

西部利得深证红利交易型开放式指数证券  
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：光大证券股份有限公司

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。

基金托管人光大证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	10
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>11</b>
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44

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 .....	44
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 .....	44
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 .....	44
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 .....	44
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	45
7.12 投资组合报告附注 .....	45
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>46</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	46
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	47
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 .....	47
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>47</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>47</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	47
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 .....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	47
10.4 基金投资策略的改变 .....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	47
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 .....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	48
10.8 其他重大事件 .....	48
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>49</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 .....	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	49
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>49</b>
12.1 备查文件目录 .....	49
12.2 存放地点 .....	50
12.3 查阅方式 .....	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	西部利得深证红利交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	红利 ETF
场内简称	红利 ETF
基金主代码	159708
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 6 月 18 日
基金管理人	西部利得基金管理有限公司
基金托管人	光大证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	244,028,306.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2021 年 7 月 2 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。</p> <p>在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。（详见本基金《基金合同》）</p>
业绩比较基准	深证红利指数收益率
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全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	光大证券股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	赵毅	李庆庆
	联系电话	021-38572888	021-22167432
	电子邮箱	service@westleadfund.com	gztg@ebscn.com
客户服务电话		4007-007-818	021-22167436
传真		021-50710261	021-22167424
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区耀 体路 276 号 901 室-908 室	上海市新闻路 1508 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	上海市新闻路 1508 号
邮政编码		200126	200040
法定代表人		何方	刘秋明

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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)
本期已实现收益	-4,574,415.34
本期利润	-450,593.38
加权平均基金份额本期利润	-0.0018
本期加权平均净值利润率	-0.23%
本期基金份额净值增长率	-0.79%
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	-62,147,947.09
期末可供分配基金份额利润	-0.2547
期末基金资产净值	181,880,358.91
期末基金份额净值	0.7453
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	-25.47%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要

低于所列数字。

3. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

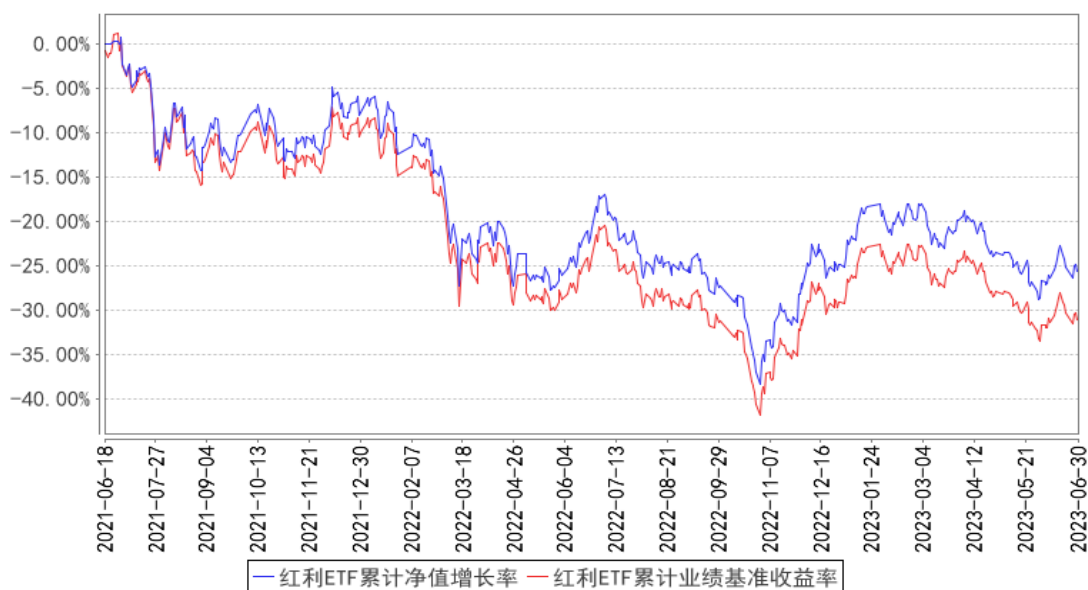
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.74%	1.12%	3.50%	1.13%	1.24%	-0.01%
过去三个月	-6.93%	0.97%	-8.48%	0.97%	1.55%	0.00%
过去六个月	-0.79%	1.05%	-2.64%	1.06%	1.85%	-0.01%
过去一年	-10.04%	1.24%	-12.99%	1.25%	2.95%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-25.47%	1.35%	-30.93%	1.37%	5.46%	-0.02%

