

西部利得量化成长混合型发起式证券投资  
基金  
2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：西部利得基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：二〇二〇年八月三十一日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 27 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 2020 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>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	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>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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 托管人对本半年度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>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	47
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	48
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	48
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>49</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	51

<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>52</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 .....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	52
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>53</b>
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金
基金简称	西部利得量化成长混合
场内简称	-
基金主代码	000006
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 3 月 19 日
基金管理人	西部利得基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	253,720,898.93 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过量化投资策略进行股票投资，在严格控制风险和保持资产高流动性的前提下，努力实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金主要通过多因子量化投资模型，选取并持有具有成长性的股票构成投资组合，打造成长风格，力争稳定的超越业绩基准的投资收益。（详见《基金合同》）
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*75%+同期银行活期存款利率（税后）*25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，在通常情况下其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		西部利得基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵毅	贺倩
	联系电话	021-38572888	010-66060069
	电子邮箱	service@westleadfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4007-007-818;021-38572666	95599
传真		021-38572750	010-68121816
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 杨高南路 799 号 11 层 02、03	北京市东城区建国门内大街 69 号

	单元	
办公地址	上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 11 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	200127	100031
法定代表人	何方	周慕冰

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.westleadfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人处——上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 11 楼

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	西部利得基金管理有限公司	上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 11 楼

### § 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(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	36,120,147.32
本期利润	54,617,757.58
加权平均基金份额本期利润	0.4509
本期加权平均净值利润率	32.68%
本期基金份额净值增长率	32.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	106,683,196.20
期末可供分配基金份额利润	0.4205
期末基金资产净值	406,945,718.89
期末基金份额净值	1.6039
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	60.39%

#### 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

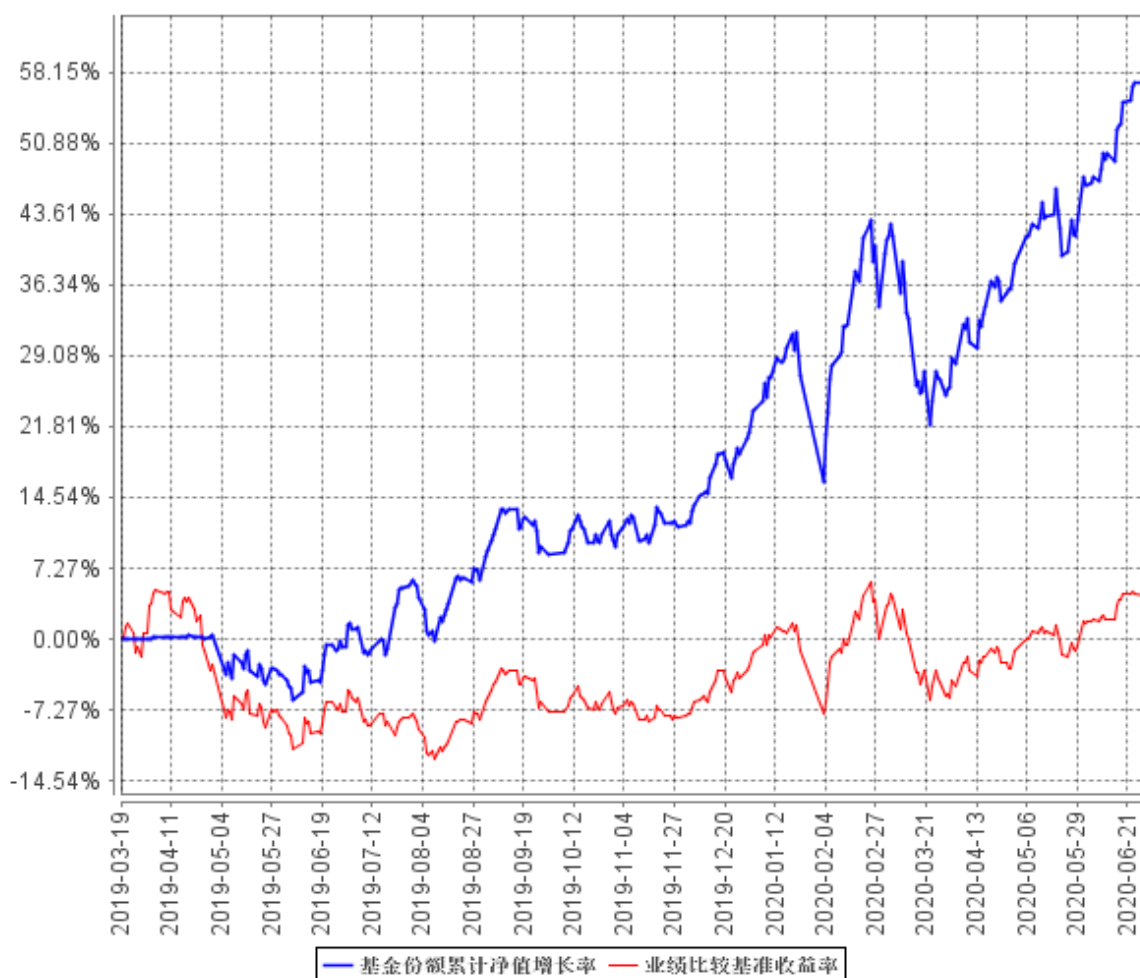
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	12.13%	0.95%	6.32%	0.66%	5.81%	0.29%
过去三个月	27.55%	1.13%	12.11%	0.85%	15.44%	0.28%
过去六个月	32.33%	1.78%	8.82%	1.34%	23.51%	0.44%
过去一年	61.65%	1.42%	14.21%	1.09%	47.44%	0.33%
自基金合同生效起至今	60.39%	1.32%	5.78%	1.15%	54.61%	0.17%

