

西部利得量化成长混合型发起式证券投资 基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：西部利得基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	21

§ 8 投资组合报告	55
8.1 期末基金资产组合情况	55
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
8.3 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	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	71
8.6 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	71
8.7 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	71
8.8 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	72
8.9 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	72
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	72
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	72
8.12 投资组合报告附注	72
§ 9 基金份额持有人信息	73
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	73
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	74
9.3 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	74
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	74
§ 10 开放式基金份额变动	75
§ 11 重大事件揭示	75
11.1 基金份额持有人大会决议	75
11.2 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	75
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	76
11.4 基金投资策略的改变	76
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	76
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	76
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	76
11.8 其他重大事件	77
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	78
12.1 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	78
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	78
§ 13 备查文件目录	78
13.1 备查文件目录	78
13.2 存放地点	78
13.3 查阅方式	78

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金	
基金简称	西部利得量化成长混合	
基金主代码	000006	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年3月19日	
基金管理人	西部利得基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	918,971,587.91份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	西部利得量化成长混合 A	西部利得量化成长混合 C
下属分级基金的交易代码	000006	011228
报告期末下属分级基金的份额总额	871,285,833.91份	47,685,754.00份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	西部利得基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵毅
	联系电话	021-38572888
	电子邮箱	service@westleadfund.com
客户服务电话	4007-007-818	95599
传真	021-38572750	010-68121816
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区耀体路 276 号 901 室-908 室	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区耀体路 276 号 901 室-908 室	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	200126	100031
法定代表人	何方	谷澍

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
注册登记机构	西部利得基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区耀体路 276 号 901 室-908 室

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2021 年 1 月 13 日(基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日	2020 年		2019 年 3 月 19 日(基金合同生效日)-2019 年 12 月 31 日	2019 年
	西部利得量化成长混合 A	西部利得量化成长混合 C	西部利得量化成长混合 A	西部利得量化成长混合 C	西部利得量化成长混合 A	西部利得量化成长混合 C
本期已实现收益	411,256,638.18	17,414,343.96	154,971,728.02	-	18,115,694.44	-
本期利润	371,385,025.99	11,125,135.05	231,260,541.66	-	27,543,510.86	-

加权平均基金份额本期利润	0.4826	0.3258	0.8471	-	0.2016	-
本期加权平均净值利润率	21.33%	14.06%	48.18%	-	19.29%	-
本期基金份额净值增长率	28.11%	21.42%	71.81%	-	21.20%	-
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
期末可供分配利润	831,743,770.74	44,642,743.45	357,471,865.51	-	15,982,786.79	-
期末可供分配基金份额利润	0.9546	0.9362	0.6449	-	0.1391	-
期末基金资产净值	2,011,550,938.18	109,224,751.15	1,101,484,943.60	-	139,312,296.15	-
期末基金份额净值	2.3087	2.2905	1.9870	-	1.2120	-
3.1.3 累计期末指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	

基金份额累计净值增长率	166.77%	21.42%	108.23%	-	21.20%	-
-------------	---------	--------	---------	---	--------	---

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

西部利得量化成长混合 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
过去三个月	2.45%	1.19%	2.74%	0.57%	-0.29%	0.62%
过去六个月	5.66%	1.40%	6.17%	0.72%	-0.51%	0.68%
过去一年	28.11%	1.39%	11.81%	0.73%	16.30%	0.66%
自基金合同生效起至今	166.77%	1.37%	26.17%	1.01%	140.60%	0.36%

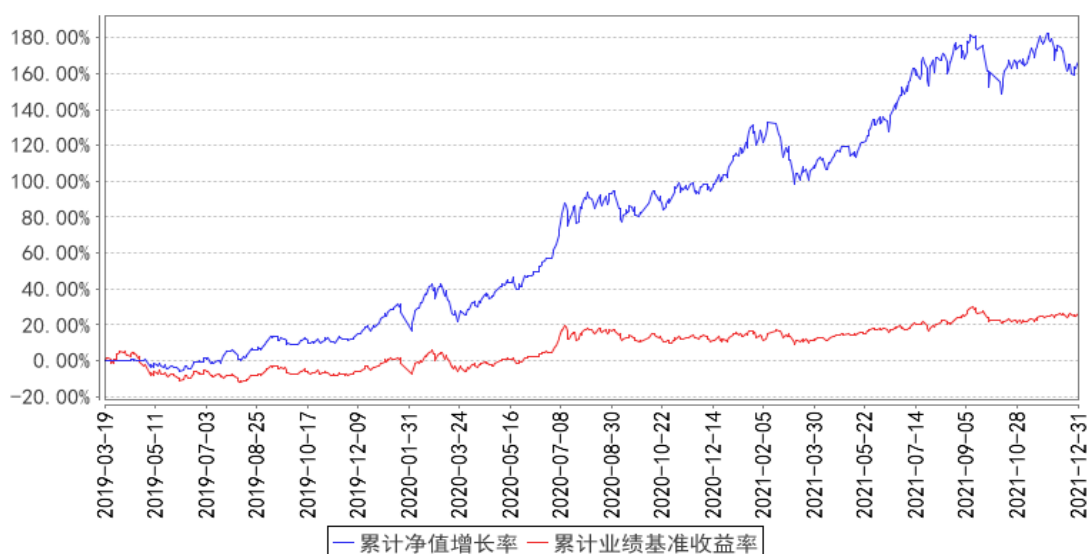
西部利得量化成长混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.25%	1.19%	2.74%	0.57%	-0.49%	0.62%

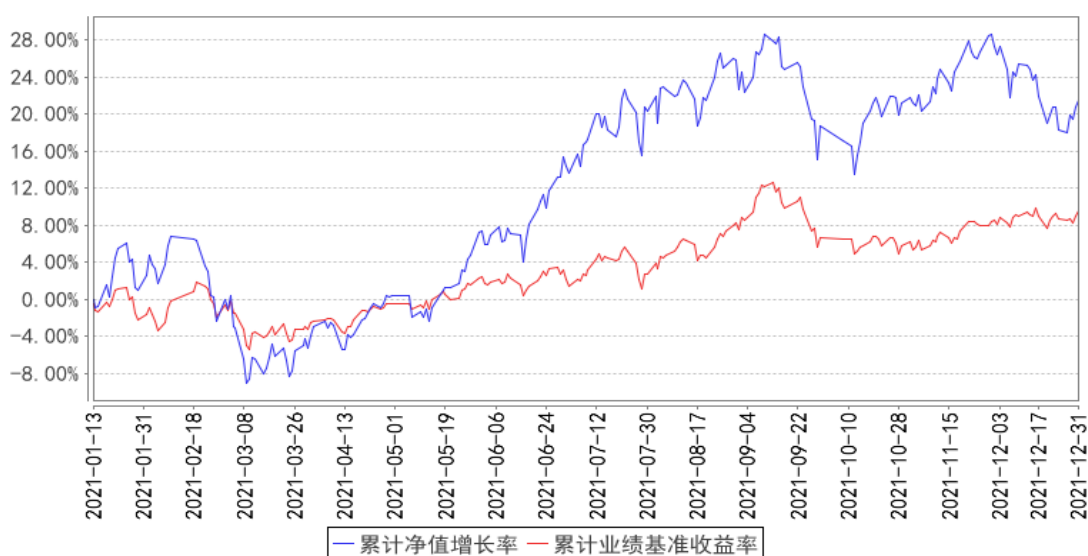
过去六个月	5.24%	1.40%	6.17%	0.72%	-0.93%	0.68%
自基金合同生效起 至今	21.42%	1.40%	9.54%	0.73%	11.88%	0.67%