#### 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

红利ETF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		
蔡路平	基金经理	2021 年 8 月 11 日	-	8 年	美国哥伦比亚大学统计学硕士。曾任 DIA Associates 数据分析师、南华基金管理有限公司基金经理助理、永赢基金管理有限公司基金经理助理。2021 年 6 月加入本公司，具有基金从业资格，中国国籍。
祁威	基金经理助理	2021 年 12 月 14 日	-	7 年	中北大学材料加工工程学硕士，曾任马钢股份技术中心助理工程师，宁波银行资产托管部基金会计，2017 年 5 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

回顾深证红利指数表现，报告期内指数呈震荡走势。在经济弱复苏背景下，消费表现并不乐观，高端酒受益于偏刚性需求表现稳健，次高端酒因商务影响较大表现不及预期，行业整体承压，拖累指数走势。但消费和地产是经济增长的重要引擎，随着 7 月份政策面持续加大宏观调控力度，引领内需回升和地产政策优化。稳增长、稳就业、促销费等具体政策有望快速落地，对经济改善和需求增长形成支撑。积极的财政政策和稳健的货币政策协调发力，因城施策适时调整优化房地产政策，以“消费+地产链”为核心标签的红利指数或将迎来估值修复。报告期内，本基金根据法律法规与基金合同规定的投资限制、基金申赎变动、以及成分股增发配股等权益事件，坚定执行完全复制的投资策略，力争基金净值增长率与标的指数收益率高度正相关，并努力实现跟踪误差

最小化。

#### 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

上半年国内经济恢复形势良好。分季度看，在防疫政策全面优化和去年低基数影响下，一季度市场显著回暖。进入二季度，由于国内需求恢复不足和美欧央行持续加息等外部事件的影响，经济进入复杂回升的态势。基于部分经济数据，当前宏观经济仍面临一定压力。上半年 PMI 先高后低，二季度以后逐月 PMI 持续低于荣枯线，而 M2-M1 剪刀差走阔和存款定期化的趋势也表明了实体经济需求较为疲软。进入 7 月以后，政策端加大发力为经济注入强心剂，政治局会议明确下半年稳增长信号，从加大宏观政策调控力度、积极扩大国内需求、优化调整地产政策等多方面做出了安排，往后看经济数据边际回暖预期显著，国内经济的发展韧性和潜力巨大。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

可参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

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

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人以及基金资产

净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，光大证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在西部利得深证红利交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 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：西部利得深证红利交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,472,022.96	1,211,925.21
结算备付金		3,556.02	4,269.40
存出保证金		28,101.91	51,153.37
交易性金融资产	6.4.7.2	180,490,635.47	196,941,296.72
其中：股票投资		180,490,635.47	196,941,296.72
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	79,538.36	-
资产总计		182,073,854.72	198,208,644.70
<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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		60,598.01	67,457.58
应付托管费		12,119.66	13,491.54
应付销售服务费		-	-
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	120,778.14	174,428.12
负债合计		193,495.81	255,377.24
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	244,028,306.00	263,528,306.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-62,147,947.09	-65,575,038.54
净资产合计		181,880,358.91	197,953,267.46
负债和净资产总计		182,073,854.72	198,208,644.70