注：本基金的业绩基准为：中证500指数收益率\*75%+同期银行活期存款利率（税后）\*25%



### 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

基金份额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（简称“西部利得基金”，下同）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2010]864号）批准成立于2010年7月20日。公司由西部证券股份有限公司和利得科技有限公司合资控股，注册资本3.5亿元人民币，其中西部证券股份有限公司占比51%，利得科技有限公司占比49%，注册地上海。

截至2020年6月30日，本基金管理人旗下共管理39只开放式基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
盛丰衍	基金经理	2019年3月19日	-	7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。

注：1. 基金经理的任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日；

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

本报告期内，两两组合间单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为 0 的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的交易。

### 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 2020 年半上年，国内外受到新冠疫情冲击后，国内复工复产进度喜人，经济 V 型反弹。A 股在 2 月初短暂下跌后走出了一波以成长股为核心的上涨行情。

投资策略上，本基金始终维持高股票仓位，风格偏成长，行业配置参考中证 500 指数，选股标准兼顾安全边际以及业绩的向上超预期，同时规避量价指标上显示出超买的个股以及临近解禁的个股，股票数量足够分散，努力控制单只股票权重不高于 1%，以此弱化个股黑天鹅的影响。2019 年 7 月 22 日科创板鸣锣开板，本基金在基金规模满足科创板网下打新的要求后会增加科创板新股打新策略，以此增厚基金收益。本基金努力通过选股获得相对于基准的超额收益，打造成长风格的优质量化基金，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 2020 年三季度，影响 A 股的主要有三股力量。

其一是经济 V 型企稳+货币仍较为宽松的宏观背景。

年初受国内外疫情影响，中国经济下行压力变大、失业率高企。中国政府为了托底经济推出了一系列的政策，使得中国经济 3 月下旬得以 V 型复苏。虽然有阶段性区域疫情反弹带来扰动，但疫情在国内二次爆发概率不大，经济企稳的方向不变，复苏牛可期。在经济得以彻底复苏之前较为宽松的货币政策仍将持续一段时间。两者叠加对权益市场而言是较为友好的宏观背景。

其二上市公司盈利增速。

上市公司盈利增速是 A 股行业配置的重要参考指标。从总量上看，2020 年 Q1 上市公司盈利增速探底，此后逐季回升至 2021 年 Q1。从结构上看，世界进入后疫情时代，新经济、医药增速

居前，这一定程度上支撑着这些板块的高估值。盈利增速也是周期类行业的重要参考指标，一旦盈利增速变正，部分周期股的低估值或得以修复。

其三是美国大选将近。

美国大选可能造成中美关系出现一定波折，包括经贸领域、舆论领域、科技领域、区域争端等等，A 股市场的风险偏好随之扰动。

#### 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或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—西部利得基金管理有限公司 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，西部利得基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，西部利得基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金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、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	34,299,913.76	3,837,460.47
结算备付金		1,575,569.78	2,359,128.90
存出保证金		403,668.50	60,082.44
交易性金融资产	6.4.7.2	376,523,141.22	133,823,518.66
其中：股票投资		376,523,141.22	129,186,897.86
基金投资		-	-
债券投资		-	4,636,620.80
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,957,135.41	2,490.56
应收利息	6.4.7.5	9,650.82	91,031.50
应收股利		-	-
应收申购款		6,058,975.96	49,471.04
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		420,828,055.45	140,223,183.57
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 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		-	-
应付证券清算款		12,176,308.58	22,865.39
应付赎回款		869,764.31	374,963.84
应付管理人报酬		331,194.77	175,080.67
应付托管费		22,079.68	11,672.02
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	395,812.33	180,854.23
应交税费		1,263.10	1.25

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	85,913.79	145,450.02
负债合计		13,882,336.56	910,887.42
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	253,720,898.93	114,940,759.86
未分配利润	6.4.7.10	153,224,819.96	24,371,536.29
所有者权益合计		406,945,718.89	139,312,296.15
负债和所有者权益总计		420,828,055.45	140,223,183.57

报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.6039 元，基金份额总额 253,720,898.93 份。

## 6.2 利润表

会计主体：西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 3 月 19 日(基 金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		57,347,331.66	-445,251.60
1.利息收入		68,925.32	551,072.94
其中：存款利息收入	6.4.7.11	64,758.49	432,693.76
债券利息收入		4,166.83	25,568.22
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	92,810.96
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		38,614,218.58	1,037,533.16
其中：股票投资收益	6.4.7.12	37,163,484.17	-187,785.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	76,087.36	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,374,647.05	1,225,318.61
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	18,497,745.59	-2,193,700.38
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	166,442.17	159,842.68
<b>减：二、费用</b>		2,729,574.08	928,038.65
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,252,891.75	650,357.41
2. 托管费	6.4.10.2.2	83,526.11	43,357.16

