117,900	1,024,551.00	0.04
78	300736	百邦科技	84,000	1,023,960.00	0.04
79	002998	优彩资源	143,600	1,019,560.00	0.04
80	605180	华生科技	82,110	1,015,700.70	0.04
81	002811	郑中设计	128,000	1,015,040.00	0.04

82	002787	华源控股	139,900	1,014,275.00	0.04
83	301070	开勒股份	27,100	1,013,540.00	0.04
84	603580	艾艾精工	71,200	1,013,176.00	0.04
85	301042	安联锐视	29,800	1,011,710.00	0.04
86	600355	精伦电子	292,300	1,011,358.00	0.04
87	300836	佰奥智能	33,800	1,009,944.00	0.04
88	600630	龙头股份	176,500	1,009,580.00	0.04
89	002696	百洋股份	161,700	1,009,008.00	0.04
90	301167	建研设计	57,000	1,008,900.00	0.04
91	001296	长江材料	47,900	1,006,379.00	0.04
92	600356	恒丰纸业	128,300	1,004,589.00	0.04
93	300594	朗进科技	38,900	1,002,842.00	0.04
94	002898	赛隆药业	88,400	1,000,688.00	0.04
95	000593	德龙汇能	147,900	999,804.00	0.04
96	300562	乐心医疗	101,800	997,640.00	0.04
97	603860	中公高科	34,900	997,442.00	0.04
98	301053	远信工业	39,300	997,041.00	0.04
99	002105	信隆健康	167,500	996,625.00	0.04
100	300564	筑博设计	74,700	996,498.00	0.04
101	603045	福达合金	65,700	994,698.00	0.04
102	603332	苏州龙杰	91,000	994,630.00	0.04
103	301040	中环海陆	48,400	994,620.00	0.04
104	603041	美思德	82,700	994,054.00	0.04
105	600793	宜宾纸业	80,800	993,032.00	0.04
106	300854	中兰环保	62,400	992,160.00	0.04
107	000638	万方发展	164,400	991,332.00	0.04
108	600539	狮头股份	148,400	991,312.00	0.04
109	600883	博闻科技	130,600	991,254.00	0.04
110	600538	国发股份	234,800	990,856.00	0.04
111	002828	贝肯能源	120,400	989,688.00	0.04
112	600768	宁波富邦	91,000	987,350.00	0.04
113	003017	大洋生物	29,300	985,945.00	0.04
114	603316	诚邦股份	160,500	985,470.00	0.04
115	300746	汉嘉设计	91,900	985,168.00	0.04
116	301003	江苏博云	42,600	984,486.00	0.04
117	002883	中设股份	83,500	984,465.00	0.04
118	600753	东方银星	107,400	983,784.00	0.04
119	603637	镇海股份	119,200	983,400.00	0.04
120	600272	开开实业	108,700	981,561.00	0.04
121	300640	德艺文创	163,300	981,433.00	0.04
122	300321	同大股份	60,300	981,081.00	0.04
123	300106	西部牧业	121,900	978,857.00	0.04
124	000929	兰州黄河	99,900	977,022.00	0.04



125	301010	晶雪节能	48,148	976,922.92	0.04
126	002826	易明医药	88,700	976,587.00	0.04
127	603506	南都物业	82,300	973,609.00	0.04
128	600319	亚星化学	193,800	972,876.00	0.04
129	605258	协和电子	37,400	971,652.00	0.04
130	600593	大连圣亚	59,300	971,334.00	0.04
131	600083	博信股份	136,800	969,912.00	0.04
132	600051	宁波联合	133,000	968,240.00	0.04
133	000632	三木集团	228,800	967,824.00	0.04
134	300240	飞力达	156,300	965,934.00	0.04
135	002207	准油股份	147,300	964,815.00	0.04
136	301178	天亿马	29,900	963,677.00	0.04
137	002492	恒基达鑫	167,500	963,125.00	0.04
138	603717	天域生态	141,700	962,143.00	0.04
139	603036	如通股份	90,900	961,722.00	0.04
140	301130	西点药业	34,900	959,052.00	0.04
141	603499	翔港科技	100,500	958,770.00	0.04
142	000619	海螺新材	157,000	957,700.00	0.04
143	300753	爱朋医疗	52,200	956,826.00	0.04
144	001202	炬申股份	64,800	956,448.00	0.04
145	002620	瑞和股份	183,900	956,280.00	0.04
146	002205	国统股份	90,300	956,277.00	0.04
147	603696	安记食品	101,200	955,328.00	0.04
148	603183	建研院	200,800	947,776.00	0.04
149	600719	ST 热电	194,100	941,385.00	0.04
150	600778	友好集团	138,300	940,440.00	0.04
151	002981	朝阳科技	38,900	937,490.00	0.04
152	600791	京能置业	204,200	937,278.00	0.04
153	002144	宏达高科	83,600	935,484.00	0.04
154	603089	正裕工业	105,200	935,228.00	0.04
155	603536	惠发食品	144,300	929,292.00	0.04
156	300621	维业股份	92,800	928,928.00	0.04
157	300329	海伦钢琴	131,300	928,291.00	0.04
158	301065	本立科技	44,700	924,843.00	0.04
159	002691	冀凯股份	146,200	913,750.00	0.04
160	600193	创兴资源	173,900	912,975.00	0.04
161	600235	民丰特纸	168,000	910,560.00	0.04
162	301057	汇隆新材	52,600	906,824.00	0.04
163	600712	南宁百货	244,400	906,724.00	0.04
164	603616	韩建河山	173,500	902,200.00	0.04
165	003041	真爱美家	56,568	897,168.48	0.04
166	600082	海泰发展	283,800	893,970.00	0.03
167	600234	科新发展	148,400	891,884.00	0.03