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.7453 元，基金份额总额 244,028,306.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：西部利得深证红利交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		172,603.34	-23,200,082.00
1. 利息收入		11,584.12	12,022.46
其中：存款利息收入	6.4.7.13	11,584.12	10,980.91
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		-	1,041.55
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,964,788.42	-8,477,421.06
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-7,367,910.21	-11,680,821.63
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	-	-
股利收益	6.4.7.19	3,403,121.79	3,203,400.57
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	4,123,821.96	-14,726,370.64
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	1,985.68	-8,312.76
<b>减：二、营业总支出</b>		623,196.72	654,787.35
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	390,360.40	416,182.71
2. 托管费	6.4.10.2.2	78,072.12	83,236.51
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	154,764.20	155,368.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-450,593.38	-23,854,869.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-450,593.38	-23,854,869.35
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-450,593.38	-23,854,869.35

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：西部利得深证红利交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	263,528,306.00	-	-65,575,038.54	197,953,267.46
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）	263,528,306.00	-	-65,575,038.54	197,953,267.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-19,500,000.00	-	3,427,091.45	-16,072,908.55
（一）、综合收益总额	-	-	-450,593.38	-450,593.38
（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）	-19,500,000.00	-	3,877,684.83	-15,622,315.17
其中：1. 基金申购款	18,000,000.00	-	-3,982,727.30	14,017,272.70
2. 基金赎回款	-37,500,000.00	-	7,860,412.13	-29,639,587.87
（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）	244,028,306.00	-	-62,147,947.09	181,880,358.91
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）	266,528,306.00	-	-19,693,752.94	246,834,553.06
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）	266,528,306.00	-	-19,693,752.94	246,834,553.06
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-9,000,000.00	-	-24,463,436.42	-33,463,436.42
（一）、综合收益总额	-	-	-23,854,869.35	-23,854,869.35
（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）	-9,000,000.00	-	-608,567.07	-9,608,567.07
其中：1. 基金申购款	61,500,000.00	-	-11,714,159.04	49,785,840.96
2. 基金赎回款	-70,500,000.00	-	11,105,591.97	-59,394,408.03
（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)	257,528,306.00	-	-44,157,189.36	213,371,116.64

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

西部利得深证红利交易型开放式指数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[2021]900号《关于准予西部利得深证红利交易型开放式指数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《西部利得深证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式,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288,011,794.00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2100003号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《西部利得深证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2021年6月18日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为288,028,306.00份基金份额,其中认购资金利息折合16,512.00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,基金托管人为光大证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《西部利得深证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外,为更好地实现基金的投资目标,本基金还可以投资于部分非成份股(包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许投资的股票)、存托凭证、债券资产(包括国债、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、现金资产、货币市场工具、同业存单、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数的成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的80%;股指期货、国债期货及其他金融工具的投资



比例依照法律法规或监管机构的规定执行。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：深证红利指数收益率。

#### 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

本基金在本报告期内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未发生重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期末未发生重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期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	1,472,022.96
等于：本金	1,471,345.39
加：应计利息	677.57
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	1,472,022.96

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	213,514,392.33	-	180,490,635.47	-33,023,756.86
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	213,514,392.33	-	180,490,635.47	-33,023,756.86

#### 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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

##### 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	-
待摊费用	79,538.36
合计	79,538.36

#### 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	36,475.58
其中：交易所市场	36,475.58
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
合计	120,778.14

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	263,528,306.00	263,528,306.00
本期申购	18,000,000.00	18,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-37,500,000.00	-37,500,000.00
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	244,028,306.00	244,028,306.00

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

## 6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-25,334,330.19	-40,240,708.35	-65,575,038.54
本期利润	-4,574,415.34	4,123,821.96	-450,593.38
本期基金份额交易产生的变动数	2,033,286.94	1,844,397.89	3,877,684.83
其中：基金申购款	-1,812,776.86	-2,169,950.44	-3,982,727.30
基金赎回款	3,846,063.80	4,014,348.33	7,860,412.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-27,875,458.59	-34,272,488.50	-62,147,947.09