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,300,647.38	176,881.47
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		135.47	-
7. 其他费用	6.4.7.20	92,373.37	57,442.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		54,617,757.58	-1,373,290.25
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		54,617,757.58	-1,373,290.25

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	114,940,759.86	24,371,536.29	139,312,296.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	54,617,757.58	54,617,757.58
三、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）	138,780,139.07	74,235,526.09	213,015,665.16
其中：1.基金申购款	200,307,419.06	94,683,759.24	294,991,178.30
2.基金赎回款	-61,527,279.99	-20,448,233.15	-81,975,513.14
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	253,720,898.93	153,224,819.96	406,945,718.89
项目	上年度可比期间 2019 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日		



	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	177,856,344.09	-	177,856,344.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,373,290.25	-1,373,290.25
三、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)	-39,768,706.94	291,111.39	-39,477,595.55
其中：1.基金申购款	3,582,787.39	-42,868.03	3,539,919.36
2.基金赎回款	-43,351,494.33	333,979.42	-43,017,514.91
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	138,087,637.15	-1,082,178.86	137,005,458.29

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]第 189 号《关于准予西部利得量化阿尔法混合型证券投资基金变更注册的批复》核准,由西部利得基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 177,836,375.57 元,业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第 1900164 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2019 年 3 月 19 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 177,856,344.09 份基金份额,其中认购资金利息折合 19,968.52 份基金份额。本基金的基金管理人为西部利得基金管理有限公司,基金托管人为

中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债券、短期融资券(含超短期融资券)、中期票据、资产支持证券、次级债券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 60%-95%。基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率\*75%+同期银行活期存款利率(税后)\*25%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本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

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况、自 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期未发生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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

### 6.4.6 税项

#### (1) 主要税项说明

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》、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》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。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）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。

(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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	34,299,913.76
定期存款	-
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	-
合计：	34,299,913.76

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	348,635,171.44	376,523,141.22	27,887,969.78

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	348,635,171.44	376,523,141.22	27,887,969.78

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末及上年度期末均未持有衍生金融资产/负债。

#### 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。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	8,989.02
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	615.80
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	46.00
合计	9,650.82

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	395,812.33
银行间市场应付交易费用	-
合计	395,812.33

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,378.43
预提费用	84,535.36
合计	85,913.79

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	114,940,759.86	114,940,759.86
本期申购	200,307,419.06	200,307,419.06
本期赎回(以“-”号填列)	-61,527,279.99	-61,527,279.99
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	253,720,898.93	253,720,898.93

**6.4.7.10 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	15,982,786.79	8,388,749.50	24,371,536.29
本期利润	36,120,147.32	18,497,610.26	54,617,757.58
本期基金份额交易	54,580,262.09	19,655,264.00	74,235,526.09

产生的变动数			
其中：基金申购款	71,348,585.76	23,335,173.48	94,683,759.24
基金赎回款	-16,768,323.67	-3,679,909.48	-20,448,233.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	106,683,196.20	46,541,623.76	153,224,819.96

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	54,550.90
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	5,950.50
其他	4,257.09
合计	64,758.49

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	488,270,621.18
减：卖出股票成本总额	451,107,137.01
买卖股票差价收入	37,163,484.17

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	76,087.36
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	76,087.36

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,879,141.64
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,710,400.00
减：应收利息总额	92,654.28
买卖债券差价收入	76,087.36

**6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期末未有债券赎回差价收入。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期末未有债券申购差价收入。

**6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

本基金于本报告期内未持有资产支持证券。

**6.4.7.14 贵金属投资收益****6.4.7.14.1 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。

**6.4.7.14.2 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。

**6.4.7.14.3 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。

**6.4.7.14.4 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。



**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内未持有衍生工具。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期内未持有衍生工具。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,374,647.05
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,374,647.05

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	18,460,153.36
——股票投资	18,497,974.16
——债券投资	-37,820.80
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	38,720.00
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	1,127.77
合计	18,497,745.59

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	137,838.54
转换费收入	28,603.63

合计	166,442.17
----	------------

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	1,300,647.38
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	1,300,647.38

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
银行汇划手续费	7,838.01
合计	92,373.37

#### 6.4.7.21 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并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

## 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，本基金并无须作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
西部利得基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构
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
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
西部利得-汇通 3 号资产管理计划	基金管理人管理的资产管理计划

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

本基金于本报告期内及上年度期内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 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年3月19日(基金合同生效日) 至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,252,891.75	650,357.41
其中：支付销售机构的客户维护费	148,774.02	328,494.99

注：支付基金管理人西部利得基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50% / 当年天数。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年3月19日(基金合同生效日) 至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	83,526.11	43,357.16

