

# 西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金

## 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：西部利得基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 25 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 2021 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 基金管理人及基金托管人                         | 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                                | 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             | 10        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 11        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 11        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 12        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 12        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>12</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 12        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 12        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 12        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>12</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 12        |
| 6.2 利润表                                 | 14        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 15        |
| 6.4 报表附注                                | 16        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>41</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 41        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 41        |
| 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       | 43        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 47        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 49        |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 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 .....    | 49        |
| 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 ..... | 49        |
| 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 ..... | 49        |
| 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 .....    | 49        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....             | 50        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 50        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                         | 50        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>51</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 51        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 52        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....      | 52        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>53</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>53</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 53        |
| 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 .....      | 53        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 53        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 53        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 54        |
| 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 .....         | 54        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 54        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 55        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>55</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 .....    | 55        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 55        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>55</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 55        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 55        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 55        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                        |                  |
|-----------------|------------------------|------------------|
| 基金名称            | 西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金 |                  |
| 基金简称            | 西部利得沪深 300 指数          |                  |
| 基金主代码           | 673100                 |                  |
| 基金运作方式          | 契约型开放式                 |                  |
| 基金合同生效日         | 2018 年 12 月 27 日       |                  |
| 基金管理人           | 西部利得基金管理有限公司           |                  |
| 基金托管人           | 平安银行股份有限公司             |                  |
| 报告期末基金份额总额      | 611,202,489.86 份       |                  |
| 基金合同存续期         | 不定期                    |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 西部利得沪深 300 指数 A        | 西部利得沪深 300 指数 C  |
| 下属分级基金的交易代码     | 673100                 | 673101           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 284,132,213.86 份       | 327,070,276.00 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                       |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金为股票指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的投资收益，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沪深 300 指数成分股，维持高股票仓位，风格偏蓝筹，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，力争获得超越业绩比较基准的收益。（详见《基金合同》） |
| 业绩比较基准 | 本基金的标的指数为：沪深 300 指数。<br>本基金业绩比较基准为：沪深 300 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。<br>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             | 平安银行股份有限公司                    |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 赵毅                       | 李帅帅                           |
|         | 联系电话 | 021-38572888             | 0755-25878287                 |
|         | 电子邮箱 | service@westleadfund.com | LISHUAISHUAI130@pingan.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 4007-007-818             | 95511-3                       |

|       |                                        |                                       |
|-------|----------------------------------------|---------------------------------------|
| 传真    | 021-38572750                           | 0755-82080387                         |
| 注册地址  | 中国（上海）自由贸易试验区耀<br>体路 276 号 901 室-908 室 | 广东省深圳市罗湖区深南东路<br>5047 号               |
| 办公地址  | 中国（上海）自由贸易试验区耀<br>体路 276 号 901 室-908 室 | 广东省深圳市福田区益田路 5023<br>号平安金融中心 B 座 26 楼 |
| 邮政编码  | 200126                                 | 518001                                |
| 法定代表人 | 何方                                     | 谢永林                                   |

## 2.4 信息披露方式

|                         |                                             |
|-------------------------|---------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称          | 《中国证券报》                                     |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网<br>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<br>耀商务广场 3 号楼 9 层 |

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据<br>和指标 | 报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日) |                 |
|-------------------|-------------------------------------|-----------------|
|                   | 西部利得沪深 300 指数 A                     | 西部利得沪深 300 指数 C |
| 本期已实现收益           | 38,221,163.23                       | 86,237,556.67   |
| 本期利润              | 18,208,987.04                       | 37,926,795.77   |
| 加权平均基金份<br>额本期利润  | 0.0658                              | 0.0843          |
| 本期加权平均净<br>值利润率   | 3.07%                               | 3.93%           |
| 本期基金份额净<br>值增长率   | 5.87%                               | 5.65%           |
| 3.1.2 期末数据<br>和指标 | 报告期末(2021 年 6 月 30 日)               |                 |

|              |                       |                |
|--------------|-----------------------|----------------|
| 期末可供分配利润     | 203,201,080.80        | 218,641,577.23 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.7152                | 0.6685         |
| 期末基金资产净值     | 634,855,534.42        | 725,371,070.29 |
| 期末基金份额净值     | 2.2344                | 2.2178         |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2021 年 6 月 30 日) |                |
| 基金份额累计净值增长率  | 140.62%               | 134.24%        |

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（除暂估附加税）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与本期暂估附加税费的合计值。

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

西部利得沪深 300 指数 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 | 0.83%    | 0.92%       | -1.91%     | 0.76%         | 2.74%  | 0.16% |
| 过去三个月 | 8.37%    | 0.97%       | 3.32%      | 0.93%         | 5.05%  | 0.04% |
| 过去六个月 | 5.87%    | 1.39%       | 0.29%      | 1.25%         | 5.58%  | 0.14% |
| 过去一年  | 44.95%   | 1.34%       | 24.19%     | 1.27%         | 20.76% | 0.07% |

|                |         |       |        |       |        |       |
|----------------|---------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 自基金合同生效起<br>至今 | 140.62% | 1.33% | 69.78% | 1.27% | 70.84% | 0.06% |
|----------------|---------|-------|--------|-------|--------|-------|

西部利得沪深 300 指数 C

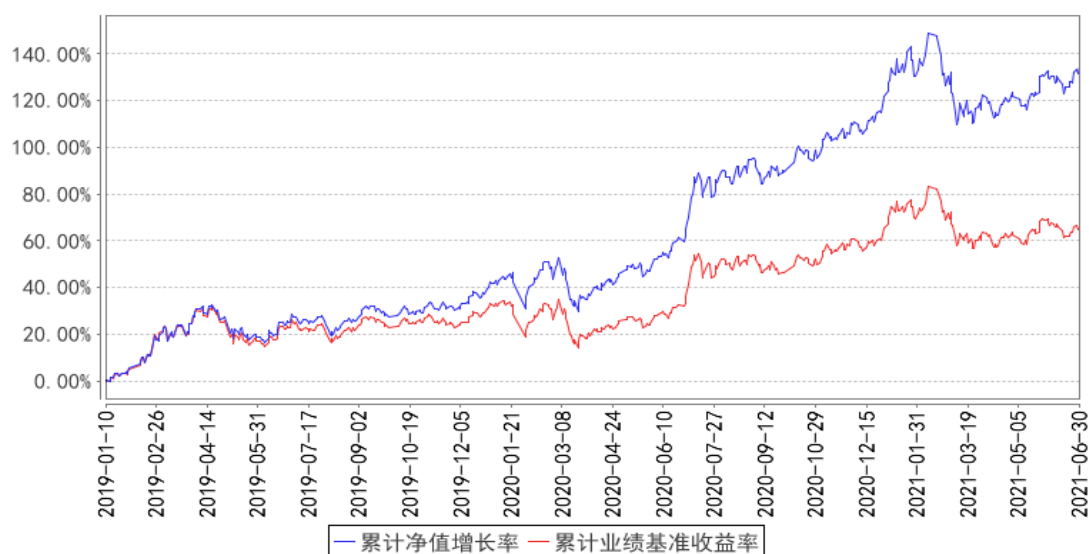
| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①—③    | ②—④   |
|----------------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去一个月          | 0.80%        | 0.92%               | -1.91%         | 0.76%                 | 2.71%  | 0.16% |
| 过去三个月          | 8.26%        | 0.97%               | 3.32%          | 0.93%                 | 4.94%  | 0.04% |
| 过去六个月          | 5.65%        | 1.39%               | 0.29%          | 1.25%                 | 5.36%  | 0.14% |
| 过去一年           | 44.36%       | 1.34%               | 24.19%         | 1.27%                 | 20.17% | 0.07% |
| 自基金合同生效起<br>至今 | 134.24%      | 1.33%               | 65.77%         | 1.27%                 | 68.47% | 0.06% |

### 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

西部利得沪深300指数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



西部利得沪深300指数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，注册资本人民币 35000.00 万元整，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。目前公司拥有公募基金、特定客户资产管理业务、受托管理保险资金等资格。

公司在“绝对收益”领域采取稳步推进策略，已发展为一家以固收+和量化指数投资为特色、以主动管理权益和混合资产投资为驱动的多元化资产管理公司。致力成为行业基础产品供应商。西部利得基金始终将投资人利益放首位，为投资人提供多样化的资产配置解决方案。

公司一直坚持“专业、诚信”的经营理念，成立至今已发行了货币型、债券型、混合型、指数型、股票型等多种类型的基金产品共 49 只，形成了较为完善的产品线，满足不同风险偏好的投资者需求。

#### 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 | 公募量化 | 2018 年          | -    | 8 年    | 复旦大学计算机应用技术硕士，曾任光大 |

|         |                      |                        |  |     |                                                                                    |
|---------|----------------------|------------------------|--|-----|------------------------------------------------------------------------------------|
| 衍       | 投资部副<br>总经理、<br>基金经理 | 12 月 27<br>日           |  |     | 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<br>骅 | 基金经理<br>助理           | 2020 年<br>11 月 13<br>日 |  | 6 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。      |

注：1. 任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、本基金《基金合同》等法律文件和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，力争为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

投资策略上，本基金始终维持高股票仓位，持仓风格相较基准偏成长，行业配置参考沪深 300 指数，股票持仓分散以此弱化个股黑天鹅的影响。基金经理对自己能力的认知是：优选股票最易，

风格判断其次，而择时最难。只有在择时可能带来极高赔率的情况下，克制而谦逊的择时才会带来部分超额收益。本基金努力通过选股获得相对于沪深 300 指数的超额收益，以期打造优质的沪深 300 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 2021 年三季度，影响 A 股的主要有三股力量。