## 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	11,169.59
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	47.61	
其他	366.92	
合计	11,584.12	

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	-3,606,716.35
股票投资收益——赎回差价收入	-3,761,193.86
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	-7,367,910.21

##### 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	26,433,827.94
减：卖出股票成本总额	29,971,109.93
减：交易费用	69,434.36
买卖股票差价收入	-3,606,716.35

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	29,639,587.87
减：现金支付赎回款总额	-155,767.13
减：赎回股票成本总额	33,556,548.86
减：交易费用	-
赎回差价收入	-3,761,193.86

##### 6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无股票申购差价收入。

##### 6.4.7.14.5 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**

本基金在本报告期内未持有衍生工具。

**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	3,403,121.79
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	3,403,121.79

#### 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	4,123,821.96
股票投资	4,123,821.96
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	-
权证投资	-
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	4,123,821.96

#### 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	-
替代损益	1,985.68
合计	1,985.68

注：ETF 替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

#### 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	24,795.19
信息披露费	59,507.37

证券出借违约金	-
其他	70,461.64
合计	154,764.20

#### 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
光大证券股份有限公司	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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例(%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例(%)
光大证券股份有限 公司	53,085,291.63	100.00	35,324,321.86	100.00

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	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 (%)
光大证券股份有限公司	38,821.25	100.00	36,475.58	100.00
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 (%)
光大证券股份有限公司	25,833.62	100.00	21,218.72	100.00

#### 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	390,360.40	416,182.71
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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 0.40% 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 × 0.40% / 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	78,072.12	83,236.51

注：支付基金托管人光大证券的托管费按前一日基金资产净值 0.08% 的年费率计提，逐日累计至

每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.08% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金于本报告期内及上年度可比期间未发生应付关联方的销售服务费。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

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

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本基金于本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

1. 本基金通过基金托管人光大证券股份有限公司转存于交通银行股份有限公司上海分行营业部的银行存款，于 2023 年 06 月 30 日的相关余额为人民币 1,472,022.96 元，当期产生的利息收入为人民币 11,169.59 元。

2. 本基金通过“光大证券股份有限公司基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2023 年 06 月 30 日的相关余额为人民币 3,556.02 元。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023年5月15日	6个月	锁定期	27.93	33.03	70	1,955.10	2,312.10	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	锁定期	11.88	21.02	307	3,647.16	6,453.14	-
001324	长青科技	2023年5月12日	6个月	锁定期	18.88	19.60	100	1,888.00	1,960.00	-
001328	登康口腔	2023年3月29日	6个月	锁定期	20.68	25.49	86	1,778.48	2,192.14	-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	锁定期	15.38	14.87	126	1,937.88	1,873.62	-
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	锁定期	44.48	39.48	42	1,868.16	1,658.16	-
001380	华纬科技	2023年5月9日	6个月	锁定期	28.84	30.78	117	3,374.28	3,601.26	-
300804	广康生化	2023年6月15日	6个月	锁定期	42.45	32.97	160	6,792.00	5,275.20	-
301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	锁定期	41.20	42.69	182	7,498.40	7,769.58	-

301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月	锁定期	56.50	52.93	93	5,254.50	4,922.49	-
301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	锁定期	34.00	34.93	141	4,794.00	4,925.13	-
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	1,570	40,537.40	40,537.40	-
301203	国泰环保	2023年3月28日	6个月	锁定期	46.13	34.40	150	6,919.50	5,160.00	-
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	锁定期	57.88	49.17	136	7,871.68	6,687.12	-
301225	恒勃股份	2023年6月8日	6个月	锁定期	35.66	33.26	213	7,595.58	7,084.38	-
301246	宏源药业	2023年3月10日	6个月	锁定期	50.00	30.71	230	11,500.00	7,063.30	-
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	1,212	44,722.80	44,722.80	-
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	锁定期	44.18	25.10	154	6,803.72	3,865.40	-
301281	科源制药	2023年05月26日	6个月	锁定期	0.00	25.10	62	0.00	1,556.20	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	3,222	64,407.78	64,407.78	-