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

西部利得量化成长混合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

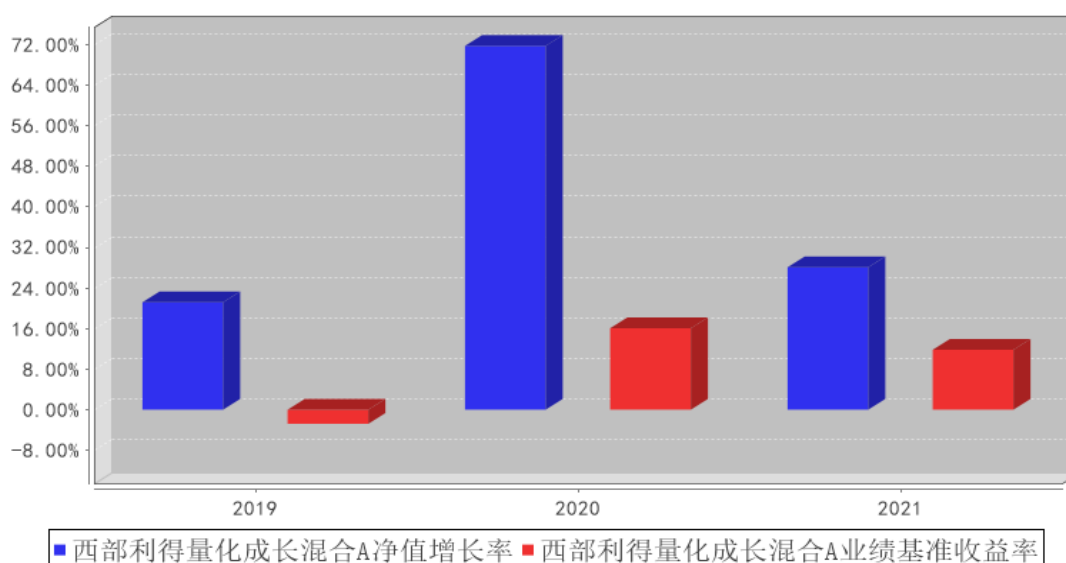


西部利得量化成长混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

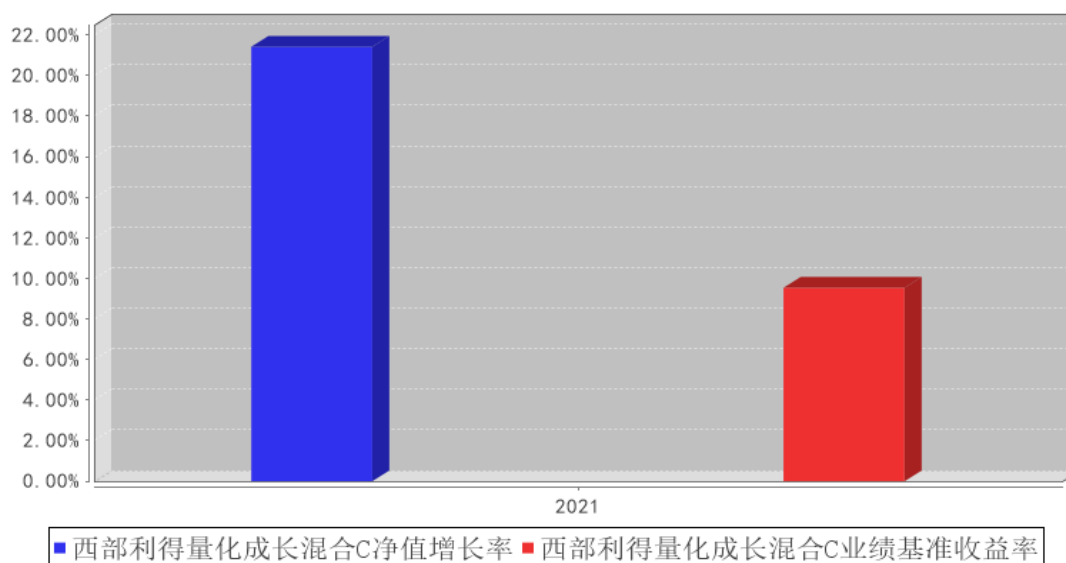


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

西部利得量化成长混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



西部利得量化成长混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：自 2021 年 01 月 13 日起增加本基金的 C 类基金份额。

3.3 其他指标

无

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

西部利得量化成长混合 A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021 年	2.4000	108,699,015.	94,833,954.2	203,532,970.	-

		99	3	22	
2020 年	0.8800	14,302,957.2 3	20,538,207.6 7	34,841,164.9 0	-
2019 年	-	-	-	-	-
合计	3.2800	123,001,973. 22	115,372,161. 90	238,374,135. 12	-

西部利得量化成长混合 C

年度	每 10 份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配 合计	备注
2021 年	2.4000	9,497,751.52	3,328,222.15	12,825,973.6 7	-
合计	2.4000	9,497,751.52	3,328,222.15	12,825,973.6 7	-

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

西部利得基金管理有限公司于 2010 年 7 月 20 日正式成立，公司总部设在上海，在北京、深圳设有分公司，是经中国证监会批准设立的第 60 家全国规范性基金管理公司，自成立以来逐步成长为一家以绝对收益产品为特色的资产管理人。目前公司拥有公募基金、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 53 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 衍	公募量化 投资部总 经理、投 资总监、 基金经理	2019 年 3 月 19 日	-	9 年	复旦大学计算机应用技术硕士，曾任光大证券股份有限公司权益投资助理、上海光大证券资产管理有限公司研究员、兴证证券资产管理有限公司量化研究员。2016 年 10 月加入本公司，具有基金从业资格，中国国籍。

陈元 骅	基金经理 助理	2020 年 11 月 13 日	2021 年 8 月 18 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：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《证券法》、《证券投资基金法》、本基金《基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规制定了《西部利得基金管理有限公司公平交易管理办法》。针对股票、债券等投资标的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动进行公平交易管理。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《西部利得基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人未发生所有投资组合参与的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% 的情况。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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，持仓特征为中盘、成长，行业配置略参考中证 500

指数，相对于基准存在大市值暴露以及高成长因子暴露，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；本基金量化策略的特点是分域建模的基本面量化、专注于能力域、量化为舟主观为舵。本基金努力通过选股获得相对于中证 500 指数的超额收益，以期打造成长风格的优质量化基金，在接下去的投资管理中会坚持类似的投资风格。

感谢持有人的支持，我们将继续以诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金，努力为持有人带来优异回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内基金业绩表现参见本报告第三部分“主要财务指标和基金净值表现”。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年，影响 A 股的主要有三股力量。

其一是国内经济或面临下行压力+流动性宽松

国内经济有下行压力，带动企业盈利增速下行，A 股整体盈利增速预计个位数增长。货币政策易松难紧，两者形成对冲。

其二疫情缓解进度

疫情进入后周期。2021 年冬天新冠疫情在国内小范围再次肆虐，但曙光已不远，市场更为关注前期疫情受损股的恢复程度以及实际的业绩弹性。

其三政策维稳

最新一次政治局会议连提 25 次“稳”；证监会易主席强调突出市场“稳”，保持市场功能正常发挥、稳定市场信心，坚决防止大上大下。后续政策的出台可能会更关注市场波动。2022 年市场走势通道震荡的概率在提高。

预测 2022 年资本市场可能有如下变化：

其一是量化对冲基金被偏债混合基金以及偏债 FOF 接棒其规模。

其二是高端科技创出新赛道。前沿科技、数字基建、业界应用三者之间的碰撞将走出新的模式和增长点。

其三是部分宏观规律失效。当前处于百年未有之大变局关键节点，基于过去几十年总结的部分宏观规律可能失效。汇率、股市、大国利率、通胀、资本跨境流动、风险偏好波动之间的联动关系或出现新的组合。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人始终坚持基金份额持有人利益优先原则，从规范运作、防范风险、

保护基金持有人利益出发，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实。公司监察稽核部依据法律法规的规定及公司内部控制的整体要求，独立对公司经营、旗下投资组合及员工行为等的合规性进行了定期和不定期检查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，并定期向监管机构、公司董事会出具监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人的监察稽核主要工作如下：

- 一、结合公司业务开展的实际情况，进一步完善公司各项内部制度和细化各项业务流程；
- 二、落实内部监察稽核工作，对公司业务流程及管理的各项环节进行定期及不定期稽核；
- 三、根据法律法规及时、准确、完整的披露与本基金有关的各项法定信息披露文件，并在指定报刊和公司网站进行披露，确保基金投资人和公众及时、准确和完整地获取公司和本基金的各项公开信息；
- 四、继续加强反洗钱工作力度，进一步落实洗钱风险自评估工作和反洗钱异常报告筛选，并进一步完善工作流程。监察稽核部定期和不定期地向各监管机构按时提交报备各类反洗钱报告，并不断贯彻落实反洗钱法规及监管要求；
- 五、落实各项合规工作，确保公司各项业务及管理符合法律法规要求；
- 六、其他各类监察稽核工作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.8 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“7.4.11 利润分配情况”。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—西部利得基金管理有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，西部利得基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2201188 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人

<p>审计意见</p>	<p>我们审计了后附的西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金（以下简称“西部利得量化成长基金”）财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表、2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了西部利得量化成长基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于西部利得量化成长基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
<p>强调事项</p>	<p>-</p>
<p>其他事项</p>	<p>-</p>
<p>其他信息</p>	<p>西部利得量化成长基金管理人西部利得基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括西部利得量化成长基金 2021 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估西部利得量化成长基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非西部利得量化成长基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督西部利得量化成长基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导</p>

任	<p>致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对西部利得量化成长基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致西部利得量化成长基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张楠 鲍涵
会计师事务所的地址	上海市静安区南京西路 1266 号 2 幢 25 层
审计报告日期	2022 年 03 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

		2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	178,658,509.37	99,522,862.55
结算备付金		27,036,499.14	7,514,372.42
存出保证金		2,123,740.94	1,416,929.01
交易性金融资产	7.4.7.2	1,971,172,522.44	1,008,803,420.60
其中：股票投资		1,971,172,522.44	1,007,803,520.60
基金投资		-	-
债券投资		-	999,900.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		10,903,721.40	2,851,837.10
应收利息	7.4.7.5	36,927.21	44,709.66
应收股利		-	-
应收申购款		2,044,020.83	5,298,690.79
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,191,975,941.33	1,125,452,822.13
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		60,337,388.12	18,228,642.18
应付赎回款		3,167,650.15	2,821,673.99
应付管理人报酬		2,739,283.19	1,300,313.44
应付托管费		182,618.87	86,687.60
应付销售服务费		76,624.21	-
应付交易费用	7.4.7.7	4,482,072.75	1,335,580.35
应交税费		9,378.37	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	205,236.34	194,980.97
负债合计		71,200,252.00	23,967,878.53
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	918,971,587.91	554,341,578.83
未分配利润	7.4.7.10	1,201,804,101.42	547,143,364.77
所有者权益合计		2,120,775,689.33	1,101,484,943.60

负债和所有者权益总计		2,191,975,941.33	1,125,452,822.13
------------	--	------------------	------------------

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，西部利得量化成长混合 A 基金份额净值为 2.3087 元，基金份额总额为 871,285,833.91 份；西部利得量化成长混合 C 基金份额净值为 2.2905 元，基金份额总额为 47,685,754.00 份。西部利得量化成长混合基金总份额为 918,971,587.91 份。

7.2 利润表

会计主体：西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		443,915,655.51	246,265,992.57
1. 利息收入		1,331,413.09	365,238.54
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,330,744.55	353,278.17
债券利息收入		668.54	11,960.37
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）		485,465,251.54	168,566,236.01
其中：股票投资收益	7.4.7.12	472,449,763.68	165,436,702.86
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	149,580.47	114,549.43
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	2,471,217.48	358,164.03
股利收益	7.4.7.16	10,394,689.91	2,656,819.69
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-46,160,629.01	76,288,813.64
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	3,279,619.89	1,045,704.38
减：二、费用		61,405,494.47	15,005,450.91
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	27,216,440.24	7,042,494.05
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,814,429.28	469,499.61
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	609,962.96	-

4. 交易费用	7.4.7.19	31,503,969.60	7,273,024.66
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		9,088.55	1,720.30
7. 其他费用	7.4.7.20	251,603.84	218,712.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		382,510,161.04	231,260,541.66
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		382,510,161.04	231,260,541.66

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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）	554,341,578.83	547,143,364.77	1,101,484,943.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	382,510,161.04	382,510,161.04
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）	364,630,009.08	488,509,519.50	853,139,528.58
其中：1. 基金申购款	872,173,912.92	1,130,339,923.79	2,002,513,836.71
2. 基金赎回款	-507,543,903.84	-641,830,404.29	-1,149,374,308.13
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）	-	-216,358,943.89	-216,358,943.89
五、期末所有者权益（基金净值）	918,971,587.91	1,201,804,101.42	2,120,775,689.33