其一是外需持续高景气+通胀若隐若现的宏观背景。

第二季度的 PMI 新订单、新出口订单、工业生产、投资、社融、房企资金来源等多项反映经济运行指标出现下滑；外需持续高景气，并且可能继续超预期；大宗商品价格通胀指数则处于近几年高位。几项因素叠加后对 A 股影响略偏负面。因子配置上需要兼顾高成长和低估值。

其二上市公司二、三季度盈利增速。

财报期，上市公司盈利增速是 A 股行业配置的重要参考指标。2021 年 Q2 和 Q3 的上市公司盈利增速可能是未来造成 A 股板块间差异的主要原因之一。

其三是核心资产偏好的降温。

以茅指数为代表的核心资产在过去 4 年中持续战胜以中证 500 指数为代表的中盘股。这一趋势在今年 2 月下旬戛然而止。春节后，中盘股相对于大盘股表现出持续的超额收益。这个趋势可能还将持续一个季度。做出这一预判的线索有三，中证 500 指数历史估值分位数明显低于沪深 300 指数估值历史分位数；今年 2 月和 3 月核心资产的大幅回撤中断了核心资产的趋势交易；雪球结构、量化私募产品、公募新发基金、保险等机构调整持仓似乎都更偏好于中盘股。

#### 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

本报告期，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

#### 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

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、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：西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产             | 附注号        | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产:</b>     |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 91,545,114.93                  | 95,421,421.12                    |
| 结算备付金           |            | 16,183,576.83                  | 8,161,025.82                     |
| 存出保证金           |            | 3,196,187.75                   | 7,373,803.14                     |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 1,255,758,821.95               | 1,302,148,438.83                 |
| 其中: 股票投资        |            | 1,255,758,821.95               | 1,302,148,438.83                 |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | -                              | -                                |
| 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         |            | 14,666,346.45                  | 7,853,512.40                     |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 44,858.56                      | 52,939.60                        |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 4,137,431.42                   | 71,470,304.38                    |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 1,385,532,337.89               | 1,492,481,445.29                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2020 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         |            | -                              | 10,088,908.43                    |
| 应付赎回款           |            | 21,233,747.37                  | 2,452,269.62                     |
| 应付管理人报酬         |            | 890,230.55                     | 832,682.35                       |
| 应付托管费           |            | 166,918.20                     | 156,127.90                       |
| 应付销售服务费         |            | 236,746.73                     | 308,823.26                       |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 2,496,525.88                   | 814,410.07                       |
| 应交税费            |            | -                              | 40,963.76                        |
| 应付利息            |            | -                              | -                                |
| 应付利润            |            | -                              | -                                |
| 递延所得税负债         |            | -                              | -                                |
| 其他负债            | 6.4.7.8    | 281,564.45                     | 241,240.69                       |
| 负债合计            |            | 25,305,733.18                  | 14,935,426.08                    |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                                |                                  |
| 实收基金            | 6.4.7.9    | 611,202,489.86                 | 702,915,312.01                   |
| 未分配利润           | 6.4.7.10   | 749,024,114.85                 | 774,630,707.20                   |

|            |  |                  |                  |
|------------|--|------------------|------------------|
| 所有者权益合计    |  | 1,360,226,604.71 | 1,477,546,019.21 |
| 负债和所有者权益总计 |  | 1,385,532,337.89 | 1,492,481,445.29 |

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，西部利得沪深 300 指数 A 基金份额净值 2.2344 元，基金份额总额 284,132,213.86 份；西部利得沪深 300 指数 C 基金份额净值 2.2178 元，基金份额总额 327,070,276.00 份。西部利得沪深 300 指数份额总额合计为 611,202,489.86 份。

## 6.2 利润表

会计主体：西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                    | 附注号        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年<br>6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年<br>6 月 30 日 |
|------------------------|------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 一、收入                   |            | 74,686,010.25                            | 26,363,530.75                                 |
| 1. 利息收入                |            | 1,187,547.67                             | 123,151.25                                    |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.11   | 1,186,799.82                             | 123,151.25                                    |
| 债券利息收入                 |            | 747.85                                   | —                                             |
| 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）      |            | 141,090,823.73                           | 16,804,286.57                                 |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.12   | 134,014,980.09                           | 14,826,756.56                                 |
| 基金投资收益                 | —          | —                                        | —                                             |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.13   | 628,516.69                               | —                                             |
| 资产支持证券投资               | 6.4.7.13.5 | —                                        | —                                             |
| 收益                     |            |                                          |                                               |
| 贵金属投资收益                | 6.4.7.14   | —                                        | —                                             |
| 衍生工具收益                 | 6.4.7.15   | -1,916,265.11                            | -3,345.00                                     |
| 股利收益                   | 6.4.7.16   | 8,363,592.06                             | 1,980,875.01                                  |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | -68,326,660.05                           | 9,371,284.62                                  |
| 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   | 734,298.90                               | 64,808.31                                     |
| 减：二、费用                 |            | 18,550,227.44                            | 2,152,030.39                                  |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 6,210,674.95                             | 672,660.24                                    |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.2 | 1,164,501.54                             | 126,123.78                                    |

|                     |            |               |               |
|---------------------|------------|---------------|---------------|
| 3. 销售服务费            | 6.4.10.2.3 | 1,932,165.37  | 294,338.20    |
| 4. 交易费用             | 6.4.7.19   | 9,039,353.26  | 874,372.81    |
| 5. 利息支出             |            | -             | -             |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |            | -             | -             |
| 6. 税金及附加            |            | 5,457.86      | -             |
| 7. 其他费用             | 6.4.7.20   | 198,074.46    | 184,535.36    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |            | 56,135,782.81 | 24,211,500.36 |
| 减：所得税费用             |            | -             | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |            | 56,135,782.81 | 24,211,500.36 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 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）                        | 702,915,312.01                        | 774,630,707.20  | 1,477,546,019.21  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                     | 56,135,782.81   | 56,135,782.81     |
| 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）      | -91,712,822.15                        | -81,742,375.16  | -173,455,197.31   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 493,976,553.97                        | 589,368,235.64  | 1,083,344,789.61  |
| 2. 基金赎回款                               | -585,689,376.12                       | -671,110,610.80 | -1,256,799,986.92 |
| 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）                        | 611,202,489.86                        | 749,024,114.85  | 1,360,226,604.71  |

| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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)                        | 106,073,633.68                             | 34,705,176.80  | 140,778,810.48  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                                          | 24,211,500.36  | 24,211,500.36   |
| 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)      | 57,793,038.22                              | 29,004,688.76  | 86,797,726.98   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 192,494,897.73                             | 74,679,832.29  | 267,174,730.02  |
| 2. 基金赎回款                               | -134,701,859.51                            | -45,675,143.53 | -180,377,003.04 |
| 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)                        | 163,866,671.90                             | 87,921,365.92  | 251,788,037.82  |

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

西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2016]2113 号批复核准,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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、本基金《基金合同》、《招募说明书》等相关法律文件负责公开募集。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 2.00 亿元,业经毕马威华振会计师事务所出具验资报告予以验证。经向中国证监会备案,本基金《基金合同》于 2017 年 3 月 21 日正式生效。本基

金的基金管理人为西部利得基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据原基金的基金管理人西部利得基金管理有限公司于 2018 年 12 月 28 日发布的《关于西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，自 2018 年 12 月 27 日起，原基金更名为西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金，《西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效，《西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》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，基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为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。

本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。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 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<年度报告和半年度报告>》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 2021 半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 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

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》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。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<br>2021 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 91,545,114.93          |
| 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          | 91,545,114.93 |

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<br>2021 年 6 月 30 日 |                  |               |
|---------------|------------------------|------------------|---------------|
|               | 成本                     | 公允价值             | 公允价值变动        |
| 股票            | 1,185,429,097.28       | 1,255,758,821.95 | 70,329,724.67 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                      | -                | -             |
| 债券            | 交易所市场                  | -                | -             |
|               | 银行间市场                  | -                | -             |
|               | 合计                     | -                | -             |
| 资产支持证券        | -                      | -                | -             |
| 基金            | -                      | -                | -             |
| 其他            | -                      | -                | -             |
| 合计            | 1,185,429,097.28       | 1,255,758,821.95 | 70,329,724.67 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

| 项目        | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |      |    |    |
|-----------|------------------------|------|----|----|
|           | 合同/名义<br>金额            | 公允价值 |    | 备注 |
|           |                        | 资产   | 负债 |    |
| 利率衍生工具    | -                      | -    | -  |    |
| 货币衍生工具    | -                      | -    | -  |    |
| 权益衍生工具    | 12,584,736.00          | -    | -  |    |
| 其中：股指期货投资 | 12,584,736.00          | -    | -  |    |
| 其他衍生工具    | -                      | -    | -  |    |
| 合计        | 12,584,736.00          | -    | -  |    |

#### 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<br>2021 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 41,811.56              |
| 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  | 2,281.50               |
| 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 | —                      |
| 应收出借证券利息   | —                      |
| 其他         | 765.50                 |
| 合计         | 44,858.56              |

## 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<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 2,496,525.88           |
| 银行间市场应付交易费用 | —                      |
| 合计          | 2,496,525.88           |

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | —                      |
| 应付赎回费       | 33,489.99              |
| 应付证券出借违约金   | —                      |
| 预提费用        | 194,219.55             |
| 应付指数使用费     | 53,854.91              |
| 合计          | 281,564.45             |

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

西部利得沪深 300 指数 A

| 项目            | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |                 |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额            |
| 上年度末          | 175,160,337.30                        | 175,160,337.30  |
| 本期申购          | 237,293,994.90                        | 237,293,994.90  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -128,322,118.34                       | -128,322,118.34 |
| -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           | 284,132,213.86                        | 284,132,213.86  |