301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	锁定期	29.60	71.42	213	6,304.80	15,212.46	-
301295	美硕科技	2023年6月19日	6个月	锁定期	37.40	36.07	206	7,704.40	7,430.42	-
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	1,586	7,930.00	14,210.56	-
301303	真兰仪表	2023年2月13日	6个月	锁定期	26.80	22.32	371	9,942.80	8,280.72	-
301305	朗坤环境	2023年5月15日	6个月	锁定期	25.25	19.69	301	7,600.25	5,926.69	-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	锁定期	32.29	51.12	161	5,198.69	8,230.32	-
301317	鑫磊股份	2023年1月12日	6个月	锁定期	20.67	26.17	454	9,384.18	11,881.18	-
301322	绿通科技	2023年2月27日	6个月	锁定期	131.11	53.24	63	8,259.93	3,354.12	-
301322	绿通科技	2023年05月25日	6个月	锁定期	0.00	53.24	31	0.00	1,650.44	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	123	4,804.38	4,841.28	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	锁定期	14.81	13.73	423	6,264.63	5,807.79	-

301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	锁定期	32.60	30.37	151	4,922.60	4,585.87	-
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	锁定期	73.45	46.64	77	5,655.65	3,591.28	-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	锁定期	17.55	16.75	344	6,037.20	5,762.00	-
301357	北方长龙	2023年4月11日	6个月	锁定期	50.00	48.39	121	6,050.00	5,855.19	-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	锁定期	23.77	42.89	245	5,823.65	10,508.05	-
301373	凌玮科技	2023年1月20日	6个月	锁定期	33.73	31.85	180	6,071.40	5,733.00	-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	锁定期	24.66	22.51	231	5,696.46	5,199.81	-
301386	未来电器	2023年3月21日	6个月	锁定期	29.99	23.79	217	6,507.83	5,162.43	-
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	2,454	65,472.72	65,472.72	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	锁定期	26.68	26.68	273	7,283.64	7,283.64	-
301399	英特科技	2023年5月16日	6个月	锁定期	43.99	51.57	169	7,434.31	8,715.33	-



301408	华人健康	2023年2月22日	6个月	锁定期	16.24	16.95	424	6,885.76	7,186.80	-
301419	阿莱德	2023年2月2日	6个月	锁定期	24.80	43.85	286	7,092.80	12,541.10	-
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	锁定期	26.35	30.60	195	5,138.25	5,967.00	-
301429	森泰股份	2023年4月10日	6个月	锁定期	28.75	21.02	339	9,746.25	7,125.78	-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	锁定期	19.99	16.90	291	5,817.09	4,917.90	-
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	1,314	75,765.24	75,765.24	-
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	1,379	54,856.62	54,856.62	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月	锁定期	39.78	39.78	154	6,126.12	6,126.12	-

#### 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	1,472,022.96	-	-	-	1,472,022.96
结算备付金	3,556.02	-	-	-	3,556.02
存出保证金	28,101.91	-	-	-	28,101.91
交易性金融资产	-	-	-	180,490,635.47	180,490,635.47
其他资产	-	-	-	79,538.36	79,538.36
资产总计	1,503,680.89	-	-	180,570,173.83	182,073,854.72
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	60,598.01	60,598.01
应付托管费	-	-	-	12,119.66	12,119.66
其他负债	-	-	-	120,778.14	120,778.14
负债总计	-	-	-	193,495.81	193,495.81
利率敏感度缺口	1,503,680.89	-	-	180,376,678.02	181,880,358.91
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	1,211,925.21	-	-	-	1,211,925.21
结算备付金	4,269.40	-	-	-	4,269.40
存出保证金	51,153.37	-	-	-	51,153.37
交易性金融资产	-	-	-	196,941,296.72	196,941,296.72
资产总计	1,267,347.98	-	-	196,941,296.72	198,208,644.70
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	67,457.58	67,457.58
应付托管费	-	-	-	13,491.54	13,491.54
其他负债	-	-	-	174,428.12	174,428.12
负债总计	-	-	-	255,377.24	255,377.24
利率敏感度缺口	1,267,347.98	-	-	196,685,919.48	197,953,267.46