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	114,940,759.86	24,371,536.29	139,312,296.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	231,260,541.66	231,260,541.66
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)	439,400,818.97	326,352,451.72	765,753,270.69
其中：1. 基金申购款	647,779,773.90	474,486,476.00	1,122,266,249.90
2. 基金赎回款	-208,378,954.93	-148,134,024.28	-356,512,979.21
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)	-	-34,841,164.90	-34,841,164.90
五、期末所有者权益(基金净值)	554,341,578.83	547,143,364.77	1,101,484,943.60

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

贺燕萍

基金管理人负责人

贺燕萍

主管会计工作负责人

张皞骏

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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

备案,《西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2019 年 3 月 19 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 177,856,344.09 份基金份额,其中认购资金利息折合 19,968.52 份基金份额。本基金的基金管理人为西部利得基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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

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

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

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 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 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币,编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币

的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金持有的[股票投资]和[债券投资]分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

- 应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

- 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值

- 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计

算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费、销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如无需在收益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 10 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 本基金每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。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。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	178,658,509.37	99,522,862.55
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	178,658,509.37	99,522,862.55

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,931,669,880.61	1,971,172,522.44	39,502,641.83
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	1,931,669,880.61	1,971,172,522.44	39,502,641.83
项目	上年度末 2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	922,200,990.54	1,007,803,520.60	85,602,530.06
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	999,800.00	999,900.00
	银行间市场	-	-
	合计	999,800.00	999,900.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	923,200,790.54	1,008,803,420.60	85,602,630.06

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	7,322,840.00	-	-	
其中：股指期货投资	7,322,840.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	

合计	7,322,840.00	-	-	
项目	上年度末 2020年12月31日			
	合同/名义 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	6,229,800.00	-	-	
其中：股指 期货投资	6,229,800.00	-	-	
其他衍生 工具	-	-	-	
合计	6,229,800.00	-	-	

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则（试行）》及《企业会计准则——金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具——股指期货投资”与“证券清算款——股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具——股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

股指期货投资明细如下：

本期末 2021 年 12 月 31 日，金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2201	中证 500 期货 2201	5.00	7,377,800.00	54,960.00
总额合计				54,960.00
减：可抵消期货暂收款				-54,960.00
股指期货投资净额				-

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本报告期及上年度可比期间均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末及上年度可比期间均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	30,766.77	20,386.43
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	5,656.97	2,086.04
应收债券利息	-	22,006.85
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	503.47	230.34
合计	36,927.21	44,709.66

7.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末及上年度可比期间均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	4,482,072.75	1,335,580.35
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	4,482,072.75	1,335,580.35

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	5,236.34	4,980.97
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	200,000.00	190,000.00
合计	205,236.34	194,980.97

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

西部利得量化成长混合 A

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	554,341,578.83	554,341,578.83
本期申购	778,345,450.29	778,345,450.29
本期赎回（以“-”号填列）	-461,401,195.21	-461,401,195.21
-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	871,285,833.91	871,285,833.91

西部利得量化成长混合 C

项目	本期 2021 年 1 月 13 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	93,828,462.63	93,828,462.63
本期赎回（以“-”号填列）	-46,142,708.63	-46,142,708.63
-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	47,685,754.00	47,685,754.00

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

西部利得量化成长混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	357,471,865.51	189,671,499.26	547,143,364.77
本期利润	411,256,638.18	-39,871,612.19	371,385,025.99
本期基金份额交易产生的变动数	266,548,237.27	158,721,446.46	425,269,683.73
其中：基金申购款	670,800,073.88	335,090,772.92	1,005,890,846.80
基金赎回款	-404,251,836.61	-176,369,326.46	-580,621,163.07
本期已分配利润	-203,532,970.22	-	-203,532,970.22
本期末	831,743,770.74	308,521,333.53	1,140,265,104.27

西部利得量化成长混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	17,414,343.96	-6,289,208.91	11,125,135.05
本期基金份额交易产生的变动数	40,054,373.16	23,185,462.61	63,239,835.77
其中：基金申购款	83,144,351.68	41,304,725.31	124,449,076.99

基金赎回款	-43,089,978.52	-18,119,262.70	-61,209,241.22
本期已分配利润	-12,825,973.67	-	-12,825,973.67
本期末	44,642,743.45	16,896,253.70	61,538,997.15

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	1,141,923.79	288,868.41
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	163,796.60	40,041.28
其他	25,024.16	24,368.48
合计	1,330,744.55	353,278.17

注：其他包括直销申购款利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	472,449,763.68	165,436,702.86
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	472,449,763.68	165,436,702.86

7.4.7.12.2 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
----	-----------------------------	----------------------------------

卖出股票成交总额	13,604,203,913.26	2,828,886,377.75
减：卖出股票成本总额	13,131,754,149.58	2,663,449,674.89
买卖股票差价收入	472,449,763.68	165,436,702.86

7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无证券出借差价收入。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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	149,580.47	114,549.43
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	149,580.47	114,549.43

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,219,056.49	5,018,630.94
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,046,786.23	4,811,400.00
减：应收利息总额	22,689.79	92,681.51
买卖债券差价收入	149,580.47	114,549.43

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金于本报告期及上年度可比期间均无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金于本报告期及上年度可比期间均无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金于本报告期及上年度可比期间均未持有资产支持证券。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未持有贵金属。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未持有贵金属。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未持有贵金属。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未持有贵金属。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未持有衍生工具。

7.4.7.15.2 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 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 收益金额 2020年1月1日至2020年12月31日
股指期货投资收益	2,471,217.48	358,164.03

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
----	-----------------------------	----------------------------------

	日	日
股票投资产生的股利收益	10,394,689.91	2,656,819.69
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	10,394,689.91	2,656,819.69

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年12月31日
1. 交易性金融资产	-46,099,988.23	76,174,813.64
股票投资	-46,099,888.23	76,212,534.44
债券投资	-100.00	-37,720.80
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-59,040.00	114,000.00
权证投资	-	-
期货投资	-59,040.00	-
期货	-	114,000.00
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	1,600.78	-
合计	-46,160,629.01	76,288,813.64

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
基金赎回费收入	3,263,197.62	987,257.11
基金转换费收入	16,422.27	58,269.57
其他	-	177.70
合计	3,279,619.89	1,045,704.38

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。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	31,503,969.60	7,273,024.66
银行间市场交易费用	-	-
合计	31,503,969.60	7,273,024.66

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	80,000.00	70,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	51,203.84	28,712.29
其他	400.00	-
合计	251,603.84	218,712.29

7.4.7.21 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。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无

7.4.9 关联方关系

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

本基金于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。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金于本报告期内及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	27,216,440.24	7,042,494.05
其中：支付销售机构的客户维护费	4,554,112.44	925,752.32

注：支付基金管理人西部利得基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% \div \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
----	-----------------------------	----------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	1,814,429.28	469,499.61
----------------	--------------	------------

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 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 2021年1月1日至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	西部利得量化成长混合 A	西部利得量化成长混合 C	合计
农业银行	-	0.00	0.00
西部利得基金	-	171,583.47	171,583.47
西部证券	-	3,348.06	3,348.06
合计	-	174,931.53	174,931.53
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	西部利得量化成长混合 A	西部利得量化成长混合 C	合计
合计	-	-	-

注：1. 支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.8%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给 西部利得基金，再由 西部利得基金计算并支付给各基金销售机构。

其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.8\% / \text{当年天数}。$$

2. 本基金于上年度可比区间未发生应支付关联方的销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行证券出借业务。

7.4.10.4.2 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

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	本期 2021年1月13日（基金合同 生效日）至2021年12月31 日
	西部利得量化成长混合 A	西部利得量化成长混合 C
基金合同生效日（2019年3月19日）持有的基金份额	10,000,600.00	-
报告期初持有的基金份额	10,000,600.00	-
报告期间申购/买入总份额	5.20	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	10,000,605.20	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.0882%	-
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 -
	西部利得量化成长混合 A	西部利得量化成长混合 C
基金合同生效日（2019年3月19日）持有的基金份额	10,000,600.00	-
报告期初持有的基金份额	10,000,600.00	-

报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,600.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.8041%	-

注：本基金于本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资西部利得量化成长混合 C。

7.4.10.5.2 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

西部利得量化成长混合 A

关联方名称	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)
西部证券股份有限公司	2,711,766.77	0.2951	2,711,766.77	0.4892

本报告期末及上年度可比期间无除基金管理人之外的其他关联方投资西部利得量化成长混合 C。

7.4.10.6 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 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	178,658,509.37	1,141,923.79	99,522,862.55	288,868.41

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

2. 本基金通过“中国农业银行股份有限公司基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2021年12月31日的相关余额为人民币11,428,219.89。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

西部利得量化成长混合 A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
		场内	场外					
1	2021 年 7 月 26 日	-	2021 年 7 月 26 日	1.2000	51,491,4 95.88	41,570,251 .47	93,061,7 47.35	-
2	2021 年 9 月 17 日	-	2021 年 9 月 17 日	1.2000	57,207,5 20.11	53,263,702 .76	110,471, 222.87	-
合计	-	-	-	2.4000	108,699, 015.99	94,833,954 .23	203,532, 970.22	-
西部利得量化成长混合 C								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
		场内	场外					
1	2021 年 7 月 26 日	-	2021 年 7 月 26 日	1.2000	4,325,11 5.32	1,119,516. 74	5,444,63 2.06	-
2	2021 年 9 月 17 日	-	2021 年 9 月 17 日	1.2000	5,172,63 6.20	2,208,705. 41	7,381,34 1.61	-
合计	-	-	-	2.4000	9,497,75 1.52	3,328,222. 15	12,825,9 73.67	-

7.4.12 期末(2021 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001234	泰慕士	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 11 日	新股未 上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
300774	倍杰特	2021 年 7 月 26 日	2022 年 2 月 16 日	锁定期	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富 电路	2021 年 8 月 4 日	2022 年 2 月 14 日	锁定期	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300854	中兰 环保	2021 年 9 月 8 日	2022 年 3 月 16 日	锁定期	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
300994	久祺	2021	2022	锁定期	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-