## 西部利得沪深 300 指数 C

| 项目            | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |                 |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额            |
| 上年度末          | 527,754,974.71                        | 527,754,974.71  |
| 本期申购          | 256,682,559.07                        | 256,682,559.07  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -457,367,257.78                       | -457,367,257.78 |
| -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           | 327,070,276.00                        | 327,070,276.00  |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

## 西部利得沪深 300 指数 A

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计         |
|----------------|----------------|----------------|-----------------|
| 上年度末           | 95,275,746.33  | 99,263,585.46  | 194,539,331.79  |
| 本期利润           | 38,221,163.23  | -20,012,176.19 | 18,208,987.04   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 69,704,171.24  | 68,270,830.49  | 137,975,001.73  |
| 其中：基金申购款       | 156,047,144.81 | 131,033,654.20 | 287,080,799.01  |
| 基金赎回款          | -86,342,973.57 | -62,762,823.71 | -149,105,797.28 |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -               |
| 本期末            | 203,201,080.80 | 147,522,239.76 | 350,723,320.56  |

## 西部利得沪深 300 指数 C

| 项目             | 已实现部分           | 未实现部分           | 未分配利润合计         |
|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 上年度末           | 265,241,636.23  | 314,849,739.18  | 580,091,375.41  |
| 本期利润           | 86,237,556.67   | -48,310,760.90  | 37,926,795.77   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -132,837,615.67 | -86,879,761.22  | -219,717,376.89 |
| 其中：基金申购款       | 151,985,503.25  | 150,301,933.38  | 302,287,436.63  |
| 基金赎回款          | -284,823,118.92 | -237,181,694.60 | -522,004,813.52 |
| 本期已分配利润        | -               | -               | -               |
| 本期末            | 218,641,577.23  | 179,659,217.06  | 398,300,794.29  |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 1,111,722.25                          |
| 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 | 47,173.93                             |
| 其他        | 27,903.64                             |
| 合计        | 1,186,799.82                          |

注：其他包括结算保证金利息收入和申购款利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|------------------|----------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 134,014,980.09             |
| 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               | 134,014,980.09             |

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

|            | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 4,038,755,488.93                |
| 减：卖出股票成本总额 | 3,904,740,508.84                |
| 买卖股票差价收入   | 134,014,980.09                  |

#### 6.4.7.12.3 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。

#### 6.4.7.13 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<br>2021年1月1日至2021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 | 628,516.69                 |
| 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                            | 628,516.69                 |

##### 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<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 4,502,265.27               |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 3,873,000.00               |
| 减：应收利息总额                | 748.58                     |
| 买卖债券差价收入                | 628,516.69                 |

##### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期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有买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.15.2 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<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|----------|-------------------------------------------|
| 股指期货投资收益 | -1,916,265.11                             |

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 8,363,592.06                          |
| 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            | 8,363,592.06                          |

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | -67,166,648.71                        |
| 股票投资                   | -67,166,648.71                        |
| 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                | -1,191,036.00                         |
| 权证投资                   | -                                     |
| 期货投资                   | -1,191,036.00                         |
| 3. 其他                  | -                                     |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -31,024.66                            |
| 合计                     | -68,326,660.05                        |

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 729,968.62                            |
| 基金转换费收入 | 4,330.28                              |
| 合计      | 734,298.90                            |

注：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。

## 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 9,039,353.26                          |
| 银行间市场交易费用 | -                                     |
| 合计        | 9,039,353.26                          |

## 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-------|---------------------------------------|
| 审计费用  | 34,712.18                             |
| 信息披露费 | 59,507.37                             |

|         |            |
|---------|------------|
| 证券出借违约金 | -          |
| 指数使用费   | 103,854.91 |
| 合计      | 198,074.46 |

#### 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   |
| 平安银行股份有限公司          | 基金托管人          |
| 西部证券股份有限公司          | 基金管理人的股东       |
| 利得科技有限公司            | 基金管理人的股东       |
| 西部利得-沔泽 2 号单一资产管理计划 | 基金管理人管理的资产管理计划 |
| 西部利得-沔泽 3 号单一资产管理计划 | 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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |                         | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                         |
|-------|---------------------------------------|-------------------------|--------------------------------------------|-------------------------|
|       | 成交金额                                  | 占当期股票<br>成交总额的比例<br>(%) | 成交金额                                       | 占当期股票<br>成交总额的比例<br>(%) |
| 西部证券  | 4,620,183,398.27                      | 58.08                   | 872,425,225.29                             | 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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日      |                    |              |                      |
|-------|--------------------------------------------|--------------------|--------------|----------------------|
|       | 当期<br>佣金                                   | 占当期佣金总量<br>的比例 (%) | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 (%) |
| 西部证券  | 1,992,697.41                               | 46.88              | 238,902.03   | 9.57                 |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                    |              |                      |
|       | 当期<br>佣金                                   | 占当期佣金总量<br>的比例 (%) | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 (%) |
| 西部证券  | 376,276.52                                 | 100.00             | 169,213.86   | 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<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年<br>6 月 30 日 |
|-----------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 6,210,674.95                             | 672,660.24                                    |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,174,648.06                             | 87,956.50                                     |

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 0.80% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.80\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,164,501.54                          | 126,123.78                                 |

注：支付基金托管人平安银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15%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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

#### 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<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日      |                    |            |
|----------------|--------------------------------------------|--------------------|------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |                    |            |
|                | 西部利得沪深 300 指数<br>A                         | 西部利得沪深 300 指数<br>C | 合计         |
| 平安银行           | —                                          | 3,773.61           | 3,773.61   |
| 西部利得基金         | —                                          | 841,531.98         | 841,531.98 |
| 西部证券           | —                                          | 1,674.76           | 1,674.76   |
| 合计             | —                                          | 846,980.35         | 846,980.35 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                    |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |                    |            |
|                | 西部利得沪深 300 指数<br>A                         | 西部利得沪深 300 指数<br>C | 合计         |
| 平安银行           | 0.00                                       | 230.35             | 230.35     |
| 西部利得基金         | 0.00                                       | 202,975.48         | 202,975.48 |
| 西部证券           | 0.00                                       | 11.91              | 11.91      |
| 合计             | 0.00                                       | 203,217.74         | 203,217.74 |

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：日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.40% / 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未与关联方进行转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行转融通证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本基金本报告期及上年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

份额单位：份

西部利得沪深 300 指数 C

| 关联方名称                   | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |                             | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |                             |
|-------------------------|------------------------|-----------------------------|--------------------------|-----------------------------|
|                         | 持有的<br>基金份额            | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比例<br>(%) | 持有的<br>基金份额              | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比例<br>(%) |
| 西部利得-沅泽 2 号单一<br>资产管理计划 | -                      | -                           | 2,151,433.13             | 0.3061                      |
| 西部利得-沅泽 3 号单一<br>资产管理计划 | -                      | -                           | 2,151,433.13             | 0.3061                      |

注：除管理人之外的其他关联方在本报告期内未持有西部利得沪深 300A 类份额。

#### 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<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |        | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 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 |

|            |               |              |               |            |
|------------|---------------|--------------|---------------|------------|
| 平安银行股份有限公司 | 91,545,114.93 | 1,111,722.25 | 16,127,417.50 | 112,438.52 |
|------------|---------------|--------------|---------------|------------|

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

#### 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

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(2021 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 |
| 300614               | 百川畅银 | 2021 年 5 月 18 日  | 2021 年 11 月 25 日 | 锁定期    | 9.19  | 40.38  | 329      | 3,023.51  | 13,285.02 | —  |
| 300926               | 博俊科技 | 2020 年 12 月 29 日 | 2021 年 7 月 7 日   | 锁定期    | 10.76 | 22.20  | 359      | 3,862.84  | 7,969.80  | —  |
| 300929               | 华骐环保 | 2021 年 1 月 12 日  | 2021 年 7 月 20 日  | 锁定期    | 13.87 | 29.55  | 183      | 2,538.21  | 5,407.65  | —  |
| 300930               | 屹通新材 | 2021 年 1 月 13 日  | 2021 年 7 月 21 日  | 锁定期    | 13.11 | 24.48  | 322      | 4,221.42  | 7,882.56  | —  |
| 300932               | 三友联众 | 2021 年 1 月 15 日  | 2021 年 7 月 22 日  | 锁定期    | 24.69 | 31.71  | 492      | 12,147.48 | 15,601.32 | —  |
| 300933               | 中辰股份 | 2021 年 1 月 15 日  | 2021 年 7 月 22 日  | 锁定期    | 3.37  | 10.44  | 1,112    | 3,747.44  | 11,609.28 | —  |
| 300937               | 药易购  | 2021 年 1 月 20 日  | 2021 年 7 月 27 日  | 锁定期    | 12.25 | 53.71  | 244      | 2,989.00  | 13,105.24 | —  |
| 300940               | 南极光  | 2021 年 1 月 27 日  | 2021 年 8 月 3 日   | 锁定期    | 12.76 | 43.38  | 307      | 3,917.32  | 13,317.66 | —  |