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	180,490,635.47	99.24	196,941,296.72	99.49
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	180,490,635.47	99.24	196,941,296.72	99.49

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假设除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	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	8,811,000.00	9,700,000.00

	业绩比较基准下降 5%的影响金额	-8,811,000.00	-9,700,000.00
--	---------------------	---------------	---------------

#### 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	179,877,426.41	196,745,464.87
第二层次	359,172.32	-
第三层次	254,036.74	195,831.85
合计	180,490,635.47	196,941,296.72

###### 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	180,490,635.47	99.13
	其中：股票	180,490,635.47	99.13
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	1,475,578.98	0.81
8	其他各项资产	107,640.27	0.06
9	合计	182,073,854.72	100.00

注：此处的股票投资项含可退替代款估值增值。

### 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	911,540.00	0.50
B	采矿业	-	-
C	制造业	133,040,488.96	73.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,745,954.00	0.96
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	977,476.00	0.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,196,064.00	2.31
J	金融业	21,528,529.80	11.84
K	房地产业	11,884,504.04	6.53
L	租赁和商务服务业	5,530,401.00	3.04
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	179,814,957.80	98.86

### 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	611,755.58	0.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	18,839.75	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,783.19	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	11,086.69	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	15,212.46	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	675,677.67	0.37

### 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	000858	五 粮 液	146,700	23,995,719.00	13.19
2	000333	美的集团	394,300	23,232,156.00	12.77
3	000651	格力电器	359,546	13,127,024.46	7.22
4	000568	泸州老窖	60,100	12,595,157.00	6.92
5	000725	京东方 A	2,573,500	10,525,615.00	5.79
6	002415	海康威视	306,100	10,134,971.00	5.57
7	000001	平安银行	682,900	7,668,967.00	4.22
8	002142	宁波银行	283,876	7,182,062.80	3.95
9	000002	万 科 A	493,192	6,914,551.84	3.80
10	002304	洋河股份	48,200	6,331,070.00	3.48
11	002027	分众传媒	812,100	5,530,401.00	3.04
12	000338	潍柴动力	413,300	5,149,718.00	2.83
13	000100	TCL 科技	1,206,600	4,754,004.00	2.61
14	000625	长安汽车	335,800	4,341,894.00	2.39
15	002555	三七互娱	120,300	4,196,064.00	2.31
16	000776	广发证券	227,800	3,350,938.00	1.84
17	001979	招商蛇口	227,100	2,959,113.00	1.63
18	000538	云南白药	54,360	2,852,812.80	1.57
19	000157	中联重科	360,400	2,432,700.00	1.34
20	002202	金风科技	212,300	2,254,626.00	1.24
21	000895	双汇发展	85,800	2,101,242.00	1.16
22	002601	龙佰集团	121,000	1,996,500.00	1.10
23	002001	新 和 成	127,348	1,961,159.20	1.08
24	002736	国信证券	220,300	1,923,219.00	1.06
25	003816	中国广核	561,400	1,745,954.00	0.96
26	000617	中油资本	194,100	1,403,343.00	0.77
27	000069	华侨城 A	304,743	1,340,869.20	0.74
28	000708	中信特钢	68,100	1,078,704.00	0.59
29	000703	恒逸石化	158,700	1,075,986.00	0.59
30	000039	中集集团	148,250	1,021,442.50	0.56
31	002299	圣农发展	47,600	911,540.00	0.50
32	000581	威孚高科	42,000	661,500.00	0.36
33	001965	招商公路	68,000	652,800.00	0.36
34	000898	鞍钢股份	174,700	485,666.00	0.27
35	000656	金科股份	361,200	400,932.00	0.22
36	002110	三钢闽光	86,800	366,296.00	0.20
37	002563	森马服饰	57,700	358,894.00	0.20
38	001872	招商港口	18,800	324,676.00	0.18
39	002146	荣盛发展	174,700	269,038.00	0.15