注：支付基金托管人中国农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 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/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支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 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年3月19日(基金合同生效日)至2019年6月30日
基金合同生效日(2019年3月19日)持有的基金份额	10,000,600.00	10,000,600.00
报告期初持有的基金份额	10,000,600.00	10,000,600.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,600.00	10,000,600.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.9416%	7.2422%

## 6.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2020年6月30日		2019年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
西部证券股份有限公司	2,711,766.77	1.0688%	-	-

## 6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年6月30日		2019年3月19日(基金合同生效日)至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	34,299,913.76	54,550.90	11,509,007.25	76,764.98

本基金的银行存款由基金托管人农业银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 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。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 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（2020 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	可流通日	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
688568	中科星图	2020年6月30日	2020年7月8日	新股流通受限	16.21	16.21	9,986	161,873.06	161,873.06	-
688377	迪威尔	2020年6月29日	2020年7月8日	新股流通受限	16.42	16.42	6,968	114,414.56	114,414.56	-
688027	国盾量子	2020年6月30日	2020年7月9日	新股流通受限	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688600	皖仪科技	2020年6月23日	2020年7月3日	新股流通受限	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-
300847	中船汉光	2020年6月29日	2020年7月9日	新股流通受限	6.94	6.94	1,420	9,854.80	9,854.80	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新股流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新股流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月	新股流通受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-

		日	8 日							
300846	首都 在线	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 1 日	新股流 通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
688298	东方 生物	2020 年 1 月 20 日	2020 年 8 月 5 日	网下配 售摇号 锁定	21.25	144.17	3,541	75,246.25	510,505.97	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持暂时停牌股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含创业板、中小板）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、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。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人力争在严格控制风险的情况下实现基金资产长期增值，对以上风险采取的风险管理政策如下所述：

##### 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。

##### 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等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金均投资于具有良好信用等级的证券；银行存款均存放于信用良好的银行；在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，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

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。

##### 6.4.13.3.1 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 2020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	34,299,913.76	-	-	-	34,299,913.76
结算备付金	1,575,569.78	-	-	-	1,575,569.78
存出保证金	102,099.70	-	-	301,568.80	403,668.50
交易性金融资产	-	-	-	376,523,141.22	376,523,141.22
应收证券清算款	-	-	-	1,957,135.41	1,957,135.41
应收利息	-	-	-	9,650.82	9,650.82
应收申购款	-	-	-	6,058,975.96	6,058,975.96
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	35,977,583.24	-	-	384,850,472.21	420,828,055.45
负债					
应付证券清算款	-	-	-	12,215,028.58	12,215,028.58
应付赎回款	-	-	-	869,764.31	869,764.31
应付管理人报酬	-	-	-	331,194.77	331,194.77
应付托管费	-	-	-	22,079.68	22,079.68
应付交易费用	-	-	-	395,812.33	395,812.33

应交税费	-	-	-	1,263.10	1,263.10
其他负债	-	-	-	47,193.79	47,193.79
负债总计	-	-	-	13,882,336.56	13,882,336.56
利率敏感度缺口	35,977,583.24	-	-	-370,968,135.65	406,945,718.89
上年度末 2019 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	3,837,460.47	-	-	-	3,837,460.47
结算备付金	2,359,128.90	-	-	-	2,359,128.90
存出保证金	60,082.44	-	-	-	60,082.44
交易性金融资产	4,636,620.80	-	-	-129,186,897.86	133,823,518.66
应收证券清算款	-	-	-	2,490.56	2,490.56
应收利息	-	-	-	91,031.50	91,031.50
应收申购款	-	-	-	49,471.04	49,471.04
资产总计	10,893,292.61	-	-	-129,329,890.96	140,223,183.57
负债					
应付证券清算款	-	-	-	22,865.39	22,865.39
应付赎回款	-	-	-	374,963.84	374,963.84
应付管理人报酬	-	-	-	175,080.67	175,080.67
应付托管费	-	-	-	11,672.02	11,672.02
应付交易费用	-	-	-	180,854.23	180,854.23
应交税费	-	-	-	1.25	1.25
其他负债	-	-	-	145,450.02	145,450.02
负债总计	-	-	-	910,887.42	910,887.42
利率敏感度缺口	10,893,292.61	-	-	-128,419,003.54	139,312,296.15

#### 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 2020年6月30日		上年度末 2019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	376,523,141.22	92.52	129,186,897.86	92.73
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	4,636,620.80	3.33
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	376,523,141.22	92.52	133,823,518.66	96.06

## 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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	20,370,046.80	4,968,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-20,370,046.80	-4,968,000.00

## 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属

于第一层级的余额 376023201.42 元，属于第二层级的余额为 499939.80 元，无属于第三层级的余额（于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额 123447497.30 元，属于第二层级的余额为 10376021.37 元，无属于第三层级的余额）。

