

西部利得个股精选股票型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：西部利得基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 26 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 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现	6
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
§ 4 管理人报告	9
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
§ 5 托管人报告	12
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
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56

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	57
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	57
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	57
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	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12 投资组合报告附注	57
§ 8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
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	59
§ 9 开放式基金份额变动	59
§ 10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
10.8 其他重大事件	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	63
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	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	西部利得个股精选股票型证券投资基金	
基金简称	西部利得个股精选股票	
基金主代码	673090	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 1 月 23 日	
基金管理人	西部利得基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	46,662,414.47 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	西部利得个股精选股票 A	西部利得个股精选股票 C
下属分级基金的交易代码	673090	013262
报告期末下属分级基金的份额总额	12,792,915.09 份	33,869,499.38 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金是以股票为主要投资对象，由于股票资产的波动性较大，所以本产品面临的回撤风险较高，适合风险承受能力较高的投资者。在具体投资中，通过自上而下与自下而上相结合的方法，以权益性资产为主要配置资产，重点通过跟踪宏观经济数据、政策环境的变化趋势，来做前瞻性的战略判断，同时深入分析行业景气度，产业上下游，以及公司运营情况，结合市场短期影响因素，通过适时调整所持仓的资产，从而达到对投资组合进行优化的目标。（详见《基金合同》）
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%。
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，属于证券投资基金中的高风险水平投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		西部利得基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	赵毅	李真
	联系电话	021-38572888	021-52629999-212051
	电子邮箱	service@westleadfund.com	tgb_lizhen@cib.com.cn
客户服务电话		4007-007-818	95561
传真		021-38572750	021-62159217
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区耀	福建省福州市台江区江滨中大

	体路 276 号 901 室-908 室	道 398 号兴业银行大厦
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区耀 体路 276 号 901 室-908 室	上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼
邮政编码	200126	200120
法定代表人	何方	吕家进

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据 和指标	报告期(2022年01月01日-2022年06月30日)		
	西部利得个股精选股票 A	西部利得个股精选股票 C	
本期已实现收益	-8,651,329.02	-15,768,495.13	
本期利润	-10,821,662.94	-14,104,611.13	
加权平均基金份 额本期利润	-0.3026	-0.2209	
本期加权平均净 值利润率	-18.24%	-13.46%	
本期基金份额净 值增长率	-9.42%	-9.60%	
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2022年6月30日)		
	期末可供分配利 润	8,716,188.42	22,884,783.78
	期末可供分配基 金份额利润	0.6813	0.6757
	期末基金资产净	21,509,103.51	56,754,283.16

值		
期末基金份额净值	1.6813	1.6757
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	88.07%	-7.37%

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

西部利得个股精选股票 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	7.42%	1.01%	7.64%	0.86%	-0.22%	0.15%
过去三个月	4.51%	1.32%	5.28%	1.14%	-0.77%	0.18%
过去六个月	-9.42%	1.31%	-6.91%	1.16%	-2.51%	0.15%
过去一年	-9.70%	1.12%	-10.31%	1.00%	0.61%	0.12%
过去三年	61.17%	1.10%	17.73%	1.01%	43.44%	0.09%
自基金合同生效起至今	88.07%	1.13%	34.39%	0.98%	53.68%	0.15%