168	600506	香梨股份	84,800	891,248.00	0.03
169	000985	大庆华科	54,900	889,380.00	0.03
170	002778	中晟高科	61,000	885,720.00	0.03
171	003003	天元股份	83,500	883,430.00	0.03
172	600678	四川金顶	165,200	882,168.00	0.03
173	002830	名雕股份	68,600	878,766.00	0.03
174	603716	塞力医疗	92,800	875,104.00	0.03
175	301107	瑜欣电子	25,000	866,500.00	0.03
176	002802	洪汇新材	78,000	862,680.00	0.03
177	603226	菲林格尔	167,800	855,780.00	0.03
178	000608	阳光股份	314,900	853,379.00	0.03
179	001234	泰慕士	37,100	845,880.00	0.03
180	600156	华升股份	191,700	843,480.00	0.03
181	600615	丰华股份	96,000	841,920.00	0.03
182	300658	延江股份	126,480	828,444.00	0.03
183	603178	圣龙股份	67,000	825,440.00	0.03
184	002682	龙洲股份	201,000	820,080.00	0.03
185	301037	保立佳	45,900	817,938.00	0.03
186	301081	严牌股份	81,540	811,323.00	0.03
187	600107	美尔雅	150,400	807,648.00	0.03
188	603214	爱婴室	49,600	806,992.00	0.03
189	603080	新疆火炬	56,800	805,992.00	0.03
190	600444	国机通用	58,400	801,832.00	0.03
191	600448	华纺股份	268,700	798,039.00	0.03
192	600561	江西长运	151,400	797,878.00	0.03
193	600857	宁波中百	80,500	796,950.00	0.03
194	301023	江南奕帆	17,100	794,295.00	0.03
195	300610	晨化股份	68,200	791,802.00	0.03
196	603021	山东华鹏	153,400	783,874.00	0.03
197	603037	凯众股份	56,680	774,815.60	0.03
198	000605	渤海股份	121,300	766,616.00	0.03
199	300819	聚杰微纤	55,600	762,276.00	0.03
200	301016	雷尔伟	37,600	754,256.00	0.03
201	000609	中迪投资	154,500	743,145.00	0.03
202	600692	亚通股份	132,400	738,792.00	0.03
203	300694	蠡湖股份	69,200	735,596.00	0.03
204	600281	华阳新材	180,900	732,645.00	0.03
205	605081	太和水	49,200	732,588.00	0.03
206	301055	张小泉	51,300	729,999.00	0.03
207	603022	新通联	77,400	728,334.00	0.03
208	603188	亚邦股份	206,600	718,968.00	0.03
209	605318	法狮龙	51,800	717,948.00	0.03
210	603879	永悦科技	105,300	713,934.00	0.03