|        |      |                       |                        |     |       |       |     |          |           |   |
|--------|------|-----------------------|------------------------|-----|-------|-------|-----|----------|-----------|---|
| 300941 | 创识科技 | 2021 年<br>2 月 2<br>日  | 2021 年<br>8 月 9<br>日   | 锁定期 | 21.31 | 49.94 | 399 | 8,502.69 | 19,926.06 | - |
| 300942 | 易瑞生物 | 2021 年<br>2 月 2<br>日  | 2021 年<br>8 月 9<br>日   | 锁定期 | 5.31  | 28.52 | 443 | 2,352.33 | 12,634.36 | - |
| 300945 | 曼卡龙  | 2021 年<br>2 月 3<br>日  | 2021 年<br>8 月 10<br>日  | 锁定期 | 4.56  | 18.88 | 474 | 2,161.44 | 8,949.12  | - |
| 300948 | 冠中生态 | 2021 年<br>2 月 18<br>日 | 2021 年<br>8 月 25<br>日  | 锁定期 | 13.00 | 27.42 | 324 | 2,808.00 | 8,884.08  | - |
| 300950 | 德固特  | 2021 年<br>2 月 24<br>日 | 2021 年<br>9 月 3<br>日   | 锁定期 | 8.41  | 39.13 | 219 | 1,841.79 | 8,569.47  | - |
| 300952 | 恒辉安防 | 2021 年<br>3 月 3<br>日  | 2021 年<br>9 月 13<br>日  | 锁定期 | 11.72 | 27.08 | 340 | 3,984.80 | 9,207.20  | - |
| 300953 | 震裕科技 | 2021 年<br>3 月 11<br>日 | 2021 年<br>9 月 22<br>日  | 锁定期 | 28.77 | 99.85 | 240 | 6,904.80 | 23,964.00 | - |
| 300955 | 嘉亨家化 | 2021 年<br>3 月 16<br>日 | 2021 年<br>9 月 24<br>日  | 锁定期 | 16.53 | 46.07 | 232 | 3,834.96 | 10,688.24 | - |
| 300958 | 建工修复 | 2021 年<br>3 月 18<br>日 | 2021 年<br>9 月 29<br>日  | 锁定期 | 8.53  | 27.22 | 300 | 2,559.00 | 8,166.00  | - |
| 300960 | 通业科技 | 2021 年<br>3 月 22<br>日 | 2021 年<br>9 月 29<br>日  | 锁定期 | 12.08 | 23.06 | 234 | 2,826.72 | 5,396.04  | - |
| 300961 | 深水海纳 | 2021 年<br>3 月 23<br>日 | 2021 年<br>9 月 30<br>日  | 锁定期 | 8.48  | 22.07 | 394 | 3,341.12 | 8,695.58  | - |
| 300962 | 中金辐照 | 2021 年<br>3 月 29<br>日 | 2021 年<br>10 月<br>11 日 | 锁定期 | 3.40  | 16.37 | 576 | 1,958.40 | 9,429.12  | - |
| 300963 | 中洲特材 | 2021 年<br>3 月 30<br>日 | 2021 年<br>10 月<br>11 日 | 锁定期 | 12.13 | 22.49 | 283 | 3,432.79 | 6,364.67  | - |
| 300966 | 共同药业 | 2021 年<br>3 月 31<br>日 | 2021 年<br>10 月<br>11 日 | 锁定期 | 8.24  | 31.54 | 286 | 2,356.64 | 9,020.44  | - |
| 300967 | 晓鸣股份 | 2021 年<br>4 月 2       | 2021 年<br>10 月         | 锁定期 | 4.54  | 11.54 | 507 | 2,301.78 | 5,850.78  | - |

|        |      |                       |                        |     |       |       |       |           |           |   |
|--------|------|-----------------------|------------------------|-----|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
|        |      | 日                     | 13 日                   |     |       |       |       |           |           |   |
| 300968 | 格林精密 | 2021 年<br>4 月 6<br>日  | 2021 年<br>10 月<br>15 日 | 锁定期 | 6.87  | 12.07 | 1,162 | 7,982.94  | 14,025.34 | - |
| 300971 | 博亚精工 | 2021 年<br>4 月 7<br>日  | 2021 年<br>10 月<br>15 日 | 锁定期 | 18.24 | 28.29 | 245   | 4,468.80  | 6,931.05  | - |
| 300972 | 万辰生物 | 2021 年<br>4 月 8<br>日  | 2021 年<br>10 月<br>19 日 | 锁定期 | 7.19  | 12.65 | 430   | 3,091.70  | 5,439.50  | - |
| 300975 | 商络电子 | 2021 年<br>4 月 14<br>日 | 2021 年<br>10 月<br>21 日 | 锁定期 | 5.48  | 13.03 | 492   | 2,696.16  | 6,410.76  | - |
| 300978 | 东箭科技 | 2021 年<br>4 月 15<br>日 | 2021 年<br>10 月<br>26 日 | 锁定期 | 8.42  | 13.60 | 593   | 4,993.06  | 8,064.80  | - |
| 300979 | 华利集团 | 2021 年<br>4 月 15<br>日 | 2021 年<br>10 月<br>26 日 | 锁定期 | 33.22 | 87.50 | 925   | 30,728.50 | 80,937.50 | - |
| 300981 | 中红医疗 | 2021 年<br>4 月 19<br>日 | 2021 年<br>10 月<br>27 日 | 锁定期 | 48.59 | 90.39 | 601   | 29,202.59 | 54,324.39 | - |
| 300982 | 苏文电能 | 2021 年<br>4 月 19<br>日 | 2021 年<br>10 月<br>27 日 | 锁定期 | 15.83 | 45.29 | 317   | 5,018.11  | 14,356.93 | - |
| 300985 | 致远新能 | 2021 年<br>4 月 21<br>日 | 2021 年<br>10 月<br>29 日 | 锁定期 | 24.90 | 24.81 | 295   | 7,345.50  | 7,318.95  | - |
| 300987 | 川网传媒 | 2021 年<br>4 月 28<br>日 | 2021 年<br>11 月<br>11 日 | 锁定期 | 6.79  | 26.81 | 301   | 2,043.79  | 8,069.81  | - |
| 300992 | 泰福泵业 | 2021 年<br>5 月 17<br>日 | 2021 年<br>11 月<br>25 日 | 锁定期 | 9.36  | 20.32 | 200   | 1,872.00  | 4,064.00  | - |
| 300995 | 奇德新材 | 2021 年<br>5 月 17<br>日 | 2021 年<br>11 月<br>26 日 | 锁定期 | 14.72 | 23.32 | 191   | 2,811.52  | 4,454.12  | - |
| 300996 | 普联软件 | 2021 年<br>5 月 26<br>日 | 2021 年<br>12 月 3<br>日  | 锁定期 | 20.81 | 42.23 | 241   | 5,015.21  | 10,177.43 | - |
| 300998 | 宁波方正 | 2021 年<br>5 月 25<br>日 | 2021 年<br>12 月 2<br>日  | 锁定期 | 6.02  | 21.32 | 201   | 1,210.02  | 4,285.32  | - |
| 301004 | 嘉益   | 2021 年                | 2021 年                 | 锁定期 | 7.81  | 21.94 | 312   | 2,436.72  | 6,845.28  | - |

|        |      |                        |                        |       |       |       |       |           |           |   |
|--------|------|------------------------|------------------------|-------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
|        | 股份   | 6 月 18<br>日            | 12 月<br>27 日           |       |       |       |       |           |           |   |
| 301007 | 德迈仕  | 2021 年<br>6 月 4<br>日   | 2021 年<br>12 月<br>16 日 | 锁定期   | 5.29  | 14.44 | 303   | 1,602.87  | 4,375.32  | - |
| 301010 | 晶雪节能 | 2021 年<br>6 月 9<br>日   | 2021 年<br>12 月<br>20 日 | 锁定期   | 7.83  | 17.61 | 218   | 1,706.94  | 3,838.98  | - |
| 301011 | 华立科技 | 2021 年<br>6 月 9<br>日   | 2021 年<br>12 月<br>17 日 | 锁定期   | 14.20 | 33.84 | 175   | 2,485.00  | 5,922.00  | - |
| 301012 | 扬电科技 | 2021 年<br>6 月 15<br>日  | 2021 年<br>12 月<br>22 日 | 锁定期   | 8.05  | 24.26 | 170   | 1,368.50  | 4,124.20  | - |
| 301013 | 利和兴  | 2021 年<br>6 月 21<br>日  | 2021 年<br>12 月<br>29 日 | 锁定期   | 8.72  | 27.11 | 471   | 4,107.12  | 12,768.81 | - |
| 301015 | 百洋医药 | 2021 年<br>6 月 22<br>日  | 2021 年<br>12 月<br>30 日 | 锁定期   | 7.64  | 38.83 | 462   | 3,529.68  | 17,939.46 | - |
| 301016 | 雷尔伟  | 2021 年<br>6 月 23<br>日  | 2021 年<br>12 月<br>30 日 | 锁定期   | 13.75 | 32.98 | 275   | 3,781.25  | 9,069.50  | - |
| 301017 | 漱玉平民 | 2021 年<br>6 月 23<br>日  | 2021 年<br>7 月 5<br>日   | 新股未上市 | 8.86  | 8.86  | 4,995 | 44,255.70 | 44,255.70 | - |
| 301017 | 漱玉平民 | 2021 年<br>6 月 23<br>日  | 2022 年<br>1 月 5<br>日   | 锁定期   | 8.86  | 8.86  | 555   | 4,917.30  | 4,917.30  | - |
| 301020 | 密封科技 | 2021 年<br>6 月 28<br>日  | 2021 年<br>07 月<br>06 日 | 新股未上市 | 10.64 | 10.64 | 3,789 | 40,314.96 | 40,314.96 | - |
| 301020 | 密封科技 | 2021 年<br>06 月 28<br>日 | 2022 年<br>01 月<br>06 日 | 锁定期   | 10.64 | 10.64 | 421   | 4,479.44  | 4,479.44  | - |
| 301021 | 英诺激光 | 2021 年<br>6 月 28<br>日  | 2021 年<br>07 月<br>06 日 | 新股未上市 | 9.46  | 9.46  | 2,609 | 24,681.14 | 24,681.14 | - |
| 301021 | 英诺激光 | 2021 年<br>06 月 28<br>日 | 2022 年<br>01 月<br>06 日 | 锁定期   | 9.46  | 9.46  | 290   | 2,743.40  | 2,743.40  | - |
| 605287 | 德才股份 | 2021 年<br>6 月 28<br>日  | 2021 年<br>7 月 6<br>日   | 新股未上市 | 31.56 | 31.56 | 349   | 11,014.44 | 11,014.44 | - |