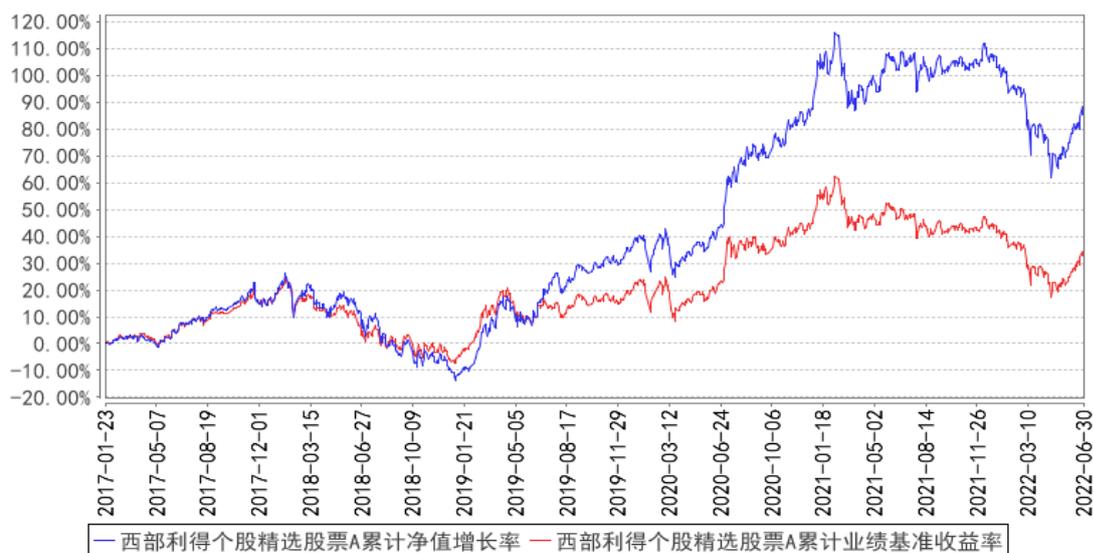
西部利得个股精选股票 C

阶段	份额净	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准	①-③	②-④
----	-----	------	-------	--------	-----	-----

	值增长率①	增长率标准差②	准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	7.40%	1.01%	7.64%	0.86%	-0.24%	0.15%
过去三个月	4.41%	1.32%	5.28%	1.14%	-0.87%	0.18%
过去六个月	-9.60%	1.31%	-6.91%	1.16%	-2.69%	0.15%
自基金合同生效起至今	-7.37%	1.09%	-6.27%	0.98%	-1.10%	0.11%

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

西部利得个股精选股票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



西部利得个股精选股票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 37000.00 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 58 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		
童国	基金经理	2021 年 7	-	27 年	中南财经大学货币银行学硕士。曾任深圳

林		月 14 日			中航企业集团财务部会计，君安证券公司研究所研究员，甘肃证券深圳代表处投资经理，华宝兴业基金公司研究总监、基金经理，富国基金公司首席策略分析师，天弘基金公司总经理助理兼投资总监，上海安苏投资管理有限公司总经理，长江证券股份有限公司投资经理，长江证券（上海）资产管理有限公司权益投资部总经理，凯石基金管理有限公司投资八部总经理。于 2018 年 11 月加入本公司，具有基金从业资格，中国国籍。
---	--	--------	--	--	---

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本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。

4.3.2 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

2022 年上半年，本基金整体上采取“用较小跟踪误差努力实现超越业绩比较基准收益”的投资策略；基于此，本基金资产配置方向以业绩比较基准为主，在保持对比较基准有效跟踪的同时，持续加大了精选个股的力度，以努力提高超额收益来源。

大类资产配置方面，报告期前期股票市场下跌较多，本基金综合判断后，适当提高了股票资产的配置比例；后期大类资产配置保持稳定。

股票资产配置方面，报告期内本基金持续提高精选个股力度；由此，本基金相对于业绩比较基准的偏离度有一定幅度的扩大，但整体跟踪误差仍然不高。

精选个股的策略方面，本基金继续遵循“均衡布局、重点优化、整体控制”的思路。即：对本基金跟踪的股票池，按照一定的方法（主要是聚类方法）进行分组、选择代表性股票，构建主动管理组合；对主动管理组合中的股票进行基本面的深入分析，进而优化组合配置；并控制主动管理组合相对于业绩比较基准的跟踪误差。

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 年下半年，本基金认为，我国资本市场有望整体稳健发展，但外部经济波动可能加大，并可能阶段性、局部性影响到我国资本市场。

进入 2022 年，全球经济的滞胀特征越发明显，除中国外的主要经济体通货膨胀刷新多年记录，而经济增长未见显著成效。本基金认为，除中国外的全球主要经济体，通胀只是表象，内在本质是这些经济体深层矛盾；就是：这些经济体日益下降的国际竞争力与其国民日益高涨的生活水平要求之间的矛盾。但是，这种矛盾在中国并不明显，因为中国在当前主要技术创新领域，如信息技术、人工智能、新能源等领域，国际竞争力相对优势明显，中国并不存在通胀的深层基础。虽然如此，全球主要经济体应对通胀可能采取的货币紧缩政策，将不可避免的对中国产生连带影响。

展望未来，本基金认为，中国将在技术密集型、资本密集型、市场需求密集型产业，展现出全球竞争力。

自 2019 年中国超过美国，成为 WIPO 组织最大的全球发明商标注册申请国后，中国继续加速超越美国，并拉大与美国在全球知识产权创新领域的优势。由此，预示着中国和技术密集型产业上将具有更好的发展基础。此外，随着中国资本市场的壮大、全球主要消费大市场的形成，对于培养我国的资本密集型产业、消费需求密集型产业，必将起到推动作用。