(ii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具 不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	376,523,141.22	89.47
	其中：股票	376,523,141.22	89.47
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	35,875,483.54	8.52
8	其他各项资产	8,429,430.69	2.00
9	合计	420,828,055.45	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	3,347,576.00	0.82
B	采矿业	6,901,111.00	1.70
C	制造业	249,240,018.32	61.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,216,272.32	0.54
E	建筑业	6,708,796.00	1.65
F	批发和零售业	6,324,639.80	1.55
G	交通运输、仓储和邮政业	5,696,852.00	1.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	43,708,833.88	10.74
J	金融业	17,154,550.00	4.22
K	房地产业	11,587,281.00	2.85
L	租赁和商务服务业	2,211,290.00	0.54
M	科学研究和技术服务业	6,250,606.80	1.54
N	水利、环境和公共设施管理业	7,221,300.40	1.77
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,285,446.00	1.54
R	文化、体育和娱乐业	1,668,567.70	0.41
S	综合	-	-
	合计	376,523,141.22	92.52

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

### 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

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	占基金资产净值比例（%）
1	002223	鱼跃医疗	92,300	3,359,720.00	0.83
2	600201	生物股份	111,900	3,115,296.00	0.77
3	603444	吉比特	5,626	3,088,730.26	0.76
4	601799	星宇股份	24,100	3,060,700.00	0.75
5	300357	我武生物	49,100	3,056,475.00	0.75
6	300558	贝达药业	21,600	3,023,568.00	0.74
7	300285	国瓷材料	89,900	3,012,549.00	0.74
8	000513	丽珠集团	62,300	2,991,023.00	0.73
9	600143	金发科技	226,300	2,980,371.00	0.73
10	002353	杰瑞股份	95,000	2,945,000.00	0.72
11	603568	伟明环保	115,922	2,689,390.40	0.66
12	002373	千方科技	110,751	2,656,916.49	0.65
13	002230	科大讯飞	70,200	2,627,586.00	0.65
14	002241	歌尔股份	82,600	2,425,136.00	0.60
15	601788	光大证券	151,000	2,425,060.00	0.60
16	600459	贵研铂业	80,700	2,405,667.00	0.59
17	600606	绿地控股	388,600	2,401,548.00	0.59
18	300408	三环集团	86,500	2,396,050.00	0.59
19	688202	美迪西	17,266	2,387,887.80	0.59
20	600298	安琪酵母	47,900	2,370,092.00	0.58
21	600195	中牧股份	145,600	2,363,088.00	0.58
22	300725	药石科技	19,000	2,360,750.00	0.58
23	002028	思源电气	115,020	2,353,309.20	0.58
24	300212	易华录	42,000	2,352,000.00	0.58
25	002901	大博医疗	19,600	2,338,084.00	0.57

26	002568	百润股份	51,500	2,333,980.00	0.57
27	300373	扬杰科技	69,400	2,326,288.00	0.57
28	000938	紫光股份	54,000	2,320,920.00	0.57
29	300601	康泰生物	14,300	2,318,888.00	0.57
30	300502	新易盛	36,660	2,313,979.20	0.57
31	000661	长春高新	5,300	2,307,090.00	0.57
32	688396	华润微	53,063	2,305,056.72	0.57
33	603317	天味食品	41,400	2,301,012.00	0.57
34	603960	克来机电	82,348	2,299,156.16	0.56
35	002126	银轮股份	187,700	2,297,448.00	0.56
36	688258	卓易信息	23,800	2,295,986.00	0.56
37	300326	凯利泰	78,700	2,290,170.00	0.56
38	000090	天健集团	331,400	2,289,974.00	0.56
39	600480	凌云股份	204,400	2,289,280.00	0.56
40	601137	博威合金	145,900	2,281,876.00	0.56
41	002648	卫星石化	140,200	2,281,054.00	0.56
42	603881	数据港	21,100	2,280,277.00	0.56
43	600570	恒生电子	21,165	2,279,470.50	0.56
44	300037	新宙邦	41,300	2,273,978.00	0.56
45	688169	石头科技	6,030	2,272,707.00	0.56
46	002481	双塔食品	131,200	2,272,384.00	0.56
47	300497	富祥药业	115,900	2,268,163.00	0.56
48	000157	中联重科	352,600	2,267,218.00	0.56
49	300124	汇川技术	59,617	2,264,849.83	0.56
50	600079	人福医药	83,200	2,264,704.00	0.56
51	603609	禾丰牧业	151,100	2,251,390.00	0.55
52	688023	安恒信息	7,300	2,247,670.00	0.55
53	300226	上海钢联	28,540	2,243,244.00	0.55
54	000858	五粮液	13,100	2,241,672.00	0.55
55	600760	中航沈飞	68,300	2,241,606.00	0.55
56	002594	比亚迪	31,200	2,240,160.00	0.55
57	000656	金科股份	274,400	2,239,104.00	0.55
58	600496	精工钢构	667,800	2,237,130.00	0.55
59	300760	迈瑞医疗	7,300	2,231,610.00	0.55
60	000063	中兴通讯	55,500	2,227,215.00	0.55
61	000750	国海证券	512,900	2,225,986.00	0.55
62	603259	药明康德	23,040	2,225,664.00	0.55
63	600887	伊利股份	71,400	2,222,682.00	0.55
64	600862	中航高科	131,300	2,221,596.00	0.55