40	300741	华宝股份	9,600	205,632.00	0.11
----	--------	------	-------	------------	------

### 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	301486	致尚科技	1,314	75,765.24	0.04
2	301395	仁信新材	2,727	72,756.36	0.04
3	301210	金杨股份	1,353	69,155.73	0.04
4	301292	海科新源	3,222	64,407.78	0.04
5	301488	豪恩汽电	1,533	60,982.74	0.03
6	301261	恒工精密	1,212	44,722.80	0.02
7	301202	朗威股份	1,570	40,537.40	0.02
8	301293	三博脑科	213	15,212.46	0.01
9	301301	川宁生物	1,586	14,210.56	0.01
10	301419	阿莱德	286	12,541.10	0.01
11	301317	鑫磊股份	454	11,881.18	0.01
12	301358	湖南裕能	245	10,508.05	0.01
13	301399	英特科技	169	8,715.33	0.00
14	301303	真兰仪表	371	8,280.72	0.00
15	301315	威士顿	161	8,230.32	0.00
16	301141	中科磁业	182	7,769.58	0.00
17	301295	美硕科技	206	7,430.42	0.00
18	301408	华人健康	424	7,186.80	0.00
19	301429	森泰股份	339	7,125.78	0.00
20	301225	恒勃股份	213	7,084.38	0.00
21	301246	宏源药业	230	7,063.30	0.00
22	001287	中电港	307	6,453.14	0.00
23	301428	世纪恒通	195	5,967.00	0.00
24	301305	朗坤环境	301	5,926.69	0.00
25	301357	北方长龙	121	5,855.19	0.00
26	301332	德尔玛	423	5,807.79	0.00
27	301355	南王科技	344	5,762.00	0.00
28	301373	凌玮科技	180	5,733.00	0.00
29	301281	科源制药	216	5,421.60	0.00
30	300804	广康生化	160	5,275.20	0.00
31	301376	致欧科技	231	5,199.81	0.00
32	301386	未来电器	217	5,162.43	0.00
33	301203	国泰环保	150	5,160.00	0.00
34	301322	绿通科技	94	5,004.56	0.00
35	301170	锡南科技	141	4,925.13	0.00
36	301157	华塑科技	93	4,922.49	0.00
37	301439	泓淋电力	291	4,917.90	0.00
38	301323	新莱福	123	4,841.28	0.00
39	301337	亚华电子	151	4,585.87	0.00

40	001380	华纬科技	117	3,601.26	0.00
41	301345	涛涛车业	77	3,591.28	0.00
42	001282	三联锻造	70	2,312.10	0.00
43	001328	登康口腔	86	2,192.14	0.00
44	001324	长青科技	100	1,960.00	0.00
45	001360	南矿集团	126	1,873.62	0.00
46	001367	海森药业	42	1,658.16	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	000725	京东方 A	10,354,233.00	5.23
2	000001	平安银行	8,333,661.00	4.21
3	000625	长安汽车	4,042,446.00	2.04
4	000858	五粮液	597,191.00	0.30
5	000333	美的集团	476,220.00	0.24
6	000651	格力电器	378,218.00	0.19
7	000568	泸州老窖	353,394.00	0.18
8	002555	三七互娱	280,839.09	0.14
9	002415	海康威视	252,626.00	0.13
10	002304	洋河股份	190,910.00	0.10
11	000002	万科 A	182,674.00	0.09
12	300498	温氏股份	166,827.00	0.08
13	000100	TCL 科技	124,155.00	0.06
14	002142	宁波银行	122,135.00	0.06
15	301246	宏源药业	114,700.00	0.06
16	000338	潍柴动力	111,012.00	0.06
17	000776	广发证券	106,809.00	0.05
18	301303	真兰仪表	99,186.80	0.05
19	301429	森泰股份	97,203.75	0.05
20	002027	分众传媒	96,269.00	0.05