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

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本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：西部利得个股精选股票型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,556,529.35	18,517,688.11
结算备付金		2,782,477.25	2,495,889.85
存出保证金		69,921.00	1,607,985.66
交易性金融资产	6.4.7.2	74,716,092.72	221,326,181.27
其中：股票投资		71,568,203.27	209,157,799.97
基金投资		-	-
债券投资		3,147,889.45	12,168,381.30
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		325,649.74	-
应收股利		-	-
应收申购款		946,381.08	91,305.20
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	225,580.93
资产总计		81,397,051.14	244,264,631.02
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负债：			
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		2,000,000.00	9,000,000.00
应付清算款		207,464.09	406,458.55
应付赎回款		496,381.61	159,836.45

应付管理人报酬		105,703.76	252,989.24
应付托管费		17,617.31	42,164.89
应付销售服务费		27,665.61	47,606.70
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.15
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	278,832.09	320,884.91
负债合计		3,133,664.47	10,229,940.89
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	46,662,414.47	126,178,945.41
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	31,600,972.20	107,855,744.72
净资产合计		78,263,386.67	234,034,690.13
负债和净资产总计		81,397,051.14	244,264,631.02

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 46,662,414.47 份，其中西部利得个股精选股票 A 基金份额总额 12,792,915.09 份，基金份额净值 1.6813 元。西部利得个股精选股票 C 基金份额总额 33,869,499.38 份，基金份额净值 1.6757 元；

6.2 利润表

会计主体：西部利得个股精选股票型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-23,433,399.38	11,892,746.49
1. 利息收入		33,253.04	37,394.94
其中：存款利息收入	6.4.7.13	33,253.04	37,394.94
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-23,042,026.95	14,527,294.11
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-24,511,181.86	13,522,989.66
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	13,403.26	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-

收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	560,277.29	-
股利收益	6.4.7.19	895,474.36	1,004,304.45
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-506,449.92	-2,932,488.55
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	81,824.45	260,545.99
减：二、营业总支出		1,492,874.69	1,404,133.09
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	988,396.18	990,263.78
2. 托管费	6.4.10.2.2	164,732.66	165,043.93
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	209,878.36	-
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-	-
5. 利息支出		39,192.74	-
其中：卖出回购金融资产支出		39,192.74	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		2,719.80	-
8. 其他费用	6.4.7.23	87,954.95	248,825.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-24,926,274.07	10,488,613.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-24,926,274.07	10,488,613.40
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-24,926,274.07	10,488,613.40

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：西部利得个股精选股票型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净	126,178,945.41	-	107,855,744.72	234,034,690.13

资产(基金净值)				
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	126,178,945.41	-	107,855,744.72	234,034,690.13
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-79,516,530.94	-	-76,254,772.52	-155,771,303.46
(一)、综合收益总额	-	-	-24,926,274.07	-24,926,274.07
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-79,516,530.94	-	-51,328,498.45	-130,845,029.39
其中:1.基金申购款	39,452,169.88	-	24,670,755.70	64,122,925.58
2.基金赎回款	-118,968,700.82	-	-75,999,254.15	-194,967,954.97
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产	-	-	-	-

生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	46,662,414.47	-	31,600,972.20	78,263,386.67
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	94,013,037.33	-	69,001,803.83	163,014,841.16
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	94,013,037.33	-	69,001,803.83	163,014,841.16
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	7,636,063.67	-	18,607,263.34	26,243,327.01
(一)、综合收益总额	-	-	10,488,613.40	10,488,613.40
(二)、本期基	7,636,063.67	-	8,118,649.94	15,754,713.61

金份额 交易产 生的基 金净值 变动数 (净值 减少以 “-”号 填列)				
其中:1. 基金申 购款	71,615,434.56	-	57,518,346.30	129,133,780.86
2 .基金赎 回款	-63,979,370.89	-	-49,399,696.36	-113,379,067.25
(三)、 本期向 基金份 额持有 人分配 利润产 生的基 金净值 变动(净 值减少 以“-” 号填列)	-	-	-	-
(四)、 其他综 合收益 结转留 存收益	-	-	-	-
四、本期 期末净 资产(基 金净值)	101,649,101.00	-	87,609,067.17	189,258,168.17

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

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

西部利得个股精选股票型证券投资基金(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]2220 号《关于准予西部利得个股精选股票型证券投资基金注册的批复》核准,由西部利得基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《西部利得个股精选股票型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 200,089,964.12 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 1700167 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《西部利得个股精选股票型证券投资基金基金合同》于 2017 年 1 月 23 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 200,125,973.37 份基金份额,其中认购资金利息折合 36,009.25 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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《西部利得个股精选股票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、中期票据、短期融资券、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货、债券回购、银行存款、资产支持证券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 80%-95%。其中,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:沪深 300 指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 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的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况、2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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