|        |      |                       |                        |           |       |        |         |            |            |   |
|--------|------|-----------------------|------------------------|-----------|-------|--------|---------|------------|------------|---|
| 688087 | 英科再生 | 2021 年<br>6 月 30<br>日 | 2021 年<br>7 月 9<br>日   | 新股未<br>上市 | 21.96 | 21.96  | 2,469   | 54,219.24  | 54,219.24  | - |
| 688113 | 联测科技 | 2021 年<br>4 月 26<br>日 | 2021 年<br>11 月 8<br>日  | 锁定期       | 19.14 | 49.29  | 1,415   | 27,083.10  | 69,745.35  | - |
| 688117 | 圣诺生物 | 2021 年<br>5 月 26<br>日 | 2021 年<br>12 月 3<br>日  | 锁定期       | 17.90 | 35.97  | 1,672   | 29,928.80  | 60,141.84  | - |
| 688226 | 威腾电气 | 2021 年<br>6 月 28<br>日 | 2021 年<br>7 月 7<br>日   | 新股未<br>上市 | 6.42  | 6.42   | 2,693   | 17,289.06  | 17,289.06  | - |
| 688314 | 康拓医疗 | 2021 年<br>5 月 11<br>日 | 2021 年<br>11 月 18<br>日 | 锁定期       | 17.34 | 74.48  | 1,085   | 18,813.90  | 80,810.80  | - |
| 688425 | 铁建重工 | 2021 年<br>6 月 11<br>日 | 2021 年<br>12 月 22<br>日 | 锁定期       | 2.87  | 4.75   | 135,282 | 388,259.34 | 642,589.50 | - |
| 688468 | 科美诊断 | 2021 年<br>3 月 31<br>日 | 2021 年<br>10 月 11<br>日 | 锁定期       | 7.15  | 16.50  | 3,919   | 28,020.85  | 64,663.50  | - |
| 688499 | 利元亨  | 2021 年<br>6 月 23<br>日 | 2021 年<br>7 月 1<br>日   | 新股未<br>上市 | 38.85 | 38.85  | 2,149   | 83,488.65  | 83,488.65  | - |
| 688601 | 力芯微  | 2021 年<br>6 月 18<br>日 | 2021 年<br>12 月 28<br>日 | 锁定期       | 36.48 | 133.69 | 1,174   | 42,827.52  | 156,952.06 | - |
| 688609 | 九联科技 | 2021 年<br>3 月 15<br>日 | 2021 年<br>9 月 23<br>日  | 锁定期       | 3.99  | 15.29  | 10,372  | 41,384.28  | 158,587.88 | - |
| 688619 | 罗普特  | 2021 年<br>2 月 8<br>日  | 2021 年<br>8 月 23<br>日  | 锁定期       | 19.31 | 26.74  | 5,856   | 113,079.36 | 156,589.44 | - |
| 688630 | 芯碁微装 | 2021 年<br>3 月 25<br>日 | 2021 年<br>10 月 8<br>日  | 锁定期       | 15.23 | 58.42  | 3,397   | 51,736.31  | 198,452.74 | - |
| 688680 | 海优新材 | 2021 年<br>1 月 15<br>日 | 2021 年<br>7 月 22<br>日  | 锁定期       | 69.94 | 243.61 | 2,795   | 195,482.30 | 680,889.95 | - |

## 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 | 复牌日期 | 复牌开盘单 | 数量(股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|------|------|------|------|-------|------|-------|-------|--------|--------|----|
|------|------|------|------|-------|------|-------|-------|--------|--------|----|

|        |      |                 |        | 价      |                | 价      |        |              |              |   |
|--------|------|-----------------|--------|--------|----------------|--------|--------|--------------|--------------|---|
| 688368 | 晶丰明源 | 2021 年 6 月 21 日 | 重大事项停牌 | 335.26 | 2021 年 7 月 5 日 | 402.31 | 12,500 | 3,839,264.29 | 4,190,750.00 | - |

#### 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。

#### 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同责任，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<br>2021 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                     | 91,545,114.93  | -     | -     | -                | 91,545,114.93    |
| 结算备付金                    | 16,183,576.83  | -     | -     | -                | 16,183,576.83    |
| 存出保证金                    | 3,196,187.75   | -     | -     | -                | 3,196,187.75     |
| 交易性金融资产                  | -              | -     | -     | 1,255,758,821.95 | 1,255,758,821.95 |
| 应收利息                     | -              | -     | -     | 44,858.56        | 44,858.56        |
| 应收申购款                    | -              | -     | -     | 4,137,431.42     | 4,137,431.42     |
| 应收证券清算款                  | -              | -     | -     | 14,666,346.45    | 14,666,346.45    |
| 资产总计                     | 110,924,879.51 | -     | -     | 1,274,607,458.38 | 1,385,532,337.89 |
| 负债                       |                |       |       |                  |                  |
| 应付赎回款                    | -              | -     | -     | 21,233,747.37    | 21,233,747.37    |
| 应付管理人报酬                  | -              | -     | -     | 890,230.55       | 890,230.55       |
| 应付托管费                    | -              | -     | -     | 166,918.20       | 166,918.20       |
| 应付销售服务费                  | -              | -     | -     | 236,746.73       | 236,746.73       |
| 应付交易费用                   | -              | -     | -     | 2,496,525.88     | 2,496,525.88     |
| 其他负债                     | -              | -     | -     | 281,564.45       | 281,564.45       |
| 负债总计                     | -              | -     | -     | 25,305,733.18    | 25,305,733.18    |
| 利率敏感度缺口                  | 110,924,879.51 | -     | -     | 1,249,301,725.20 | 1,360,226,604.71 |
| 上年度末<br>2020 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                     | 95,421,421.12  | -     | -     | -                | 95,421,421.12    |
| 结算备付金                    | 8,161,025.82   | -     | -     | -                | 8,161,025.82     |
| 存出保证金                    | 7,373,803.14   | -     | -     | -                | 7,373,803.14     |
| 交易性金融资产                  | -              | -     | -     | 1,302,148,438.83 | 1,302,148,438.83 |
| 应收利息                     | -              | -     | -     | 52,939.60        | 52,939.60        |
| 应收申购款                    | -              | -     | -     | 71,470,304.38    | 71,470,304.38    |
| 应收证券清算款                  | -              | -     | -     | 7,853,512.40     | 7,853,512.40     |
| 资产总计                     | 110,956,250.08 | -     | -     | 1,381,525,195.21 | 1,492,481,445.29 |
| 负债                       |                |       |       |                  |                  |
| 应付赎回款                    | -              | -     | -     | 2,452,269.62     | 2,452,269.62     |
| 应付管理人报酬                  | -              | -     | -     | 832,682.35       | 832,682.35       |

|         |                |   |   |                   |                  |
|---------|----------------|---|---|-------------------|------------------|
| 应付托管费   | -              | - | - | 156,127.90        | 156,127.90       |
| 应付证券清算款 | -              | - | - | 10,088,908.43     | 10,088,908.43    |
| 应付销售服务费 | -              | - | - | 308,823.26        | 308,823.26       |
| 应付交易费用  | -              | - | - | 814,410.07        | 814,410.07       |
| 应交税费    | -              | - | - | 40,963.76         | 40,963.76        |
| 其他负债    | -              | - | - | 241,240.69        | 241,240.69       |
| 负债总计    | -              | - | - | 14,935,426.08     | 14,935,426.08    |
| 利率敏感度缺口 | 110,956,250.08 | - | - | -1,366,589,769.13 | 1,477,546,019.21 |

#### 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<br>2021 年 6 月 30 日 |               | 上年度末<br>2020 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  | 1,255,758,821.95       | 92.32         | 1,302,148,438.83         | 88.13         |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                      | -             | -                        | -             |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -                      | -             | -                        | -             |
| 衍生金融资产—权证投资   | -                      | -             | -                        | -             |
| 其他            | -                      | -             | -                        | -             |
| 合计            | 1,255,758,821.95       | 92.32         | 1,302,148,438.83         | 88.13         |

## 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 |                             |                        |
|----|----------------------|-----------------------------|------------------------|
|    | 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（2021 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2020 年 12 月 31 日） |
| 分析 | 业绩比较基准上升 5%          | 69,888,000.00               | 74,851,000.00          |
|    | 业绩比较基准下降 5%          | -69,888,000.00              | -74,851,000.00         |

## 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 2021 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为 1248473578.42 元，属于第二层级的余额为 7285243.53 元，无属于第三层级的余额（于 2020 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为 1294651222.81 元，属于第二层级的余额为 7497216.02 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 2021 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               | 1,255,758,821.95 | 90.63         |
|    | 其中: 股票             | 1,255,758,821.95 | 90.63         |
| 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       | 107,728,691.76   | 7.78          |
| 8  | 其他各项资产             | 22,044,824.18    | 1.59          |
| 9  | 合计                 | 1,385,532,337.89 | 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         | —              | —             |
| B  | 采矿业              | 39,506,328.00  | 2.90          |
| C  | 制造业              | 549,342,569.04 | 40.39         |
| 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           | —              | —             |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 26,889,636.00  | 1.98          |
| H  | 住宿和餐饮业           | —              | —             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 15,247,604.00  | 1.12          |

|   |               |                  |       |
|---|---------------|------------------|-------|
| J | 金融业           | 243,554,482.71   | 17.91 |
| K | 房地产业          | 32,635,547.13    | 2.40  |
| L | 租赁和商务服务业      | 42,691,165.10    | 3.14  |
| M | 科学研究和技术服务业    | 35,522,128.32    | 2.61  |
| 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       | 39,043,398.00    | 2.87  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -                | -     |
| S | 综合            | -                | -     |
|   | 合计            | 1,024,432,858.30 | 75.31 |