	股份	年 8 月 2 日	年 2 月 14 日							
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2022 年 1 月 5 日	锁定期	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	锁定期	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	锁定期	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301025	读客文化	2021 年 7 月 6 日	2022 年 1 月 19 日	锁定期	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301027	华蓝集团	2021 年 7 月 8 日	2022 年 1 月 17 日	锁定期	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021 年 7 月 12 日	2022 年 1 月 20 日	锁定期	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301029	怡合达	2021 年 7 月 14 日	2022 年 1 月 24 日	锁定期	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301030	仕净科技	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 24 日	锁定期	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301032	新柴股份	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 24 日	锁定期	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301033	迈普医学	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 26 日	锁定期	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301035	润丰股份	2021 年 7 月 21 日	2022 年 1 月 28 日	锁定期	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301036	双乐股份	2021 年 7 月 21 日	2022 年 2 月 16 日	锁定期	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301037	保立佳	2021 年 7 月 21 日	2022 年 2 月 7 日	锁定期	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301038	深水规院	2021 年 7 月 22 日	2022 年 2 月 7 日	锁定期	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-

301039	中集车辆	2021年7月1日	2022年1月10日	锁定期	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-
301040	中环海陆	2021年7月26日	2022年2月7日	锁定期	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301041	金百泽	2021年8月2日	2022年2月11日	锁定期	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301046	能辉科技	2021年8月10日	2022年2月17日	锁定期	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鹰重工	2021年8月11日	2022年02月28日	锁定期	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301049	超越科技	2021年8月17日	2022年2月24日	锁定期	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301050	雷电微力	2021年8月17日	2022年2月24日	锁定期	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	-
301053	远信工业	2021年8月25日	2022年3月1日	锁定期	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301055	张小泉	2021年8月26日	2022年3月7日	锁定期	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301056	森赫股份	2021年8月27日	2022年3月7日	锁定期	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301057	汇隆新材	2021年8月31日	2022年3月9日	锁定期	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301058	中粮工科	2021年9月1日	2022年3月9日	锁定期	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301059	金三江	2021年9月3日	2022年3月14日	锁定期	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301060	兰卫医学	2021年9月6日	2022年3月14日	锁定期	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301062	上海	2021	2022	锁定期	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-

	艾录	2021年9月7日	2022年3月14日							
301063	海锅股份	2021年9月9日	2022年3月24日	锁定期	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301068	大地海洋	2021年9月16日	2022年3月28日	锁定期	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301069	凯盛新材	2021年9月16日	2022年3月28日	锁定期	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301072	中捷精工	2021年9月22日	2022年3月29日	锁定期	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301073	君亭酒店	2021年9月22日	2022年3月30日	锁定期	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301078	孩子王	2021年9月30日	2022年4月14日	锁定期	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301081	严牌股份	2021年10月13日	2022年4月20日	锁定期	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301082	久盛电气	2021年10月14日	2022年4月27日	锁定期	15.48	21.53	915	14,164.20	19,699.95	-
301083	百胜智能	2021年10月13日	2022年4月21日	锁定期	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
301088	戎美股份	2021年10月19日	2022年4月28日	锁定期	33.16	24.67	704	23,344.64	17,367.68	-
301089	拓新药业	2021年10月20日	2022年4月27日	锁定期	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301090	华润材料	2021年10月19日	2022年4月26日	锁定期	10.45	11.22	2,764	28,883.80	31,012.08	-

301091	深城交	2021年10月20日	2022年4月29日	锁定期	36.50	31.31	524	19,126.00	16,406.44	-
301092	争光股份	2021年10月21日	2022年5月5日	锁定期	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-
301093	华兰股份	2021年10月21日	2022年5月5日	锁定期	58.08	49.85	409	23,754.72	20,388.65	-
301096	百诚医药	2021年12月13日	2022年6月20日	锁定期	79.60	78.53	272	21,651.20	21,360.16	-
301100	风光股份	2021年12月10日	2022年6月17日	锁定期	27.81	31.14	599	16,658.19	18,652.86	-
301101	明月镜片	2021年12月9日	2022年6月16日	锁定期	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-
301108	洁雅股份	2021年11月25日	2022年6月6日	锁定期	57.27	53.71	280	16,035.60	15,038.80	-
301111	粤万年青	2021年11月30日	2022年6月7日	锁定期	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301126	达嘉维康	2021年11月30日	2022年6月7日	锁定期	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-
301133	金钟股份	2021年11月19日	2022年5月26日	锁定期	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301136	招标股份	2021年12月31日	2022年1月11日	新股未上市	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
301138	华研	2021	2022	锁定期	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-

	精机	年 12 月 8 日	年 6 月 15 日							
301149	隆华新材	2021 年 11 月 3 日	2022 年 5 月 10 日	锁定期	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64	-
301166	优宁维	2021 年 12 月 21 日	2022 年 6 月 28 日	锁定期	86.06	94.50	253	21,773.18	23,908.50	-
301168	通灵股份	2021 年 12 月 2 日	2022 年 6 月 10 日	锁定期	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77	-
301177	迪阿股份	2021 年 12 月 8 日	2022 年 6 月 15 日	锁定期	116.88	116.08	792	92,568.96	91,935.36	-
301179	泽宇智能	2021 年 12 月 1 日	2022 年 6 月 8 日	锁定期	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-
301180	万祥科技	2021 年 11 月 9 日	2022 年 5 月 16 日	锁定期	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-
301182	凯旺科技	2021 年 12 月 16 日	2022 年 6 月 23 日	锁定期	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-
301185	鸥玛软件	2021 年 11 月 11 日	2022 年 5 月 19 日	锁定期	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-
301188	力诺特玻	2021 年 11 月 4 日	2022 年 5 月 11 日	锁定期	13.00	20.48	647	8,411.00	13,250.56	-
301189	奥尼电子	2021 年 12 月 21 日	2022 年 6 月 28 日	锁定期	66.18	56.62	435	28,788.30	24,629.70	-
301190	善水科技	2021 年 12 月 17 日	2022 年 6 月 24 日	锁定期	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-
301193	家联科技	2021 年 12 月 2 日	2022 年 6 月 9 日	锁定期	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-
301198	喜悦	2021	2022	锁定期	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-

	智行	年 11 月 25 日	年 6 月 2 日								
301199	迈赫股份	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	锁定期	29.28	32.00	402	11,770.56	12,864.00	-	
301211	亨迪药业	2021 年 12 月 14 日	2022 年 6 月 22 日	锁定期	25.80	33.65	967	24,948.60	32,539.55	-	
301221	光庭信息	2021 年 12 月 15 日	2022 年 6 月 22 日	锁定期	69.89	88.72	280	19,569.20	24,841.60	-	
601728	中国电信	2021 年 8 月 11 日	2022 年 2 月 21 日	锁定期	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-	
688082	盛美上海	2021 年 11 月 10 日	2022 年 5 月 18 日	锁定期	85.00	114.28	9,337	793,645.00	1,067,032.36	-	
688211	中科微至	2021 年 10 月 18 日	2022 年 4 月 26 日	锁定期	90.20	71.32	4,501	405,990.20	321,011.32	-	
688262	国芯科技	2021 年 12 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股未上市	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	-	
688285	高铁电气	2021 年 10 月 12 日	2022 年 4 月 20 日	锁定期	7.18	9.14	15,159	108,841.62	138,553.26	-	
688303	大全能源	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 24 日	锁定期	21.49	60.51	48,293	1,037,816.57	2,922,209.43	-	
688553	汇宇制药	2021 年 10 月 14 日	2022 年 4 月 26 日	锁定期	38.87	32.11	8,928	347,031.36	286,678.08	-	
688622	禾信仪器	2021 年 9 月 3 日	2022 年 3 月 14 日	锁定期	17.70	56.93	1,204	21,310.80	68,543.72	-	

688768	容知日新	2021年7月16日	2022年1月26日	锁定期	18.23	108.54	907	16,534.61	98,445.78	-
688787	海天瑞声	2021年8月5日	2022年2月14日	锁定期	36.94	87.35	817	30,179.98	71,364.95	-
688798	艾为电子	2021年8月6日	2022年2月16日	锁定期	76.58	210.33	3,592	275,075.36	755,505.36	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持暂时停牌股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	999,900.00
合计	-	999,900.00

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债等无信用评级的债券。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的

投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金管理人根据法律法规制定了《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理办法》，采用事前预警、事中控制和事后评估调整的多重分级控制机制，通过运用制度规范、业务流程控制、实时监控、稽核检查、应急处置等手段对流动性风险进行监督控制。

报告期内本基金严格遵守流动性管理的相关法律法规及管理人内部规定，主要分散投资于流动性较好的股票资产，基金 7 日可变现资产始终保持较高水平，基金资产整体具备良好流动性，基金资产的变现能力可有效应对投资者赎回需求。

《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》公布后，本基金未出现接受某一投资者申购申请后导致其份额超过基金总份额 50% 以上的情况。基金管理人对本基金的份额持有人集中度实施严格的监控与管理，根据份额持有人集中度情况对本基金的投资组合实施调整。报告期内本基金主动投资流动性受限资产的市值合计未超过本基金资产净值的 15%。报告期内本基金未出现无法以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项及其他流动性风险事件。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、存出保证金和结算备付金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	-------	-----	----