211	000679	大连友谊	143,700	708,441.00	0.03
212	600697	欧亚集团	57,500	707,825.00	0.03
213	002278	神开股份	131,500	700,895.00	0.03
214	600119	长江投资	118,800	699,732.00	0.03
215	002494	华斯股份	151,100	699,593.00	0.03
216	605255	天普股份	44,000	695,200.00	0.03
217	301259	艾布鲁	51,450	692,002.50	0.03
218	603608	天创时尚	146,000	677,440.00	0.03
219	600149	廊坊发展	120,700	677,127.00	0.03
220	603828	柯利达	223,400	665,732.00	0.03
221	603329	上海雅仕	50,200	665,150.00	0.03
222	603150	万朗磁塑	25,000	659,000.00	0.03
223	603079	圣达生物	51,400	658,434.00	0.03
224	600287	江苏舜天	127,000	648,970.00	0.03
225	603356	华菱精工	45,100	635,910.00	0.02
226	300243	瑞丰高材	71,700	630,960.00	0.02
227	600097	开创国际	66,000	628,980.00	0.02
228	300169	天晟新材	150,000	627,000.00	0.02
229	603729	龙韵股份	41,600	621,088.00	0.02
230	300176	派生科技	100,000	616,000.00	0.02
231	603822	嘉澳环保	18,800	611,940.00	0.02
232	600232	金鹰股份	111,100	606,606.00	0.02
233	603726	朗迪集团	47,800	605,148.00	0.02
234	300126	锐奇股份	92,300	599,027.00	0.02
235	603321	梅轮电梯	74,300	578,797.00	0.02
236	603615	茶花股份	60,300	569,232.00	0.02
237	600847	万里股份	46,400	566,544.00	0.02
238	300218	安利股份	59,900	564,258.00	0.02
239	603928	兴业股份	46,400	560,048.00	0.02
240	603958	哈森股份	72,500	556,075.00	0.02
241	603139	康惠制药	33,400	547,092.00	0.02
242	600721	百花医药	80,400	535,464.00	0.02
243	002775	文科园林	139,400	522,750.00	0.02
244	002890	弘宇股份	34,720	512,814.40	0.02
245	300720	海川智能	39,500	499,675.00	0.02
246	605003	众望布艺	25,600	492,288.00	0.02
247	605155	西大门	33,300	483,183.00	0.02
248	605178	时空科技	20,800	467,584.00	0.02
249	603813	原尚股份	32,200	464,646.00	0.02
250	600802	福建水泥	93,600	461,448.00	0.02
251	603221	爱丽家居	57,400	445,998.00	0.02
252	000668	荣丰控股	38,400	445,440.00	0.02
253	001211	双枪科技	19,500	427,635.00	0.02

254	603488	展鹏科技	52,600	422,378.00	0.02
255	603159	上海亚虹	28,600	420,706.00	0.02
256	603926	铁流股份	40,500	414,315.00	0.02
257	301056	森赫股份	43,900	402,124.00	0.02
258	301182	凯旺科技	17,500	401,975.00	0.02
259	605298	必得科技	24,100	384,636.00	0.02
260	300385	雪浪环境	59,700	365,364.00	0.01
261	603272	联翔股份	21,300	361,248.00	0.01
262	603838	四通股份	63,900	359,757.00	0.01
263	605069	正和生态	38,500	336,875.00	0.01
264	002134	天津普林	31,600	323,584.00	0.01
265	603048	浙江黎明	20,000	322,000.00	0.01
266	605303	园林股份	26,200	290,820.00	0.01
267	300283	温州宏丰	48,700	287,330.00	0.01
268	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.01
269	603059	倍加洁	10,400	236,496.00	0.01
270	301022	海泰科	6,940	175,929.00	0.01
271	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.01
272	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.00
273	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.00
274	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.00
275	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
276	301063	海锅股份	3,000	83,580.00	0.00
277	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
278	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
279	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
280	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
281	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
282	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
283	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
284	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
285	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
286	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
287	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
288	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
289	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
290	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
291	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
292	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00
293	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
294	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
295	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
296	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00

297	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
298	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
299	688623	二元科技	178	15,448.62	0.00
300	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
301	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
302	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
303	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
304	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
305	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
306	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
307	301210	金杨股份	281	13,816.77	0.00
308	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
309	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
310	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
311	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
312	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
313	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
314	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
315	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
316	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
317	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
318	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
319	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
320	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
321	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
322	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
323	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
324	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
325	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
326	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
327	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
328	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
329	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
330	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
331	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
332	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
333	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
334	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
335	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
336	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
337	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
338	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
339	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00

340	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
341	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
342	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
343	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
344	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
345	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
346	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
347	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	600066	宇通客车	83,484,718.30	3.60
2	603688	石英股份	71,990,432.70	3.10
3	601958	金钼股份	70,452,313.62	3.04
4	002568	百润股份	62,752,218.59	2.71
5	000997	新大陆	57,937,284.44	2.50
6	002299	圣农发展	57,459,596.00	2.48
7	600038	中直股份	56,709,700.89	2.45
8	603605	珀莱雅	52,304,887.69	2.26
9	002434	万里扬	51,789,771.00	2.23
10	000729	燕京啤酒	50,560,450.35	2.18
11	601333	广深铁路	50,264,644.00	2.17
12	688006	杭可科技	49,902,899.39	2.15
13	600153	建发股份	49,526,965.00	2.14
14	002603	以岭药业	48,443,011.24	2.09
15	600026	中远海能	47,752,998.00	2.06
16	600166	福田汽车	47,298,759.00	2.04
17	300604	长川科技	46,230,901.68	1.99
18	688390	固德威	45,391,321.47	1.96
19	300888	稳健医疗	45,160,908.54	1.95
20	300058	蓝色光标	45,101,536.40	1.94

注：本表“本期累计买入金额”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。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300115	长盈精密	81,044,003.56	3.49
2	601958	金钼股份	73,842,797.41	3.18