### 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         | 11,290.28      | 0.00         |
| B  | 采矿业              | -              | -            |
| C  | 制造业              | 202,240,339.53 | 14.87        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -              | -            |
| E  | 建筑业              | 3,892,955.37   | 0.29         |
| F  | 批发和零售业           | 6,045,675.58   | 0.44         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 4,451,031.00   | 0.33         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 14,605,512.46  | 1.07         |
| J  | 金融业              | 34,721.10      | 0.00         |
| 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    | 44,438.33      | 0.00         |
| 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        | 231,325,963.65 | 17.01 |

### 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  | 600519 | 贵州茅台 | 34,146    | 70,228,078.20 | 5.16         |
| 2  | 000858 | 五粮液  | 176,900   | 52,696,741.00 | 3.87         |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 943,200   | 51,112,008.00 | 3.76         |
| 4  | 002415 | 海康威视 | 598,494   | 38,602,863.00 | 2.84         |
| 5  | 603259 | 药明康德 | 226,848   | 35,522,128.32 | 2.61         |
| 6  | 300124 | 汇川技术 | 443,407   | 32,927,403.82 | 2.42         |
| 7  | 000725 | 京东方A | 5,224,600 | 32,601,504.00 | 2.40         |
| 8  | 300015 | 爱尔眼科 | 455,100   | 32,302,998.00 | 2.37         |
| 9  | 601888 | 中国中免 | 100,051   | 30,025,305.10 | 2.21         |
| 10 | 601012 | 隆基股份 | 336,420   | 29,887,552.80 | 2.20         |
| 11 | 601166 | 兴业银行 | 1,417,476 | 29,129,131.80 | 2.14         |
| 12 | 601318 | 中国平安 | 435,700   | 28,006,796.00 | 2.06         |
| 13 | 000661 | 长春高新 | 69,301    | 26,819,487.00 | 1.97         |
| 14 | 600809 | 山西汾酒 | 52,800    | 23,654,400.00 | 1.74         |
| 15 | 300014 | 亿纬锂能 | 226,500   | 23,540,145.00 | 1.73         |
| 16 | 600030 | 中信证券 | 919,661   | 22,936,345.34 | 1.69         |
| 17 | 600132 | 重庆啤酒 | 114,474   | 22,660,128.30 | 1.67         |
| 18 | 300529 | 健帆生物 | 255,500   | 22,064,980.00 | 1.62         |
| 19 | 603799 | 华友钴业 | 177,652   | 20,287,858.40 | 1.49         |
| 20 | 600028 | 中国石化 | 4,633,500 | 20,202,060.00 | 1.49         |
| 21 | 600919 | 江苏银行 | 2,779,900 | 19,737,290.00 | 1.45         |
| 22 | 601857 | 中国石油 | 3,649,200 | 19,304,268.00 | 1.42         |
| 23 | 002142 | 宁波银行 | 483,600   | 18,845,892.00 | 1.39         |
| 24 | 002601 | 龙佰集团 | 519,100   | 17,950,478.00 | 1.32         |
| 25 | 000002 | 万科A  | 742,573   | 17,680,663.13 | 1.30         |
| 26 | 601211 | 国泰君安 | 986,700   | 16,912,038.00 | 1.24         |
| 27 | 600837 | 海通证券 | 1,366,900 | 15,719,350.00 | 1.16         |
| 28 | 600845 | 宝信软件 | 299,560   | 15,247,604.00 | 1.12         |
| 29 | 600958 | 东方证券 | 1,511,000 | 15,094,890.00 | 1.11         |
| 30 | 600048 | 保利地产 | 1,242,100 | 14,954,884.00 | 1.10         |

|    |        |        |           |               |      |
|----|--------|--------|-----------|---------------|------|
| 31 | 601919 | 中远海控   | 487,000   | 14,872,980.00 | 1.09 |
| 32 | 603195 | 公牛集团   | 72,500    | 14,645,000.00 | 1.08 |
| 33 | 603501 | 韦尔股份   | 44,000    | 14,168,000.00 | 1.04 |
| 34 | 000568 | 泸州老窖   | 58,241    | 13,741,381.54 | 1.01 |
| 35 | 002241 | 歌尔股份   | 318,100   | 13,595,594.00 | 1.00 |
| 36 | 002027 | 分众传媒   | 1,346,000 | 12,665,860.00 | 0.93 |
| 37 | 601688 | 华泰证券   | 770,131   | 12,168,069.80 | 0.89 |
| 38 | 002371 | 北方华创   | 43,800    | 12,149,244.00 | 0.89 |
| 39 | 002049 | 紫光国微   | 73,900    | 11,394,641.00 | 0.84 |
| 40 | 601658 | 邮储银行   | 2,198,376 | 11,035,847.52 | 0.81 |
| 41 | 002594 | 比亚迪    | 40,800    | 10,240,800.00 | 0.75 |
| 42 | 601111 | 中国国航   | 1,009,200 | 7,851,576.00  | 0.58 |
| 43 | 600085 | 同仁堂    | 183,800   | 7,508,230.00  | 0.55 |
| 44 | 603806 | 福斯特    | 67,500    | 7,096,275.00  | 0.52 |
| 45 | 600763 | 通策医疗   | 16,400    | 6,740,400.00  | 0.50 |
| 46 | 000625 | 长安汽车   | 254,600   | 6,690,888.00  | 0.49 |
| 47 | 600176 | 中国巨石   | 410,800   | 6,371,508.00  | 0.47 |
| 48 | 000100 | TCL 科技 | 787,000   | 6,020,550.00  | 0.44 |
| 49 | 601633 | 长城汽车   | 137,500   | 5,993,625.00  | 0.44 |
| 50 | 601238 | 广汽集团   | 448,000   | 5,801,600.00  | 0.43 |
| 51 | 601021 | 春秋航空   | 73,200    | 4,165,080.00  | 0.31 |
| 52 | 600926 | 杭州银行   | 193,683   | 2,856,824.25  | 0.21 |
| 53 | 002414 | 高德红外   | 131       | 3,612.98      | 0.00 |

### 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  | 688699 | 明微电子 | 31,901  | 9,101,993.32 | 0.67         |
| 2  | 603486 | 科沃斯  | 39,200  | 8,940,736.00 | 0.66         |
| 3  | 002876 | 三利谱  | 129,920 | 8,405,824.00 | 0.62         |
| 4  | 688116 | 天奈科技 | 70,700  | 8,342,600.00 | 0.61         |
| 5  | 002833 | 弘亚数控 | 205,160 | 7,949,950.00 | 0.58         |
| 6  | 002920 | 德赛西威 | 63,800  | 7,023,104.00 | 0.52         |
| 7  | 300327 | 中颖电子 | 80,600  | 6,869,538.00 | 0.51         |
| 8  | 605369 | 拱东医疗 | 58,300  | 6,705,666.00 | 0.49         |
| 9  | 603919 | 金徽酒  | 160,300 | 6,591,536.00 | 0.48         |
| 10 | 603290 | 斯达半导 | 19,600  | 6,272,000.00 | 0.46         |
| 11 | 000825 | 太钢不锈 | 812,500 | 6,085,625.00 | 0.45         |
| 12 | 300755 | 华致酒行 | 145,800 | 5,950,098.00 | 0.44         |
| 13 | 300737 | 科顺股份 | 189,000 | 5,942,160.00 | 0.44         |
| 14 | 002709 | 天赐材料 | 55,570  | 5,922,650.60 | 0.44         |
| 15 | 603733 | 仙鹤股份 | 153,400 | 5,829,200.00 | 0.43         |