2021 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	178,658,509.37	-	-	-	178,658,509.37
结算备付金	27,036,499.14	-	-	-	27,036,499.14
存出保证金	2,123,740.94	-	-	-	2,123,740.94
交易性金融资产	-	-	-	1,971,172,522.44	1,971,172,522.44
应收利息	-	-	-	36,927.21	36,927.21
应收申购款	-	-	-	2,044,020.83	2,044,020.83
应收证券清算款	-	-	-	10,903,721.40	10,903,721.40
资产总计	207,818,749.45	-	-	1,984,157,191.88	2,191,975,941.33
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,167,650.15	3,167,650.15
应付管理人报酬	-	-	-	2,739,283.19	2,739,283.19
应付托管费	-	-	-	182,618.87	182,618.87
应付证券清算款	-	-	-	60,337,388.12	60,337,388.12
应付销售服务费	-	-	-	76,624.21	76,624.21
应付交易费用	-	-	-	4,482,072.75	4,482,072.75
应交税费	-	-	-	9,378.37	9,378.37
其他负债	-	-	-	205,236.34	205,236.34
负债总计	-	-	-	71,200,252.00	71,200,252.00
利率敏感度缺口	207,818,749.45	-	-	1,912,956,939.88	2,120,775,689.33
上年度末 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	99,522,862.55	-	-	-	99,522,862.55
结算备付金	7,514,372.42	-	-	-	7,514,372.42
存出保证金	1,416,929.01	-	-	-	1,416,929.01
交易性金融资产	999,900.00	-	-	1,007,803,520.60	1,008,803,420.60
应收利息	-	-	-	44,709.66	44,709.66
应收申购款	-	-	-	5,298,690.79	5,298,690.79
应收证券清算款	-	-	-	2,851,837.10	2,851,837.10
资产总计	109,454,063.98	-	-	1,015,998,758.15	1,125,452,822.13
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,821,673.99	2,821,673.99
应付管理人报酬	-	-	-	1,300,313.44	1,300,313.44
应付托管费	-	-	-	86,687.60	86,687.60
应付证券清算款	-	-	-	18,228,642.18	18,228,642.18
应付交易费用	-	-	-	1,335,580.35	1,335,580.35
其他负债	-	-	-	194,980.97	194,980.97
负债总计	-	-	-	23,967,878.53	23,967,878.53
利率敏感度缺口	109,454,063.98	-	-	992,030,879.62	1,101,484,943.60

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		上年度末 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	1,971,172,522.44	92.95	1,007,803,520.60	91.49
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	999,900.00	0.09
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	1,971,172,522.44	92.95	1,008,803,420.60	91.59

7.4.13.4.3.2 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12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	124,714,033.52	58,973,000.00

	业绩比较基准下降 5%	-124,714,033.52	-58,973,000.00
--	----------------	-----------------	----------------

7.4.14 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 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 1,962,295,251.36 元，属于第二层级的余额为 8,877,271.08 元，无属于第三层级的余额（2020 年 12 月 31 日，第一层级余额为 996,942,625.56 元，属于第二层级的余额为 10,860,895.04 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 12 月 31 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	1,971,172,522.44	89.93
	其中：股票	1,971,172,522.44	89.93
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	205,695,008.51	9.38
8	其他各项资产	15,108,410.38	0.69
9	合计	2,191,975,941.33	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,610,000.00	0.26
C	制造业	1,853,176,025.44	87.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	168,328.64	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	12,530,567.00	0.59
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	60,630,952.57	2.86
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	34,333,846.86	1.62
N	水利、环境和公共设施管理业	21,351.71	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	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	8,414.64	0.00
S	综合	4,665,552.00	0.22
	合计	1,971,172,522.44	92.95

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金于本报告期末未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002597	金禾实业	619,100	31,790,785.00	1.50
2	300260	新莱应材	645,575	30,451,772.75	1.44
3	300573	兴齐眼药	220,700	30,191,760.00	1.42
4	600378	昊华科技	624,584	30,104,948.80	1.42
5	002738	中矿资源	425,400	29,931,144.00	1.41
6	605117	德业股份	109,300	29,925,247.00	1.41
7	002008	大族激光	554,111	29,921,994.00	1.41
8	600765	中航重机	592,300	29,905,227.00	1.41
9	002709	天赐材料	260,800	29,900,720.00	1.41
10	300171	东富龙	581,600	29,394,064.00	1.39
11	000519	中兵红箭	1,088,100	29,019,627.00	1.37
12	300347	泰格医药	225,000	28,755,000.00	1.36
13	300363	博腾股份	319,300	28,561,385.00	1.35
14	000733	振华科技	228,200	28,360,696.00	1.34
15	002326	永太科技	549,700	28,150,137.00	1.33
16	603688	石英股份	445,500	28,115,505.00	1.33
17	002756	永兴材料	189,500	28,049,790.00	1.32
18	002472	双环传动	1,013,000	27,938,540.00	1.32
19	688122	西部超导	288,100	27,928,414.00	1.32
20	600869	远东股份	4,048,100	27,850,928.00	1.31
21	300390	天华超净	341,400	27,653,400.00	1.30
22	000933	神火股份	3,041,165	27,644,189.85	1.30
23	688033	天宜上佳	833,760	27,555,768.00	1.30
24	300820	英杰电气	305,900	27,500,410.00	1.30
25	605358	立昂微	226,400	27,170,264.00	1.28
26	002240	盛新锂能	466,200	27,016,290.00	1.27
27	002850	科达利	168,200	26,969,188.00	1.27
28	688200	华峰测控	52,300	26,772,370.00	1.26
29	688536	思瑞浦	34,732	26,674,176.00	1.26
30	603260	合盛硅业	201,500	26,591,955.00	1.25

31	603986	兆易创新	150,700	26,500,595.00	1.25
32	002821	凯莱英	60,800	26,448,000.00	1.25
33	600885	宏发股份	352,800	26,332,992.00	1.24
34	300911	亿田智能	319,800	26,198,016.00	1.24
35	300358	楚天科技	1,002,800	26,142,996.00	1.23
36	600779	水井坊	217,827	26,137,061.73	1.23
37	688388	嘉元科技	207,300	26,026,515.00	1.23
38	002180	纳思达	544,800	26,019,648.00	1.23
39	600487	亨通光电	1,703,000	25,749,360.00	1.21
40	300821	东岳硅材	1,398,300	25,560,924.00	1.21
41	600887	伊利股份	611,341	25,346,197.86	1.20
42	688385	复旦微电	503,200	25,331,088.00	1.19
43	603666	亿嘉和	335,900	25,232,808.00	1.19
44	000657	中钨高新	1,566,467	25,188,789.36	1.19
45	603290	斯达半导	65,800	25,069,800.00	1.18
46	603198	迎驾贡酒	357,200	24,807,540.00	1.17
47	603738	泰晶科技	417,300	24,745,890.00	1.17
48	300450	先导智能	329,600	24,512,352.00	1.16
49	688017	绿的谐波	140,313	24,493,037.28	1.15
50	300672	国科微	130,600	24,226,300.00	1.14
51	600111	北方稀土	527,200	24,145,760.00	1.14
52	688357	建龙微纳	121,849	23,387,697.06	1.10
53	603369	今世缘	429,278	23,352,723.20	1.10
54	688356	键凯科技	69,200	23,329,396.00	1.10
55	688301	奕瑞科技	46,663	23,186,844.70	1.09
56	688508	芯朋微	196,900	22,812,834.00	1.08
57	688690	纳微科技	273,400	21,822,788.00	1.03
58	300274	阳光电源	115,800	16,883,640.00	0.80
59	603517	绝味食品	243,000	16,604,190.00	0.78
60	688269	凯立新材	115,600	14,450,000.00	0.68
61	300767	震安科技	135,540	14,143,599.00	0.67
62	688518	联赢激光	281,800	13,884,286.00	0.65
63	300833	浩洋股份	170,200	13,791,306.00	0.65
64	002541	鸿路钢构	249,919	13,380,663.26	0.63
65	300587	天铁股份	629,341	12,567,939.77	0.59
66	600089	特变电工	578,900	12,255,313.00	0.58
67	300327	中颖电子	162,400	11,026,960.00	0.52
68	000823	超声电子	669,800	9,122,676.00	0.43
69	300496	中科创达	65,300	9,038,826.00	0.43
70	300593	新雷能	161,800	8,798,684.00	0.41
71	603659	璞泰来	54,560	8,762,881.60	0.41
72	603186	华正新材	208,200	8,700,678.00	0.41

73	603799	华友钴业	77,900	8,593,149.00	0.41
74	300852	四会富仕	146,900	8,581,898.00	0.40
75	002507	涪陵榨菜	227,000	8,580,600.00	0.40
76	300443	金雷股份	145,500	8,404,080.00	0.40
77	600872	中炬高新	221,000	8,391,370.00	0.40
78	002812	恩捷股份	33,100	8,288,240.00	0.39
79	600132	重庆啤酒	54,000	8,171,280.00	0.39
80	603267	鸿远电子	45,400	8,146,576.00	0.38
81	002049	紫光国微	36,100	8,122,500.00	0.38
82	300014	亿纬锂能	68,400	8,083,512.00	0.38
83	603876	鼎胜新材	197,100	7,420,815.00	0.35
84	600150	中国船舶	299,300	7,419,647.00	0.35
85	601877	正泰电器	126,200	6,800,918.00	0.32
86	001872	招商港口	379,300	6,429,135.00	0.30
87	603610	麒盛科技	243,788	6,304,357.68	0.30
88	300986	志特新材	96,956	6,206,153.56	0.29
89	600018	上港集团	1,113,400	6,101,432.00	0.29
90	300953	震裕科技	45,200	5,901,764.00	0.28
91	002840	华统股份	325,200	5,619,456.00	0.26
92	000968	蓝焰控股	600,000	5,610,000.00	0.26
93	002318	久立特材	311,507	5,569,745.16	0.26
94	300887	谱尼测试	80,000	5,416,000.00	0.26
95	601702	华峰铝业	411,800	5,073,376.00	0.24
96	600673	东阳光	525,400	4,665,552.00	0.22
97	300567	精测电子	62,100	4,497,903.00	0.21
98	600507	方大特钢	575,100	4,485,780.00	0.21
99	601126	四方股份	204,100	4,265,690.00	0.20
100	003011	海象新材	118,500	4,049,145.00	0.19
101	688329	艾隆科技	95,700	4,028,013.00	0.19
102	600436	片仔癀	8,900	3,890,635.00	0.18
103	600516	方大炭素	346,400	3,748,048.00	0.18
104	600893	航发动力	58,600	3,718,756.00	0.18
105	000848	承德露露	340,000	3,689,000.00	0.17
106	300360	炬华科技	294,200	3,630,428.00	0.17
107	600367	红星发展	190,000	3,530,200.00	0.17
108	002068	黑猫股份	315,200	3,309,600.00	0.16
109	300034	钢研高纳	56,498	3,254,284.80	0.15
110	301062	上海艾录	172,323	3,106,450.23	0.15
111	688303	大全能源	48,293	2,922,209.43	0.14
112	300073	当升科技	33,600	2,918,832.00	0.14
113	300775	三角防务	58,900	2,879,621.00	0.14
114	600195	中牧股份	193,200	2,525,124.00	0.12