3	600021	上海电力	66,374,389.10	2.86
4	601869	长飞光纤	64,867,084.34	2.80
5	002273	水晶光电	60,205,447.38	2.60
6	603688	石英股份	59,475,600.88	2.56
7	002294	信立泰	57,248,174.95	2.47
8	603605	珀莱雅	57,232,101.55	2.47
9	300017	网宿科技	57,087,681.76	2.46
10	600066	宇通客车	56,396,931.00	2.43
11	600566	济川药业	56,216,828.26	2.42
12	603317	天味食品	55,769,225.83	2.40
13	601699	潞安环能	55,504,809.97	2.39
14	300073	当升科技	54,322,339.07	2.34
15	600598	北大荒	53,729,851.00	2.32
16	002831	裕同科技	53,547,735.00	2.31
17	002434	万里扬	52,271,789.58	2.25
18	600026	中远海能	51,098,152.08	2.20
19	000729	燕京啤酒	51,059,220.95	2.20
20	601333	广深铁路	50,721,486.00	2.19
21	601128	常熟银行	49,347,236.96	2.13
22	600153	建发股份	47,474,888.00	2.05
23	300308	中际旭创	47,068,239.12	2.03
24	002603	以岭药业	46,711,726.76	2.01

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	7,295,466,663.65
卖出股票收入（成交）总额	7,142,898,337.45

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金报告期末未持有债券。

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

本基金报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金于本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货不在本基金投资范围内。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

国债期货不在本基金投资范围内。

## 7.12 投资组合报告附注

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

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

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	6,353,871.56
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,057,903.95
6	其他应收款	370.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,412,145.51

### 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

本基金本报告期末指数投资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)	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 (%)
西部利得中证 500 指数增强 A	106,110	10,963.43	490,241,734.09	42.14	673,088,222.48	57.86
西部利得中证 500 指数增强 C	35,788	12,178.00	218,105,647.00	50.04	217,720,587.56	49.96
合计	138,304	11,562.62	708,347,381.09	44.30	890,808,810.04	55.70

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

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

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

西部利得中证 500 指数增强 A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	刘海桥	2,199,533.00	3.36
2	陶立永	985,800.00	1.51

3	陈法基	962,100.00	1.47
4	陈云	939,057.00	1.44
5	李红	898,430.00	1.37
6	赵文芳	821,038.00	1.26
7	郑臻	655,600.00	1.00
8	周忠坤	653,200.00	1.00
9	王峰	602,266.00	0.92
10	狄洪涛	548,601.00	0.84

### 8.3 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 500 指数增强 A	628,500.37	0.0540
	西部利得中证 500 指数增强 C	16,800.74	0.0039
	合计	645,301.11	0.0004

### 8.4 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 500 指数增强 A	0~10
	西部利得中证 500 指数增强 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	西部利得中证 500 指数增强 A	-
	西部利得中证 500 指数增强 C	-
	合计	-

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	西部利得中证 500 指数增强 A	西部利得中证 500 指数增强 C
基金合同生效日 (2020 年 2 月 19 日) 基金份额总额	357,635,043.89	-
本报告期期初基金份额总额	1,188,335,162.73	329,728,763.23
本报告期基金总申购份额	254,736,719.69	290,451,491.46
减：本报告期基金总赎回份额	279,741,925.85	184,354,020.13
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额	1,163,329,956.57	435,826,234.56

额总额		
-----	--	--

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的重大人事变动如下：

自 2023 年 4 月 11 日起，陈启女士担任基金托管人资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作，叶文煌先生不再担任基金托管人资产托管部总经理。

### 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

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未受到监管部门的稽查或处罚。

### 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 (%)	

华创证券	2	3,262,937,154.13	22.62	1,080,986.76	12.49	-
招商证券	2	2,286,896,162.52	15.85	1,672,422.26	19.33	-
民生证券	1	1,972,991,674.70	13.68	1,442,846.10	16.67	-
东吴证券	2	1,309,811,378.33	9.08	695,911.96	8.04	-
广发证券	1	1,204,615,986.67	8.35	880,929.65	10.18	-
东北证券	2	1,143,634,424.55	7.93	493,260.87	5.70	-
华金证券	3	780,304,516.67	5.41	570,640.60	6.59	-
申万宏源	2	567,543,004.03	3.93	528,966.89	6.11	-
财信证券	1	522,324,883.43	3.62	381,985.49	4.41	-
华西证券	2	501,734,181.84	3.48	266,572.43	3.08	-
中泰证券	2	357,706,993.22	2.48	297,366.39	3.44	-
平安证券	2	344,735,293.78	2.39	252,288.92	2.92	-
海通证券	1	169,167,370.69	1.17	89,877.97	1.04	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

注：1. 基金租用席位的选择标准是：（1）资历雄厚，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 (%)
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

司						
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-

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