|    |        |      |           |              |      |
|----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 16 | 688016 | 心脉医疗 | 12,600    | 5,728,086.00 | 0.42 |
| 17 | 300034 | 钢研高纳 | 176,949   | 5,699,527.29 | 0.42 |
| 18 | 300373 | 扬杰科技 | 91,100    | 5,515,194.00 | 0.41 |
| 19 | 605111 | 新洁能  | 30,380    | 5,476,602.60 | 0.40 |
| 20 | 600499 | 科达制造 | 379,900   | 5,470,560.00 | 0.40 |
| 21 | 603008 | 喜临门  | 152,356   | 5,029,271.56 | 0.37 |
| 22 | 000830 | 鲁西化工 | 264,900   | 4,961,577.00 | 0.36 |
| 23 | 002614 | 奥佳华  | 216,800   | 4,906,184.00 | 0.36 |
| 24 | 603657 | 春光科技 | 150,000   | 4,822,500.00 | 0.35 |
| 25 | 603678 | 火炬电子 | 70,500    | 4,758,750.00 | 0.35 |
| 26 | 002154 | 报喜鸟  | 740,700   | 4,718,259.00 | 0.35 |
| 27 | 002645 | 华宏科技 | 289,400   | 4,624,612.00 | 0.34 |
| 28 | 002026 | 山东威达 | 336,400   | 4,595,224.00 | 0.34 |
| 29 | 601005 | 重庆钢铁 | 1,714,900 | 4,578,783.00 | 0.34 |
| 30 | 601678 | 滨化股份 | 575,200   | 4,549,832.00 | 0.33 |
| 31 | 603489 | 八方股份 | 19,000    | 4,491,220.00 | 0.33 |
| 32 | 603128 | 华贸物流 | 315,900   | 4,451,031.00 | 0.33 |
| 33 | 002429 | 兆驰股份 | 728,500   | 4,421,995.00 | 0.33 |
| 34 | 002240 | 盛新锂能 | 153,800   | 4,390,990.00 | 0.32 |
| 35 | 688368 | 晶丰明源 | 12,500    | 4,190,750.00 | 0.31 |
| 36 | 300724 | 捷佳伟创 | 35,500    | 4,118,355.00 | 0.30 |
| 37 | 600502 | 安徽建工 | 996,800   | 3,867,584.00 | 0.28 |
| 38 | 300009 | 安科生物 | 230,400   | 3,432,960.00 | 0.25 |
| 39 | 600688 | 上海石化 | 908,400   | 3,415,584.00 | 0.25 |
| 40 | 688068 | 热景生物 | 15,900    | 3,005,100.00 | 0.22 |
| 41 | 605099 | 共创草坪 | 70,700    | 2,996,266.00 | 0.22 |
| 42 | 688029 | 南微医学 | 9,000     | 2,805,210.00 | 0.21 |
| 43 | 300671 | 富满电子 | 8,400     | 1,105,776.00 | 0.08 |
| 44 | 688680 | 海优新材 | 2,795     | 680,889.95   | 0.05 |
| 45 | 688425 | 铁建重工 | 135,282   | 642,589.50   | 0.05 |
| 46 | 688630 | 芯碁微装 | 3,397     | 198,452.74   | 0.01 |
| 47 | 688609 | 九联科技 | 10,372    | 158,587.88   | 0.01 |
| 48 | 688601 | 力芯微  | 1,174     | 156,952.06   | 0.01 |
| 49 | 688619 | 罗普特  | 5,856     | 156,589.44   | 0.01 |
| 50 | 300919 | 中伟股份 | 610       | 99,430.00    | 0.01 |
| 51 | 688499 | 利元亨  | 2,149     | 83,488.65    | 0.01 |
| 52 | 300979 | 华利集团 | 925       | 80,937.50    | 0.01 |
| 53 | 688314 | 康拓医疗 | 1,085     | 80,810.80    | 0.01 |
| 54 | 688113 | 联测科技 | 1,415     | 69,745.35    | 0.01 |
| 55 | 688468 | 科美诊断 | 3,919     | 64,663.50    | 0.00 |
| 56 | 688117 | 圣诺生物 | 1,672     | 60,141.84    | 0.00 |
| 57 | 300981 | 中红医疗 | 601       | 54,324.39    | 0.00 |
| 58 | 688087 | 英科再生 | 2,469     | 54,219.24    | 0.00 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 59  | 301017 | 漱玉平民 | 5,550 | 49,173.00 | 0.00 |
| 60  | 301020 | C 密封 | 4,210 | 44,794.40 | 0.00 |
| 61  | 601528 | 瑞丰银行 | 2,230 | 34,721.10 | 0.00 |
| 62  | 301021 | C 英诺 | 2,899 | 27,424.54 | 0.00 |
| 63  | 300953 | 震裕科技 | 240   | 23,964.00 | 0.00 |
| 64  | 300941 | 创识科技 | 399   | 19,926.06 | 0.00 |
| 65  | 301015 | 百洋医药 | 462   | 17,939.46 | 0.00 |
| 66  | 688226 | 威腾电气 | 2,693 | 17,289.06 | 0.00 |
| 67  | 300932 | 三友联众 | 492   | 15,601.32 | 0.00 |
| 68  | 300982 | 苏文电能 | 317   | 14,356.93 | 0.00 |
| 69  | 300968 | 格林精密 | 1,162 | 14,025.34 | 0.00 |
| 70  | 001208 | 华菱线缆 | 1,754 | 13,558.42 | 0.00 |
| 71  | 300940 | 南极光  | 307   | 13,317.66 | 0.00 |
| 72  | 300614 | 百川畅银 | 329   | 13,285.02 | 0.00 |
| 73  | 300937 | 药易购  | 244   | 13,105.24 | 0.00 |
| 74  | 301013 | 利和兴  | 471   | 12,768.81 | 0.00 |
| 75  | 300942 | 易瑞生物 | 443   | 12,634.36 | 0.00 |
| 76  | 603171 | 税友股份 | 637   | 12,230.40 | 0.00 |
| 77  | 300933 | 中辰股份 | 1,112 | 11,609.28 | 0.00 |
| 78  | 300918 | 南山智尚 | 1,063 | 11,065.83 | 0.00 |
| 79  | 605287 | 德才股份 | 349   | 11,014.44 | 0.00 |
| 80  | 300955 | 嘉亨家化 | 232   | 10,688.24 | 0.00 |
| 81  | 300996 | 普联软件 | 241   | 10,177.43 | 0.00 |
| 82  | 300962 | 中金辐照 | 576   | 9,429.12  | 0.00 |
| 83  | 300952 | 恒辉安防 | 340   | 9,207.20  | 0.00 |
| 84  | 301016 | 雷尔伟  | 275   | 9,069.50  | 0.00 |
| 85  | 300966 | 共同药业 | 286   | 9,020.44  | 0.00 |
| 86  | 300945 | 曼卡龙  | 474   | 8,949.12  | 0.00 |
| 87  | 300948 | 冠中生态 | 324   | 8,884.08  | 0.00 |
| 88  | 300961 | 深水海纳 | 394   | 8,695.58  | 0.00 |
| 89  | 300950 | 德固特  | 219   | 8,569.47  | 0.00 |
| 90  | 300958 | 建工修复 | 300   | 8,166.00  | 0.00 |
| 91  | 300987 | 川网传媒 | 301   | 8,069.81  | 0.00 |
| 92  | 300978 | 东箭科技 | 593   | 8,064.80  | 0.00 |
| 93  | 300926 | 博俊科技 | 359   | 7,969.80  | 0.00 |
| 94  | 300930 | 屹通新材 | 322   | 7,882.56  | 0.00 |
| 95  | 300985 | 致远新能 | 295   | 7,318.95  | 0.00 |
| 96  | 300971 | 博亚精工 | 245   | 6,931.05  | 0.00 |
| 97  | 301004 | 嘉益股份 | 312   | 6,845.28  | 0.00 |
| 98  | 300975 | 商络电子 | 492   | 6,410.76  | 0.00 |
| 99  | 300963 | 中洲特材 | 283   | 6,364.67  | 0.00 |
| 100 | 301011 | 华立科技 | 175   | 5,922.00  | 0.00 |
| 101 | 300967 | 晓鸣股份 | 507   | 5,850.78  | 0.00 |

|     |        |      |     |          |      |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 102 | 300972 | 万辰生物 | 430 | 5,439.50 | 0.00 |
| 103 | 300929 | 华骐环保 | 183 | 5,407.65 | 0.00 |
| 104 | 300960 | 通业科技 | 234 | 5,396.04 | 0.00 |
| 105 | 300995 | 奇德新材 | 191 | 4,454.12 | 0.00 |
| 106 | 301007 | 德迈仕  | 303 | 4,375.32 | 0.00 |
| 107 | 300998 | 宁波方正 | 201 | 4,285.32 | 0.00 |
| 108 | 301012 | 扬电科技 | 170 | 4,124.20 | 0.00 |
| 109 | 300992 | 泰福泵业 | 200 | 4,064.00 | 0.00 |
| 110 | 301010 | 晶雪节能 | 218 | 3,838.98 | 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  | 600519 | 贵州茅台  | 101,230,006.50 | 6.85           |
| 2  | 000333 | 美的集团  | 101,129,054.44 | 6.84           |
| 3  | 601012 | 隆基股份  | 80,867,817.15  | 5.47           |
| 4  | 000858 | 五粮液   | 74,800,805.32  | 5.06           |
| 5  | 601888 | 中国中免  | 70,436,675.03  | 4.77           |
| 6  | 300015 | 爱尔眼科  | 62,522,727.97  | 4.23           |
| 7  | 000651 | 格力电器  | 53,039,222.00  | 3.59           |
| 8  | 000725 | 京东方 A | 51,322,253.66  | 3.47           |
| 9  | 002304 | 洋河股份  | 50,770,194.16  | 3.44           |
| 10 | 000568 | 泸州老窖  | 49,995,776.31  | 3.38           |
| 11 | 603833 | 欧派家居  | 46,889,504.13  | 3.17           |
| 12 | 002714 | 牧原股份  | 45,375,215.69  | 3.07           |
| 13 | 601919 | 中远海控  | 44,567,435.00  | 3.02           |
| 14 | 000661 | 长春高新  | 44,550,408.42  | 3.02           |
| 15 | 600276 | 恒瑞医药  | 43,955,578.81  | 2.97           |
| 16 | 600176 | 中国巨石  | 43,745,297.72  | 2.96           |
| 17 | 600036 | 招商银行  | 42,395,756.05  | 2.87           |
| 18 | 600690 | 海尔智家  | 42,254,787.00  | 2.86           |
| 19 | 601628 | 中国人寿  | 42,186,638.90  | 2.86           |
| 20 | 002601 | 龙佰集团  | 41,843,378.09  | 2.83           |
| 21 | 002027 | 分众传媒  | 41,260,924.41  | 2.79           |
| 22 | 600660 | 福耀玻璃  | 40,333,988.55  | 2.73           |
| 23 | 601878 | 浙商证券  | 39,166,442.50  | 2.65           |
| 24 | 600900 | 长江电力  | 38,607,475.79  | 2.61           |
| 25 | 300529 | 健帆生物  | 37,221,014.35  | 2.52           |
| 26 | 300014 | 亿纬锂能  | 36,812,655.95  | 2.49           |
| 27 | 002049 | 紫光国微  | 36,616,687.80  | 2.48           |
| 28 | 002415 | 海康威视  | 36,514,133.06  | 2.47           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 29 | 000338 | 潍柴动力 | 36,370,044.97 | 2.46 |
| 30 | 000786 | 北新建材 | 36,341,434.23 | 2.46 |
| 31 | 601336 | 新华保险 | 35,877,572.69 | 2.43 |
| 32 | 600809 | 山西汾酒 | 34,894,547.00 | 2.36 |
| 33 | 002142 | 宁波银行 | 34,075,125.00 | 2.31 |
| 34 | 300413 | 芒果超媒 | 34,029,700.43 | 2.30 |
| 35 | 600019 | 宝钢股份 | 30,592,240.19 | 2.07 |
| 36 | 600926 | 杭州银行 | 30,328,813.24 | 2.05 |
| 37 | 600030 | 中信证券 | 29,621,692.54 | 2.00 |