115	603063	禾望电气	62,639	2,524,978.09	0.12
116	002179	中航光电	23,300	2,343,048.00	0.11
117	002935	天奥电子	59,000	2,171,790.00	0.10
118	600882	妙可蓝多	37,400	2,094,400.00	0.10
119	600426	华鲁恒升	66,700	2,087,710.00	0.10
120	002831	裕同科技	57,200	1,927,068.00	0.09
121	688595	芯海科技	15,400	1,916,530.00	0.09
122	301012	扬电科技	33,570	1,699,984.80	0.08
123	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	0.08
124	601222	林洋能源	112,000	1,358,560.00	0.06
125	000726	鲁泰A	200,000	1,290,000.00	0.06
126	688021	奥福环保	24,155	1,279,007.25	0.06
127	688082	盛美上海	9,337	1,067,032.36	0.05
128	600388	龙净环保	100,000	862,000.00	0.04
129	688798	艾为电子	3,592	755,505.36	0.04
130	688211	中科微至	4,501	321,011.32	0.02
131	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.01
132	688553	汇宇制药	8,928	286,678.08	0.01
133	688285	高铁电气	15,159	138,553.26	0.01
134	688768	容知日新	907	98,445.78	0.00
135	301177	迪阿股份	792	91,935.36	0.00
136	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.00
137	688787	海天瑞声	817	71,364.95	0.00
138	688622	禾信仪器	1,204	68,543.72	0.00
139	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.00
140	301029	怡合达	462	41,519.94	0.00
141	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
142	301211	亨迪药业	967	32,539.55	0.00
143	301090	华润材料	2,764	31,012.08	0.00
144	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
145	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
146	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.00
147	301189	奥尼电子	435	24,629.70	0.00
148	301166	优宁维	253	23,908.50	0.00
149	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
150	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
151	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
152	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
153	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.00
154	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
155	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
156	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00

157	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
158	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
159	301091	深城交	524	16,406.44	0.00
160	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
161	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
162	301108	洁雅股份	280	15,038.80	0.00
163	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
164	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
165	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
166	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
167	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
168	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
169	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
170	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
171	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
172	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
173	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
174	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
175	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
176	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
177	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
178	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
179	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
180	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
181	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
182	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
183	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
184	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
185	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
186	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
187	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
188	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
189	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
190	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
191	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
192	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
193	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
194	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
195	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
196	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
197	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
198	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00

199	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
200	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
201	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
202	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
203	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
204	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
205	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
206	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
207	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
208	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
209	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
210	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	002709	天赐材料	94,832,877.60	8.61
2	002326	永太科技	92,883,288.57	8.43
3	603799	华友钴业	85,984,691.72	7.81
4	000933	神火股份	83,926,855.73	7.62
5	688388	嘉元科技	78,030,148.09	7.08
6	603986	兆易创新	77,382,391.41	7.03
7	600456	宝钛股份	76,536,257.78	6.95
8	002185	华天科技	74,762,906.03	6.79
9	300327	中颖电子	73,155,902.35	6.64
10	600089	特变电工	72,044,632.45	6.54
11	002648	卫星化学	71,404,057.60	6.48
12	600885	宏发股份	70,139,011.00	6.37
13	300035	中科电气	69,700,900.00	6.33
14	605358	立昂微	69,295,093.19	6.29
15	300820	英杰电气	68,589,705.54	6.23
16	300750	宁德时代	68,573,755.00	6.23
17	603026	石大胜华	68,465,367.10	6.22
18	603906	龙蟠科技	64,362,976.09	5.84
19	688536	思瑞浦	61,989,617.09	5.63
20	300623	捷捷微电	61,659,895.60	5.60
21	300408	三环集团	59,968,038.00	5.44
22	603659	璞泰来	59,749,831.78	5.42
23	000519	中兵红箭	59,108,440.17	5.37
24	603267	鸿远电子	58,856,250.80	5.34
25	600779	水井坊	57,565,995.17	5.23

26	000799	酒鬼酒	57,227,514.40	5.20
27	600702	舍得酒业	56,748,832.26	5.15
28	603260	合盛硅业	55,536,747.40	5.04
29	000831	五矿稀土	55,334,953.00	5.02
30	300363	博腾股份	54,656,240.00	4.96
31	600111	北方稀土	54,527,595.00	4.95
32	603198	迎驾贡酒	54,526,030.00	4.95
33	002850	科达利	54,496,883.00	4.95
34	000733	振华科技	53,813,171.50	4.89
35	600010	包钢股份	52,136,476.80	4.73
36	601636	旗滨集团	52,072,215.52	4.73
37	300593	新雷能	51,584,114.09	4.68
38	600563	法拉电子	50,712,659.46	4.60
39	002240	盛新锂能	49,902,322.72	4.53
40	002541	鸿路钢构	49,802,097.84	4.52
41	300911	亿田智能	49,451,430.84	4.49
42	600378	昊华科技	49,422,918.33	4.49
43	688202	美迪西	49,213,639.79	4.47
44	002791	坚朗五金	48,915,513.72	4.44
45	300037	新宙邦	48,491,025.04	4.40
46	002738	中矿资源	47,359,309.00	4.30
47	000807	云铝股份	46,364,452.95	4.21
48	300014	亿纬锂能	46,040,664.57	4.18
49	603290	斯达半导	45,275,558.50	4.11
50	002245	蔚蓝锂芯	45,178,889.00	4.10
51	300671	富满微	45,066,313.40	4.09
52	300285	国瓷材料	44,937,208.72	4.08
53	002906	华阳集团	44,865,869.17	4.07
54	688598	金博股份	44,766,773.62	4.06
55	603833	欧派家居	44,567,991.84	4.05
56	688122	西部超导	44,503,855.29	4.04
57	000988	华工科技	44,359,126.96	4.03
58	600366	宁波韵升	43,912,341.84	3.99
59	002049	紫光国微	43,643,929.00	3.96
60	300390	天华超净	43,526,330.00	3.95
61	300821	东岳硅材	43,523,211.00	3.95
62	300171	东富龙	42,973,528.75	3.90
63	300587	天铁股份	42,879,857.38	3.89
64	002156	通富微电	42,586,642.17	3.87
65	300015	爱尔眼科	41,639,919.32	3.78
66	600809	山西汾酒	41,636,600.01	3.78
67	300573	兴齐眼药	41,538,671.48	3.77

68	688508	芯朋微	41,157,477.25	3.74
69	600958	东方证券	41,147,065.06	3.74
70	300696	爱乐达	40,960,539.66	3.72
71	002206	海利得	40,768,688.67	3.70
72	300347	泰格医药	40,341,730.00	3.66
73	002832	比音勒芬	39,991,912.49	3.63
74	688111	金山办公	39,792,908.57	3.61
75	300748	金力永磁	39,629,132.86	3.60
76	600141	兴发集团	39,248,120.59	3.56
77	688017	绿的谐波	38,914,762.66	3.53
78	002812	恩捷股份	38,887,333.83	3.53
79	000786	北新建材	38,857,312.15	3.53
80	688033	天宜上佳	38,824,110.43	3.52
81	603489	八方股份	38,444,674.26	3.49
82	000830	鲁西化工	38,304,106.17	3.48
83	688356	键凯科技	38,118,599.00	3.46
84	603995	甬金股份	38,012,180.45	3.45
85	688368	晶丰明源	37,776,560.80	3.43
86	002241	歌尔股份	37,659,980.85	3.42
87	601678	滨化股份	37,532,374.13	3.41
88	300782	卓胜微	37,272,576.00	3.38
89	600884	杉杉股份	37,078,301.00	3.37
90	300450	先导智能	37,072,843.50	3.37
91	000657	中钨高新	37,028,016.48	3.36
92	300502	新易盛	36,883,951.16	3.35
93	600188	兖矿能源	36,760,054.00	3.34
94	300012	华测检测	36,679,413.81	3.33
95	688208	道通科技	36,271,808.88	3.29
96	300751	迈为股份	36,248,702.40	3.29
97	002008	大族激光	36,232,278.45	3.29
98	000977	浪潮信息	36,225,549.24	3.29
99	603688	石英股份	36,044,666.50	3.27
100	688005	容百科技	35,713,329.16	3.24
101	002532	天山铝业	35,612,724.93	3.23
102	002539	云图控股	35,348,109.82	3.21
103	600760	中航沈飞	35,333,745.80	3.21
104	002129	中环股份	35,197,716.26	3.20
105	600499	科达制造	35,128,302.56	3.19
106	600596	新安股份	35,105,040.98	3.19
107	603877	太平鸟	35,024,283.00	3.18
108	300122	智飞生物	35,009,636.00	3.18
109	688301	奕瑞科技	34,874,620.07	3.17

110	300613	富瀚微	34,801,792.00	3.16
111	605117	德业股份	34,706,971.98	3.15
112	002472	双环传动	34,400,486.00	3.12
113	688233	神工股份	34,115,606.63	3.10
114	000568	泸州老窖	33,849,218.00	3.07
115	002756	永兴材料	33,690,674.81	3.06
116	603369	今世缘	33,659,743.77	3.06
117	002614	奥佳华	33,568,357.23	3.05
118	300672	国科微	33,545,736.00	3.05
119	000938	紫光股份	33,526,424.54	3.04
120	300763	锦浪科技	33,449,385.70	3.04
121	300073	当升科技	33,310,283.87	3.02
122	688050	爱博医疗	32,927,664.17	2.99
123	600487	亨通光电	32,658,571.16	2.96
124	603186	华正新材	32,632,039.14	2.96
125	600507	方大特钢	32,518,376.00	2.95
126	002597	金禾实业	32,274,310.00	2.93
127	603279	景津装备	32,214,854.16	2.92
128	300373	扬杰科技	31,947,624.50	2.90
129	688188	柏楚电子	31,942,903.63	2.90
130	300661	圣邦股份	31,696,569.74	2.88
131	600869	远东股份	31,689,103.00	2.88
132	603612	索通发展	31,435,828.00	2.85
133	000063	中兴通讯	31,306,010.99	2.84
134	300413	芒果超媒	31,163,073.46	2.83
135	300595	欧普康视	30,689,107.40	2.79
136	601677	明泰铝业	30,671,953.00	2.78
137	688200	华峰测控	30,642,296.15	2.78
138	605111	新洁能	30,548,939.40	2.77
139	603067	振华股份	30,495,626.92	2.77
140	000498	山东路桥	30,447,325.76	2.76
141	688518	联赢激光	30,287,904.78	2.75
142	300737	科顺股份	30,043,090.80	2.73
143	002043	兔宝宝	29,995,496.64	2.72
144	688385	复旦微电	29,858,557.33	2.71
145	601699	潞安环能	29,806,358.24	2.71
146	002407	多氟多	29,774,685.26	2.70
147	300496	中科创达	29,659,950.00	2.69
148	688357	建龙微纳	29,551,989.24	2.68
149	003022	联泓新科	29,215,447.07	2.65
150	600426	华鲁恒升	29,214,783.84	2.65
151	600436	片仔癀	29,054,015.00	2.64