65	300832	新产业	12,900	2,221,251.00	0.55
66	002709	天赐材料	65,736	2,221,219.44	0.55
67	600584	长电科技	71,000	2,220,170.00	0.55
68	600125	铁龙物流	397,800	2,219,724.00	0.55
69	601717	郑煤机	376,740	2,218,998.60	0.55
70	600893	航发动力	94,400	2,216,512.00	0.54
71	002697	红旗连锁	202,900	2,215,668.00	0.54
72	603113	金能科技	186,300	2,215,107.00	0.54
73	002311	海大集团	46,500	2,212,935.00	0.54
74	600036	招商银行	65,600	2,212,032.00	0.54
75	600547	山东黄金	60,400	2,211,848.00	0.54
76	002027	分众传媒	397,000	2,211,290.00	0.54
77	002271	东方雨虹	54,400	2,210,272.00	0.54
78	603566	普莱柯	79,800	2,209,662.00	0.54
79	600048	保利地产	149,500	2,209,610.00	0.54
80	603338	浙江鼎力	29,160	2,209,453.20	0.54
81	300559	佳发教育	104,050	2,207,941.00	0.54
82	600801	华新水泥	93,100	2,207,401.00	0.54
83	300118	东方日升	147,100	2,206,500.00	0.54
84	600438	通威股份	126,800	2,203,784.00	0.54
85	600027	华电国际	644,300	2,203,506.00	0.54
86	300327	中颖电子	68,000	2,203,200.00	0.54
87	002410	广联达	31,500	2,195,550.00	0.54
88	300457	赢合科技	68,700	2,190,156.00	0.54
89	002438	江苏神通	268,400	2,190,144.00	0.54
90	603993	洛阳钼业	595,600	2,185,852.00	0.54
91	600276	恒瑞医药	23,660	2,183,818.00	0.54
92	002258	利尔化学	122,400	2,182,392.00	0.54
93	601390	中国中铁	434,600	2,181,692.00	0.54
94	300015	爱尔眼科	50,000	2,172,500.00	0.53
95	000672	上峰水泥	91,900	2,169,759.00	0.53
96	688116	天奈科技	46,400	2,169,200.00	0.53
97	000807	云铝股份	497,400	2,168,664.00	0.53
98	600323	瀚蓝环境	98,900	2,163,932.00	0.53
99	603000	人民网	108,800	2,157,504.00	0.53
100	601088	中国神华	150,100	2,155,436.00	0.53
101	600585	海螺水泥	40,700	2,153,437.00	0.53
102	000789	万年青	167,200	2,151,864.00	0.53
103	600449	宁夏建材	175,700	2,147,054.00	0.53



104	603658	安图生物	13,200	2,144,208.00	0.53
105	300482	万孚生物	20,000	2,080,000.00	0.51
106	300347	泰格医药	20,400	2,078,352.00	0.51
107	002714	牧原股份	25,160	2,063,120.00	0.51
108	300136	信维通信	38,800	2,057,176.00	0.51
109	300677	英科医疗	16,000	2,044,800.00	0.50
110	600763	通策医疗	12,200	2,034,594.00	0.50
111	002001	新和成	69,200	2,013,720.00	0.49
112	002916	深南电路	12,000	2,010,240.00	0.49
113	002475	立讯精密	38,999	2,002,598.65	0.49
114	002832	比音勒芬	116,794	1,999,513.28	0.49
115	600309	万华化学	39,800	1,989,602.00	0.49
116	600966	博汇纸业	195,700	1,986,355.00	0.49
117	002216	三全食品	83,100	1,986,090.00	0.49
118	300750	宁德时代	11,300	1,970,268.00	0.48
119	600745	闻泰科技	15,300	1,927,035.00	0.47
120	000686	东北证券	227,800	1,924,910.00	0.47
121	600183	生益科技	65,400	1,914,258.00	0.47
122	300031	宝通科技	76,100	1,905,544.00	0.47
123	688196	卓越新能	36,352	1,903,390.72	0.47
124	603809	豪能股份	143,326	1,901,936.02	0.47
125	002831	裕同科技	68,000	1,870,680.00	0.46
126	000961	中南建设	208,500	1,855,650.00	0.46
127	002123	梦网集团	91,300	1,807,740.00	0.44
128	000712	锦龙股份	144,300	1,803,750.00	0.44
129	600315	上海家化	37,600	1,801,040.00	0.44
130	600305	恒顺醋业	96,636	1,792,597.80	0.44
131	002214	大立科技	63,500	1,789,430.00	0.44
132	300770	新媒股份	8,000	1,789,280.00	0.44
133	002415	海康威视	58,900	1,787,615.00	0.44
134	603019	中科曙光	45,000	1,728,000.00	0.42
135	603939	益丰药房	18,900	1,719,900.00	0.42
136	000651	格力电器	30,200	1,708,414.00	0.42
137	000977	浪潮信息	43,400	1,700,412.00	0.42
138	603214	爱婴室	54,840	1,681,942.80	0.41
139	300144	宋城演艺	96,449	1,668,567.70	0.41
140	600809	山西汾酒	11,400	1,653,000.00	0.41
141	600864	哈投股份	274,200	1,647,942.00	0.40
142	300676	华大基因	10,500	1,637,055.00	0.40