注：本表“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300498	温氏股份	7,891,080.30	3.99
2	000858	五粮液	2,198,749.00	1.11
3	000333	美的集团	1,865,157.00	0.94

4	002385	大北农	1,835,187.00	0.93
5	002415	海康威视	1,175,300.00	0.59
6	000568	泸州老窖	1,139,112.00	0.58
7	000651	格力电器	1,128,397.00	0.57
8	002142	宁波银行	661,814.00	0.33
9	000002	万 科 A	632,485.00	0.32
10	002304	洋河股份	629,918.00	0.32
11	000402	金 融 街	488,201.00	0.25
12	002027	分众传媒	471,730.00	0.24
13	000157	中联重科	448,014.00	0.23
14	000338	潍柴动力	414,867.00	0.21
15	000776	广发证券	293,912.00	0.15
16	001979	招商蛇口	267,061.00	0.13
17	000538	云南白药	240,892.00	0.12
18	002202	金风科技	214,569.00	0.11
19	000895	双汇发展	194,607.00	0.10
20	002736	国信证券	181,838.00	0.09

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	29,446,807.58
卖出股票收入（成交）总额	26,433,827.94

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

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

## 7.12 投资组合报告附注

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

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

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	28,101.91
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	79,538.36
8	其他	-
9	合计	107,640.27

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公	占基金资产净	流通受限情况说明
----	------	------	----------	--------	----------

			允价值	值比例 (%)	
1	301486	致尚科技	75,765.24	0.04	新股未上市
2	301395	仁信新材	65,472.72	0.04	新股未上市
2	301395	仁信新材	7,283.64	0.00	锁定期
3	301292	海科新源	64,407.78	0.04	新股未上市
4	301488	豪恩汽电	54,856.62	0.03	新股未上市
4	301488	豪恩汽电	6,126.12	0.00	锁定期
5	301210	N 金杨	6,687.12	0.00	锁定期

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
5,171	47,191.70	92,338,431.00	37.84	151,689,875.00	62.16

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	上海久事(集团)有限公司	53,300,064.00	21.84
2	招商证券股份有限公司	12,312,896.00	5.05
3	方正证券股份有限公司	11,596,138.00	4.75
4	中信证券股份有限公司	8,876,400.00	3.64
5	白胜华	3,467,400.00	1.42
6	廖文成	3,140,000.00	1.29
7	中国银河证券股份有 限公司	2,807,925.00	1.15
8	中邮理财有限责任公 司-邮银财富·鸿锦一 年定开 54 号	1,886,700.00	0.77
9	毛松波	1,600,108.00	0.66
10	杨清绚	1,543,100.00	0.63

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 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

本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金基金经理未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021年6月18日） 基金份额总额	288,028,306.00
本报告期期初基金份额总额	263,528,306.00
本报告期基金总申购份额	18,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	37,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	244,028,306.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开本基金份额持有人大会，无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产的诉讼事项。

本报告期内未涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金进行审计。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 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 (%)	
光大证券股份有限公司	2	53,085,291.63	100.00	38,821.25	100.00	-

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

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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旗下西部利得深证红利交易型开放式指数证券投资基金新增申购赎回代理券商的公告	同上	2023 年 5 月 5 日
3	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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20230101-20230630	53,300,064.00	0.00	0.00	53,300,064.00	21.8400
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

### 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