152	600132	重庆啤酒	29,028,347.74	2.64
153	300059	东方财富	28,403,866.70	2.58
154	688699	明微电子	28,365,256.37	2.58
155	601012	隆基股份	28,183,219.00	2.56
156	603063	禾望电气	28,147,249.86	2.56
157	300316	晶盛机电	27,811,140.00	2.52
158	000915	华特达因	27,475,024.10	2.49
159	688689	银河微电	27,269,866.91	2.48
160	603501	韦尔股份	27,212,004.68	2.47
161	002821	凯莱英	26,939,688.00	2.45
162	300034	钢研高纳	26,734,301.12	2.43
163	600765	中航重机	26,674,804.09	2.42
164	688617	惠泰医疗	26,665,206.51	2.42
165	603876	鼎胜新材	26,573,698.00	2.41
166	002180	纳思达	26,521,110.13	2.41
167	603666	亿嘉和	26,487,870.60	2.40
168	688665	四方光电	26,452,120.61	2.40
169	300687	赛意信息	26,227,770.15	2.38
170	603738	泰晶科技	26,215,261.20	2.38
171	688023	安恒信息	26,172,106.98	2.38
172	300979	华利集团	26,019,346.32	2.36
173	300358	楚天科技	25,976,677.10	2.36
174	600063	皖维高新	25,914,773.80	2.35
175	300783	三只松鼠	25,896,788.00	2.35
176	300409	道氏技术	25,895,881.00	2.35
177	002493	荣盛石化	25,888,350.79	2.35
178	603486	科沃斯	25,888,195.00	2.35
179	603517	绝味食品	25,694,617.80	2.33
180	600438	通威股份	25,692,502.00	2.33
181	300223	北京君正	25,648,312.00	2.33
182	688690	纳微科技	25,547,819.75	2.32
183	603128	华贸物流	25,520,903.70	2.32
184	600887	伊利股份	25,375,772.99	2.30
185	002258	利尔化学	25,371,909.82	2.30
186	300558	贝达药业	25,307,874.12	2.30
187	000651	格力电器	25,177,458.00	2.29
188	000002	万科A	25,155,699.13	2.28
189	603127	昭衍新药	25,104,762.99	2.28
190	002158	汉钟精机	25,046,370.30	2.27
191	002139	拓邦股份	25,019,509.00	2.27
192	600711	盛屯矿业	25,005,331.63	2.27
193	000776	广发证券	24,781,195.86	2.25

194	601966	玲珑轮胎	24,744,661.00	2.25
195	300260	新莱应材	24,679,107.50	2.24
196	300855	图南股份	24,553,469.00	2.23
197	300755	华致酒行	24,525,254.00	2.23
198	300760	迈瑞医疗	24,511,020.00	2.23
199	300767	震安科技	24,441,014.08	2.22
200	603185	上机数控	24,361,091.58	2.21
201	600110	诺德股份	24,242,095.75	2.20
202	300769	德方纳米	24,141,926.00	2.19
203	601233	桐昆股份	23,831,803.00	2.16
204	300957	贝泰妮	23,723,715.59	2.15
205	688366	昊海生科	23,571,174.28	2.14
206	002466	天齐锂业	23,569,163.00	2.14
207	300463	迈克生物	23,528,025.02	2.14
208	601311	骆驼股份	23,508,727.30	2.13
209	300529	健帆生物	23,220,542.50	2.11
210	000848	承德露露	23,202,449.27	2.11
211	300274	阳光电源	23,059,553.04	2.09
212	002138	顺络电子	22,866,912.86	2.08
213	002841	视源股份	22,750,264.83	2.07
214	600584	长电科技	22,710,431.98	2.06
215	002726	龙大美食	22,663,878.71	2.06
216	603816	顾家家居	22,446,777.00	2.04
217	600845	宝信软件	22,390,886.10	2.03
218	601001	晋控煤业	22,300,148.00	2.02
219	601628	中国人寿	22,135,284.44	2.01
220	002064	华峰化学	22,098,038.00	2.01

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

8.4.2 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	603799	华友钴业	85,228,460.78	7.74
2	603026	石大胜华	80,581,529.58	7.32
3	600456	宝钛股份	78,647,312.95	7.14
4	002709	天赐材料	77,065,889.42	7.00
5	300035	中科电气	75,939,979.60	6.89
6	002648	卫星化学	75,569,981.20	6.86
7	002185	华天科技	72,955,968.89	6.62
8	300750	宁德时代	71,982,734.17	6.54

9	000799	酒鬼酒	68,307,060.97	6.20
10	603906	龙蟠科技	67,835,654.44	6.16
11	300327	中颖电子	67,764,461.38	6.15
12	600089	特变电工	67,069,573.37	6.09
13	300408	三环集团	64,091,871.30	5.82
14	603659	璞泰来	63,446,827.52	5.76
15	300623	捷捷微电	58,472,008.05	5.31
16	600702	舍得酒业	58,225,183.60	5.29
17	000831	五矿稀土	56,530,630.00	5.13
18	601636	旗滨集团	55,639,265.25	5.05
19	600563	法拉电子	55,558,164.58	5.04
20	688388	嘉元科技	55,552,161.12	5.04
21	002326	永太科技	53,957,792.47	4.90
22	300285	国瓷材料	53,488,053.93	4.86
23	300671	富满微	53,057,397.44	4.82
24	002245	蔚蓝锂芯	52,234,113.93	4.74
25	000933	神火股份	52,166,050.32	4.74
26	600010	包钢股份	51,479,850.64	4.67
27	300593	新雷能	51,148,859.15	4.64
28	603260	合盛硅业	50,238,557.72	4.56
29	688202	美迪西	49,834,857.31	4.52
30	000807	云铝股份	49,735,742.82	4.52
31	603267	鸿远电子	47,389,642.63	4.30
32	688699	明微电子	47,099,434.48	4.28
33	603986	兆易创新	46,942,544.52	4.26
34	600809	山西汾酒	46,636,195.35	4.23
35	002791	坚朗五金	45,910,087.09	4.17
36	300037	新宙邦	45,713,182.37	4.15
37	300014	亿纬锂能	45,488,637.24	4.13
38	600958	东方证券	45,427,056.21	4.12
39	601678	滨化股份	45,418,155.65	4.12
40	688111	金山办公	45,363,784.90	4.12
41	000830	鲁西化工	45,344,326.61	4.12
42	002906	华阳集团	45,325,847.30	4.11
43	688368	晶丰明源	44,704,015.54	4.06
44	300015	爱尔眼科	44,385,173.54	4.03
45	002241	歌尔股份	44,028,971.00	4.00
46	300696	爱乐达	43,509,722.37	3.95
47	002206	海利得	42,942,209.71	3.90
48	600884	杉杉股份	42,915,549.56	3.90
49	600885	宏发股份	42,746,263.00	3.88
50	300820	英杰电气	42,713,945.00	3.88

51	600499	科达制造	42,682,395.14	3.87
52	603486	科沃斯	42,654,064.60	3.87
53	000988	华工科技	42,646,379.83	3.87
54	300122	智飞生物	42,641,455.00	3.87
55	688208	道通科技	42,638,489.45	3.87
56	603833	欧派家居	41,569,502.00	3.77
57	000568	泸州老窖	41,445,232.81	3.76
58	300073	当升科技	41,224,156.44	3.74
59	603489	八方股份	41,119,653.63	3.73
60	605358	立昂微	40,396,465.00	3.67
61	002539	云图控股	39,991,338.83	3.63
62	002156	通富微电	39,685,332.42	3.60
63	300373	扬杰科技	39,211,418.76	3.56
64	002832	比音勒芬	39,055,971.69	3.55
65	600366	宁波韵升	38,885,851.89	3.53
66	002614	奥佳华	38,526,194.30	3.50
67	688598	金博股份	38,435,902.16	3.49
68	300748	金力永磁	38,410,565.73	3.49
69	000519	中兵红箭	38,104,793.50	3.46
70	000786	北新建材	37,939,503.96	3.44
71	002541	鸿路钢构	37,688,762.47	3.42
72	300012	华测检测	37,567,539.83	3.41
73	300034	钢研高纳	37,537,888.88	3.41
74	300316	晶盛机电	37,146,506.52	3.37
75	601012	隆基股份	37,097,309.84	3.37
76	300769	德方纳米	37,002,040.00	3.36
77	002139	拓邦股份	36,956,833.07	3.36
78	300751	迈为股份	36,862,400.80	3.35
79	000733	振华科技	36,687,084.14	3.33
80	603198	迎驾贡酒	36,630,304.49	3.33
81	300782	卓胜微	36,502,443.47	3.31
82	603995	甬金股份	36,481,085.20	3.31
83	300587	天铁股份	36,370,217.49	3.30
84	300763	锦浪科技	36,329,146.70	3.30
85	300502	新易盛	36,283,140.44	3.29
86	688116	天奈科技	35,869,835.59	3.26
87	688536	思瑞浦	35,800,192.48	3.25
88	002049	紫光国微	35,683,124.82	3.24
89	600141	兴发集团	35,528,077.43	3.23
90	002240	盛新锂能	35,509,033.18	3.22
91	300059	东方财富	35,340,878.82	3.21
92	601677	明泰铝业	34,498,055.22	3.13