143	603613	国联股份	17,290	1,625,260.00	0.40
144	688111	金山办公	4,700	1,605,426.00	0.39
145	600908	无锡银行	319,400	1,568,254.00	0.39
146	002661	克明面业	65,700	1,522,926.00	0.37
147	000739	普洛药业	64,500	1,502,205.00	0.37
148	002414	高德红外	49,640	1,453,459.20	0.36
149	000951	中国重汽	46,200	1,444,212.00	0.35
150	603501	韦尔股份	7,100	1,433,845.00	0.35
151	600521	华海药业	41,620	1,412,166.60	0.35
152	002352	顺丰控股	25,800	1,411,260.00	0.35
153	002601	龙蟠佰利	74,400	1,376,400.00	0.34
154	002609	捷顺科技	107,800	1,374,450.00	0.34
155	300476	胜宏科技	56,500	1,358,825.00	0.33
156	600380	健康元	83,300	1,352,792.00	0.33
157	600556	天下秀	73,000	1,352,690.00	0.33
158	002600	领益智造	126,900	1,348,947.00	0.33
159	002384	东山精密	45,000	1,347,750.00	0.33
160	600597	光明乳业	90,000	1,337,400.00	0.33
161	002531	天顺风能	223,600	1,337,128.00	0.33
162	002938	鹏鼎控股	26,600	1,331,596.00	0.33
163	000002	万科 A	50,900	1,330,526.00	0.33
164	603986	兆易创新	5,520	1,302,223.20	0.32
165	300379	东方通	30,000	1,290,900.00	0.32
166	600720	祁连山	79,110	1,285,537.50	0.32
167	300498	温氏股份	58,920	1,284,456.00	0.32
168	601012	隆基股份	31,200	1,270,776.00	0.31
169	300188	美亚柏科	62,600	1,241,358.00	0.31
170	300815	玉禾田	9,800	1,201,872.00	0.30
171	300569	天能重工	145,860	1,190,217.60	0.29
172	000546	金圆股份	115,800	1,166,106.00	0.29
173	601128	常熟银行	152,400	1,144,524.00	0.28
174	300719	安达维尔	99,100	1,143,614.00	0.28
175	600369	西南证券	240,000	1,101,600.00	0.27
176	601997	贵阳银行	153,700	1,100,492.00	0.27
177	000582	北部湾港	102,200	1,097,628.00	0.27
178	300119	瑞普生物	46,000	1,028,100.00	0.25
179	600233	圆通速递	66,500	968,240.00	0.24
180	603218	日月股份	50,540	924,882.00	0.23
181	000932	华菱钢铁	225,500	850,135.00	0.21

182	000717	韶钢松山	223,700	850,060.00	0.21
183	600325	华发股份	116,600	823,196.00	0.20
184	603258	电魂网络	12,900	716,724.00	0.18
185	300701	森霸传感	19,700	686,151.00	0.17
186	002950	奥美医疗	23,500	666,930.00	0.16
187	300782	卓胜微	1,620	657,347.40	0.16
188	603369	今世缘	16,200	644,598.00	0.16
189	000860	顺鑫农业	10,800	615,384.00	0.15
190	600466	蓝光发展	108,900	586,971.00	0.14
191	688298	东方生物	3,541	510,505.97	0.13
192	688002	睿创微纳	8,900	453,722.00	0.11
193	600051	宁波联合	47,200	413,944.00	0.10
194	300394	天孚通信	6,900	410,895.00	0.10
195	002837	英维克	12,450	368,769.00	0.09
196	002128	露天煤业	44,900	347,975.00	0.09
197	300607	拓斯达	8,280	336,913.20	0.08
198	002567	唐人神	35,000	333,200.00	0.08
199	002726	龙大肉食	38,900	328,316.00	0.08
200	002419	天虹股份	30,700	293,185.00	0.07
201	688018	乐鑫科技	900	185,040.00	0.05
202	603010	万盛股份	12,300	172,323.00	0.04
203	688568	中科星图	9,986	161,873.06	0.04
204	688089	嘉必优	3,100	160,859.00	0.04
205	600340	华夏幸福	6,000	137,160.00	0.03
206	688377	迪威尔	6,968	114,414.56	0.03
207	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.03
208	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.02
209	603087	甘李药业	753	75,525.90	0.02
210	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.01
211	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
212	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
213	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
214	300847	中船汉光	1,420	9,854.80	0.00
215	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
216	300598	诚迈科技	40	7,576.00	0.00
217	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
218	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
219	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00
220	600376	首开股份	600	3,516.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	600570	恒生电子	4,696,397.00	3.37
2	002353	杰瑞股份	4,378,017.69	3.14
3	600438	通威股份	4,229,118.00	3.04
4	300558	贝达药业	4,104,172.12	2.95
5	603609	禾丰牧业	4,037,849.00	2.90
6	600143	金发科技	3,888,555.00	2.79
7	000513	丽珠集团	3,720,797.00	2.67
8	600201	生物股份	3,673,954.00	2.64
9	300601	康泰生物	3,622,242.00	2.60
10	603939	益丰药房	3,559,939.00	2.56
11	300760	迈瑞医疗	3,545,374.00	2.54
12	600745	闻泰科技	3,424,408.00	2.46
13	002373	千方科技	3,388,728.80	2.43
14	002438	江苏神通	3,350,835.00	2.41
15	603568	伟明环保	3,296,951.04	2.37
16	000651	格力电器	3,294,362.10	2.36
17	002001	新和成	3,287,296.00	2.36
18	300285	国瓷材料	3,237,179.00	2.32
19	300357	我武生物	3,235,940.00	2.32
20	002697	红旗连锁	3,226,339.00	2.32
21	603993	洛阳钼业	3,183,350.00	2.29
22	002216	三全食品	3,152,139.00	2.26
23	002126	银轮股份	3,103,874.00	2.23
24	600547	山东黄金	3,074,423.92	2.21
25	300457	赢合科技	3,055,713.30	2.19
26	002230	科大讯飞	3,031,192.77	2.18
27	600036	招商银行	3,008,768.00	2.16
28	603233	大参林	3,001,078.40	2.15
29	002223	鱼跃医疗	2,992,079.00	2.15