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  | 000333 | 美的集团 | 117,987,355.40 | 7.99           |
| 2  | 000651 | 格力电器 | 82,424,778.20  | 5.58           |
| 3  | 601012 | 隆基股份 | 81,896,521.67  | 5.54           |
| 4  | 600519 | 贵州茅台 | 80,244,668.00  | 5.43           |
| 5  | 000568 | 泸州老窖 | 68,949,394.68  | 4.67           |
| 6  | 601888 | 中国中免 | 68,042,619.00  | 4.61           |
| 7  | 600276 | 恒瑞医药 | 63,612,383.94  | 4.31           |
| 8  | 002304 | 洋河股份 | 58,238,472.86  | 3.94           |
| 9  | 000858 | 五粮液  | 50,683,303.57  | 3.43           |
| 10 | 600660 | 福耀玻璃 | 49,771,260.00  | 3.37           |
| 11 | 600887 | 伊利股份 | 49,683,645.96  | 3.36           |
| 12 | 300015 | 爱尔眼科 | 49,147,377.47  | 3.33           |
| 13 | 002475 | 立讯精密 | 46,499,471.04  | 3.15           |
| 14 | 603833 | 欧派家居 | 45,989,187.25  | 3.11           |
| 15 | 002714 | 牧原股份 | 44,741,265.74  | 3.03           |
| 16 | 600036 | 招商银行 | 43,945,367.17  | 2.97           |
| 17 | 002027 | 分众传媒 | 42,366,132.71  | 2.87           |
| 18 | 601628 | 中国人寿 | 42,333,804.17  | 2.87           |
| 19 | 300408 | 三环集团 | 41,357,533.32  | 2.80           |
| 20 | 002230 | 科大讯飞 | 40,179,564.94  | 2.72           |
| 21 | 600690 | 海尔智家 | 40,022,276.00  | 2.71           |
| 22 | 000338 | 潍柴动力 | 39,818,797.71  | 2.69           |
| 23 | 600900 | 长江电力 | 39,514,875.70  | 2.67           |
| 24 | 601878 | 浙商证券 | 38,015,023.75  | 2.57           |
| 25 | 601336 | 新华保险 | 37,764,576.81  | 2.56           |
| 26 | 601318 | 中国平安 | 37,394,790.04  | 2.53           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 27 | 300413 | 芒果超媒 | 36,459,363.96 | 2.47 |
| 28 | 002271 | 东方雨虹 | 36,371,308.68 | 2.46 |
| 29 | 000786 | 北新建材 | 35,446,090.69 | 2.40 |
| 30 | 601919 | 中远海控 | 34,608,632.32 | 2.34 |
| 31 | 600809 | 山西汾酒 | 34,112,976.00 | 2.31 |
| 32 | 601398 | 工商银行 | 34,053,171.00 | 2.30 |
| 33 | 600019 | 宝钢股份 | 33,879,693.65 | 2.29 |
| 34 | 600176 | 中国巨石 | 33,042,658.65 | 2.24 |
| 35 | 601899 | 紫金矿业 | 32,507,096.00 | 2.20 |
| 36 | 600309 | 万华化学 | 31,586,601.57 | 2.14 |
| 37 | 600763 | 通策医疗 | 31,429,771.50 | 2.13 |
| 38 | 688036 | 传音控股 | 31,184,081.13 | 2.11 |
| 39 | 300059 | 东方财富 | 31,014,953.85 | 2.10 |
| 40 | 600926 | 杭州银行 | 29,858,892.54 | 2.02 |
| 41 | 002508 | 老板电器 | 29,584,771.88 | 2.00 |

注：本表“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                  |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 3,925,517,540.67 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 4,038,755,488.93 |

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

本基金于本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

本基金于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

本基金于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          |
|-------------------|--------|----------|---------------|-------------|---------------|
| IF2107            | IF2107 | 8        | 12,458,880.00 | -125,856.00 | -             |
| 公允价值变动总额合计（元）     |        |          |               |             | -125,856.00   |
| 股指期货投资本期收益（元）     |        |          |               |             | -1,916,265.11 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） |        |          |               |             | -1,191,036.00 |

### 7.10.2 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 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

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   | 3,196,187.75  |
| 2  | 应收证券清算款 | 14,666,346.45 |
| 3  | 应收股利    | -             |

|   |       |               |
|---|-------|---------------|
| 4 | 应收利息  | 44,858.56     |
| 5 | 应收申购款 | 4,137,431.42  |
| 6 | 其他应收款 | —             |
| 7 | 待摊费用  | —             |
| 8 | 其他    | —             |
| 9 | 合计    | 22,044,824.18 |

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金于本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额<br>级别        | 持有人<br>户数<br>(户) | 户均持有的基金份<br>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<br>例 (%) | 持有份额          | 占总份额比<br>例 (%) |
| 西部利得沪深 300 指数 A | 41,093           | 6,914.37      | 196,696,828.13 | 69.23          | 87,435,385.73 | 30.77          |
| 西部利得            | 20,559           | 15,908.86     | 281,395,735.17 | 86.04          | 45,674,540.83 | 13.96          |

|                              |        |           |                |       |                |       |
|------------------------------|--------|-----------|----------------|-------|----------------|-------|
| 沪<br>深<br>300<br>指<br>数<br>C |        |           |                |       |                |       |
| 合<br>计                       | 60,093 | 10,170.94 | 478,092,563.30 | 78.22 | 133,109,926.56 | 21.78 |

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

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

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目                           | 份额级别            | 持有份额总数（份）  | 占基金总份额比例（%） |
|------------------------------|-----------------|------------|-------------|
| 基金管<br>理人所有从业<br>人员持有本基<br>金 | 西部利得沪深 300 指数 A | 345,312.08 | 0.1215      |
|                              | 西部利得沪深 300 指数 C | 129,653.10 | 0.0396      |
|                              | 合计              | 474,965.18 | 0.0777      |

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金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）。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                                         | 份额级别            | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、<br>基金投资和研发部门<br>负责人持有本开放式<br>基金 | 西部利得沪深 300 指数 A | 0~10              |
|                                            | 西部利得沪深 300 指数 C | —                 |
|                                            | 合计              | 0~10              |
| 本基金基金经理持有<br>本开放式基金                        | 西部利得沪深 300 指数 A | 0~10              |
|                                            | 西部利得沪深 300 指数 C | —                 |
|                                            | 合计              | 0~10              |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                   | 西部利得沪深 300 指数 A | 西部利得沪深 300 指数 C |
|--------------------------------------|-----------------|-----------------|
| 基金合同生效日<br>(2018 年 12 月 27 日) 基金份额总额 | 18,506,196.98   | —               |
| 本报告期期初基金份额总额                         | 175,160,337.30  | 527,754,974.71  |
| 本报告期基金总申购份额                          | 237,293,994.90  | 256,682,559.07  |
| 减：本报告期基金总赎回份额                        | 128,322,118.34  | 457,367,257.78  |
| 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                         | 284,132,213.86  | 327,070,276.00  |

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

基金管理人于 2021 年 1 月 7 日对外发布了公司董事及独立董事变更公告，董事长为何方先生、股东董事为李兴春先生、曲莉女士，当然董事为贺燕萍女士，独立董事为张成虎先生、吴弘先生；于 2021 年 1 月 11 日对外发布了公司高级管理人员变更公告，任命王宇、孙威、蔡晨研为公司副总经理。

2021 年 1 月 26 日，根据工作安排，陈正涛先生不再担任平安银行股份有限公司资产托管事业部总裁。2021 年 2 月 26 日，平安银行股份有限公司任命黄伟先生担任资产托管事业部副总裁（主持工作）。

## 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 |    |
| 西部证券 | 2      | 4,620,183,398.27 | 58.08%       | 1,992,697.41 | 46.88%     | -  |
| 光大证券 | 2      | 1,945,832,242.46 | 24.46%       | 1,422,986.94 | 33.48%     | -  |
| 国盛证券 | 2      | 603,482,365.75   | 7.59%        | 260,284.03   | 6.12%      | -  |
| 中信建投 | 2      | 567,369,730.99   | 7.13%        | 414,917.79   | 9.76%      | -  |
| 中银国际 | 2      | 218,014,193.63   | 2.74%        | 159,435.09   | 3.75%      | -  |
| 信达证券 | 2      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 中信证券 | 2      | -                | -            | -            | -          | -  |

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

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |              | 债券回购交易 |                | 权证交易 |              |
|------|------|--------------|--------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额   | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |

|      |              |        |   |   |   |   |
|------|--------------|--------|---|---|---|---|
| 西部证券 | -            | -      | - | - | - | - |
| 光大证券 | 1,050.00     | 0.02%  | - | - | - | - |
| 国盛证券 | -            | -      | - | - | - | - |
| 中信建投 | 262,756.57   | 5.84%  | - | - | - | - |
| 中银国际 | 4,238,458.70 | 94.14% | - | - | - | - |
| 信达证券 | -            | -      | - | - | - | - |
| 中信证券 | -            | -      | - | - | - | - |

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                    | 法定披露方式                               | 法定披露日期         |
|----|-------------------------|--------------------------------------|----------------|
| 1  | 西部利得基金管理有限公司基金管理人住所变更公告 | 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 | 2021 年 7 月 2 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

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

2021 年 3 月 31 日，基金管理人根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号—指数基金指引》等法律法规，对本基金基金合同、招募说明书、基金产品资料概要进行了修订。

## § 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 8:30-11:30，13:00-17:30。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](mailto:service@westleadfund.com)。

西部利得基金管理有限公司

2021 年 8 月 30 日