93	688188	柏楚电子	34,496,788.54	3.13
94	002129	中环股份	34,380,804.24	3.12
95	003022	联泓新科	34,302,249.49	3.11
96	000977	浪潮信息	34,247,604.59	3.11
97	600760	中航沈飞	34,213,409.20	3.11
98	300760	迈瑞医疗	33,590,990.40	3.05
99	688005	容百科技	33,557,047.48	3.05
100	688050	爱博医疗	33,485,963.89	3.04
101	605111	新洁能	33,479,477.80	3.04
102	603877	太平鸟	33,409,400.76	3.03
103	300124	汇川技术	33,125,665.00	3.01
104	300413	芒果超媒	33,085,427.88	3.00
105	000498	山东路桥	32,969,605.82	2.99
106	300737	科顺股份	32,931,688.84	2.99
107	600188	兖矿能源	32,925,888.00	2.99
108	300363	博腾股份	32,755,945.33	2.97
109	300223	北京君正	32,384,201.60	2.94
110	603612	索通发展	32,262,098.00	2.93
111	601799	星宇股份	32,153,887.00	2.92
112	000063	中兴通讯	32,033,133.27	2.91
113	300661	圣邦股份	31,949,436.50	2.90
114	601899	紫金矿业	31,914,642.40	2.90
115	688233	神工股份	31,742,934.80	2.88
116	688023	安恒信息	31,587,998.59	2.87
117	000938	紫光股份	31,587,162.74	2.87
118	002158	汉钟精机	31,421,014.75	2.85
119	000776	广发证券	31,335,033.00	2.84
120	600110	诺德股份	31,269,419.00	2.84
121	603067	振华股份	31,212,112.84	2.83
122	002230	科大讯飞	31,197,106.04	2.83
123	000002	万科A	31,142,318.55	2.83
124	300595	欧普康视	30,960,842.51	2.81
125	002812	恩捷股份	30,938,720.52	2.81
126	600426	华鲁恒升	30,699,050.52	2.79
127	600779	水井坊	30,467,913.00	2.77
128	002043	兔宝宝	30,373,895.57	2.76
129	600596	新安股份	30,350,893.00	2.76
130	002532	天山铝业	30,318,726.53	2.75
131	300394	天孚通信	29,990,454.26	2.72
132	603678	火炬电子	29,609,765.60	2.69
133	000651	格力电器	29,567,966.18	2.68
134	688665	四方光电	29,114,515.60	2.64

135	600111	北方稀土	29,094,156.46	2.64
136	300409	道氏技术	29,048,439.00	2.64
137	600845	宝信软件	28,891,666.40	2.62
138	002407	多氟多	28,797,871.43	2.61
139	002738	中矿资源	28,548,518.00	2.59
140	600711	盛屯矿业	28,515,538.99	2.59
141	300463	迈克生物	28,414,211.48	2.58
142	002555	三七互娱	28,217,851.24	2.56
143	603501	韦尔股份	28,158,442.86	2.56
144	300613	富瀚微	28,100,686.21	2.55
145	603279	景津装备	27,827,312.00	2.53
146	002258	利尔化学	27,642,115.70	2.51
147	300687	赛意信息	27,330,306.69	2.48
148	002867	周大生	27,272,686.50	2.48
149	002410	广联达	27,192,223.01	2.47
150	688002	睿创微纳	27,126,808.30	2.46
151	600409	三友化工	26,859,839.00	2.44
152	300855	图南股份	26,504,764.07	2.41
153	600438	通威股份	26,475,737.00	2.40
154	300171	东富龙	26,381,812.00	2.40
155	002850	科达利	26,301,107.00	2.39
156	600399	抚顺特钢	26,281,889.01	2.39
157	688016	心脉医疗	26,241,002.19	2.38
158	603392	万泰生物	26,007,895.70	2.36
159	603063	禾望电气	25,761,646.00	2.34
160	601702	华峰铝业	25,714,778.00	2.33
161	601311	骆驼股份	25,618,924.56	2.33
162	002493	荣盛石化	25,527,934.87	2.32
163	600507	方大特钢	25,437,578.16	2.31
164	688689	银河微电	25,383,052.25	2.30
165	601966	玲珑轮胎	25,305,549.87	2.30
166	002643	万润股份	25,215,890.21	2.29
167	603939	益丰药房	25,189,641.18	2.29
168	300979	华利集团	25,165,927.69	2.28
169	603127	昭衍新药	25,164,765.90	2.28
170	600436	片仔癀	25,163,059.91	2.28
171	300558	贝达药业	24,914,029.00	2.26
172	002138	顺络电子	24,746,071.72	2.25
173	688122	西部超导	24,617,404.77	2.23
174	600893	航发动力	24,529,488.62	2.23
175	300911	亿田智能	24,488,903.67	2.22
176	300755	华致酒行	24,412,818.00	2.22

177	688617	惠泰医疗	24,406,412.61	2.22
178	601699	潞安环能	24,400,325.60	2.22
179	601233	桐昆股份	24,315,201.50	2.21
180	002466	天齐锂业	24,313,254.00	2.21
181	600584	长电科技	24,261,628.62	2.20
182	603186	华正新材	24,091,522.72	2.19
183	603128	华贸物流	23,784,790.80	2.16
184	603290	斯达半导	23,754,259.00	2.16
185	600276	恒瑞医药	23,687,185.55	2.15
186	000009	中国宝安	23,626,737.20	2.14
187	002271	东方雨虹	23,490,874.31	2.13
188	300724	捷佳伟创	23,387,649.51	2.12
189	300783	三只松鼠	23,369,141.01	2.12
190	688066	航天宏图	23,242,060.75	2.11
191	300747	锐科激光	22,883,476.86	2.08
192	600309	万华化学	22,794,659.55	2.07
193	002179	中航光电	22,793,045.24	2.07
194	600660	福耀玻璃	22,604,085.07	2.05
195	600031	三一重工	22,600,536.43	2.05
196	601001	晋控煤业	22,540,890.00	2.05
197	002318	久立特材	22,520,273.60	2.04
198	002833	弘亚数控	22,472,948.19	2.04
199	300390	天华超净	22,180,281.95	2.01

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

8.4.3 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	14,141,223,039.65
卖出股票收入（成交）总额	13,604,203,913.26

注：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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金于本报告期末未持有债券。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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
IC2201	IC2201	5	7,377,800.00	54,960.00	-
公允价值变动总额合计（元）					54,960.00
股指期货投资本期收益（元）					2,471,217.48
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-59,040.00

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金于本报告期内未持有国债期货。

8.11.2 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。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金于本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	2,123,740.94
2	应收证券清算款	10,903,721.40
3	应收股利	-
4	应收利息	36,927.21
5	应收申购款	2,044,020.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,108,410.38

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
西部利得量化成长混合A	58,795	14,819.05	543,910,317.33	62.43	327,375,516.58	37.57
西部利得	8,701	5,480.49	12,883,982.12	27.02	34,801,771.88	72.98

量 化 成 长 混 合 C						
合 计	66,314	13,857.88	556,794,299.45	60.59	362,177,288.46	39.41

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）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	西部利得量化成长混合 A	2,003,453.13	0.2299
	西部利得量化成长混合 C	64,005.05	0.1342
	合计	2,067,458.18	0.2250

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	西部利得量化成长混合 A	50~100
	西部利得量化成长混合 C	-
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	西部利得量化成长混合 A	10~50
	西部利得量化成长混合 C	-
	合计	10~50

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限

基金管理人固有资金	10,000,605.20	1.09	10,000,605.20	1.09	36 个月
基金管理人高级管理人员	516,134.33	0.06	-	-	-
基金经理等人员	197,258.25	0.02	-	-	-
基金管理人股东	2,711,766.77	0.30	-	-	-
其他	1,356,415.19	0.15	-	-	-
合计	14,782,179.74	1.62	10,000,605.20	1.09	-

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	西部利得量化成长混合 A	西部利得量化成长混合 C
基金合同生效日 (2019 年 3 月 19 日) 基金份额总额	177,856,344.09	-
本报告期期初基金份额总额	554,341,578.83	-
本报告期基金总申购份额	778,345,450.29	93,828,462.63
减：本报告期基金总赎回份额	461,401,195.21	46,142,708.63
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	871,285,833.91	47,685,754.00

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人高级管理人员变动如下：

1. 基金管理人于 2021 年 1 月完成董事曲莉、独立董事吴弘和张成虎的任职备案；
2. 基金管理人于 2021 年 1 月完成副总经理孙威、王宇和蔡晨研的任职备案；

3. 基金管理人于 2021 年 8 月完成独立董事吴海独立董事的任职备案。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动： 无

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 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。

11.5 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。本报告期应支付毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计费人民币 80,000 元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
长江证券	1	4,750,309,791.66	44.42%	4,112,948.52	27.87%	-
海通证券	2	3,643,816,028.58	34.07%	3,927,825.35	26.62%	-
方正证券	2	741,129,020.43	6.93%	1,641,922.38	11.13%	-
湘财证券	2	606,187,438.13	5.67%	645,590.57	4.37%	-
光大证券股份有限公司	1	522,534,340.40	4.89%	1,755,620.16	11.90%	-
国信证券	2	430,173,907.52	4.02%	1,953,707.48	13.24%	-
银河证券	2	-	-	718,748.56	4.87%	-
中银国际	3	-	-	-	-	-

注：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。

11.7.2 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
长江证券	228,882.99	19.13%	-	-	-	-
海通证券	967,673.50	80.87%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	西部利得基金管理有限公司关于公司董事及独立董事变更公告	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1月7日
2	西部利得基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	同上	2021年01月11日
3	关于西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同相应条款的公告	同上	2021年1月12日
4	西部利得基金管理有限公司基金管理人住所变更公告	同上	2021年7月2日
5	西部利得基金管理有限公司关于北京分公司地址变更的公告	同上	2021年12月27日

6	西部利得基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关准则的公告	同上	2022 年 1 月 5 日
---	--	----	----------------

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准设立的相关文件；
- (2) 本基金《基金合同》；
- (3) 本基金更新的《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。

13.2 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

13.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:00。投资人可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.westleadfund.com> 投资人对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人西部利得基金管理有限公司，咨询电话 4007-007-818（免长途话费）或发电子邮件，E-mail:service@westleadfund.com。

西部利得基金管理有限公司

2022 年 3 月 30 日