30	000063	中兴通讯	2,984,447.00	2.14
31	300326	凯利泰	2,979,597.00	2.14
32	000858	五粮液	2,971,231.00	2.13
33	002311	海大集团	2,937,137.00	2.11
34	002831	裕同科技	2,936,222.00	2.11
35	600298	安琪酵母	2,909,820.00	2.09
36	002027	分众传媒	2,891,113.00	2.08
37	002609	捷顺科技	2,877,662.00	2.07
38	600315	上海家化	2,864,620.06	2.06
39	600323	瀚蓝环境	2,847,781.04	2.04
40	002959	小熊电器	2,840,732.00	2.04
41	601799	星宇股份	2,827,567.00	2.03
42	600584	长电科技	2,803,972.00	2.01

#### 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	300598	诚迈科技	3,836,802.00	2.75
2	688012	中微公司	3,719,903.30	2.67
3	002959	小熊电器	3,385,738.00	2.43
4	600570	恒生电子	3,295,579.00	2.37
5	603233	大参林	3,198,937.60	2.30
6	002007	华兰生物	2,855,209.71	2.05
7	300451	创业慧康	2,634,942.00	1.89
8	603363	傲农生物	2,611,320.26	1.87
9	002557	洽洽食品	2,593,173.43	1.86
10	002508	老板电器	2,585,083.88	1.86
11	600988	赤峰黄金	2,483,918.01	1.78
12	600031	三一重工	2,465,939.00	1.77
13	002812	恩捷股份	2,457,340.00	1.76
14	000547	航天发展	2,401,816.00	1.72
15	300454	深信服	2,356,221.00	1.69
16	002555	三七互娱	2,347,317.00	1.68
17	603005	晶方科技	2,336,188.08	1.68
18	300012	华测检测	2,306,289.86	1.66

19	002791	坚朗五金	2,299,882.00	1.65
20	600845	宝信软件	2,299,175.00	1.65

### 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	679,945,406.20
卖出股票收入（成交）总额	488,270,621.18

### 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC2007	IC2007	2	2,319,760.00	38,720.00	-
公允价值变动总额合计（元）					38,720.00
股指期货投资本期收益（元）					0.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					38,720.00

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

在股指期货投资上，本基金以避险保值和有效管理为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

## 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

本基金于本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金于本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金于本报告期内未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	403,668.50
2	应收证券清算款	1,957,135.41
3	应收股利	-
4	应收利息	9,650.82
5	应收申购款	6,058,975.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,429,430.69

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 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
4,378	57,953.61	217,750,248.01	85.82%	35,970,650.92	14.18%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	1,933,270.53	0.7620%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额总数	发起份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有 资金	10,000,600.00	3.94	10,000,600.00	3.94	36 个月
基金管理人高级 管理人员	244,326.56	0.10	0.00	0.00	0 个月
基金经理等人员	284,194.86	0.11	0.00	0.00	0 个月
基金管理人股东	2,711,766.77	1.07	0.00	0.00	0 个月
其他	0.00	0.00	0.00	0.00	0 个月
合计	13,240,888.19	5.22	10,000,600.00	3.94	36 个月



## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年3月19日）基金份额总额	177,856,344.09
本报告期期初基金份额总额	114,940,759.86
本报告期基金总申购份额	200,307,419.06
减：本报告期基金总赎回份额	61,527,279.99
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	253,720,898.93

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。

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、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

本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券	2	441,133,125.69	37.94%	234,374.91	34.15%	-
海通证券	2	378,726,057.85	32.57%	201,220.22	29.32%	-
银河证券	2	224,829,480.06	19.34%	164,418.03	23.96%	-
中银国际证券	2	117,990,824.06	10.15%	86,285.81	12.57%	-

**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
方正证券	192,112.40	24.42%	-	-	-	-
海通证券	41,480.32	5.27%	-	-	-	-
银河证券	553,147.60	70.31%	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-

**10.8 其他重大事件**

本报告期内本基金未发生其他重大事件。

## § 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

截止本报告期末，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——上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 11 楼

### 12.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。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

2020 年 8 月 31 日