本基金自 2022 年度起执行了财政部发布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量(修订)》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移(修订)》、《企业会计准则第 24 号——套期会计(修订)》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报(修订)》(统称“新金融工具准则”)和 2022 年中国证监会发布的修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》。

(a) 新金融工具准则

根据财政部发布的新金融工具准则相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，本基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于 2006 年颁布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》和《企业会计准则第 24 号——套期保值》以及财政部于 2014 年修订的《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“原金融工具准则”)。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类：(1) 以摊余成本计量的金融资产；(2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；及 (3) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下，金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的商业模式及该资产的合同现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则，嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来，而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。

“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险，因此在新金融工具准则下，本基金信用损失的确认时点早于原金融工具准则。

本基金按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即 2022 年 1 月 1 日）未终止确认的金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整。本基金未调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益。

执行新金融工具准则对本基金资产负债表的影响汇总如下：

(i) 金融工具的分类影响

以摊余成本计量的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收证券清算款、应收利息、应收股利、应收申购款和其他资产，对应的账面价值分别为人民币 18,517,688.11 元、2,495,889.85 元、1,607,985.66 元、0 元、0 元、225,580.93 元、0 元、91,305.20 元和 0 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收证券清算款、应收股利、应收申购款和其他资产，对应的账面价值分别为人民币 18,519,899.44 元、2,495,980.93 元、1,608,017.34 元、0 元、0 元、0 元、91,305.20 元和 0 元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产和衍生金融资产，对应的账面价值分为人民币 221,326,181.27 元和 0 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产和衍生金融资产，对应的账面价值分别为人民币 221,549,428.11 元和 0 元。

以摊余成本计量的金融负债

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用、应交税费、应付利息和其他负债，对应的账面价值分别为人民币 9,000,000.00 元、406,458.55 元、159,836.45 元、252,989.24 元、42,164.89 元、47,606.70 元、148,349.33 元、0.15 元、2,535.57 元和 170,000.01 元。

于 2022 年 1 月 1 日,本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应交税费、和其他负债,对应的账面价值分别为人民币 9,002,535.57 元、406,458.55 元、159,836.45 元、252,989.24 元、42,164.89 元、47,606.70 元、0.15 元、和 318,349.34 元。

于 2021 年 12 月 31 日,本基金持有的银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在应收利息或应付利息科目中。于 2022 年 1 月 1 日,本基金按照新金融工具准则,将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等科目项下列示,无期初留存收益影响。

(b) 修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

本基金根据修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》编制财务报表时,调整了部分财务报表科目的列报和披露,未对财务报表列报和披露产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期末发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》(财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号)、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017]2

号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	2,556,529.35
等于：本金	2,555,814.81
加：应计利息	714.54
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	2,556,529.35

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 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	69,279,659.75	-	71,568,203.27	2,288,543.52

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	3,106,692.86	43,239.45	3,147,889.45	-2,042.86
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	3,106,692.86	43,239.45	3,147,889.45	-2,042.86
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	72,386,352.61	43,239.45	74,716,092.72	2,286,500.66	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金于本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	14.07
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	194,515.46
其中：交易所市场	194,515.46
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
合计	278,832.09

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

西部利得个股精选股票 A

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	58,234,097.27	58,234,097.27
本期申购	1,030,730.60	1,030,730.60
本期赎回（以“-”号填列）	-46,471,912.78	-46,471,912.78
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	12,792,915.09	12,792,915.09

西部利得个股精选股票 C

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	67,944,848.14	67,944,848.14
本期申购	38,421,439.28	38,421,439.28

本期赎回（以“-”号填列）	-72,496,788.04	-72,496,788.04
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	33,869,499.38	33,869,499.38

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

西部利得个股精选股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	66,449,151.36	-16,589,926.90	49,859,224.46
本期利润	-8,651,329.02	-2,170,333.92	-10,821,662.94
本期基金份额交易产生的变动数	-46,194,576.67	15,873,203.57	-30,321,373.10
其中：基金申购款	1,145,630.65	-397,530.09	748,100.56
基金赎回款	-47,340,207.32	16,270,733.66	-31,069,473.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,603,245.67	-2,887,057.25	8,716,188.42

西部利得个股精选股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	77,353,463.17	-19,356,942.91	57,996,520.26
本期利润	-15,768,495.13	1,663,884.00	-14,104,611.13
本期基金份额交易产生的变动数	-31,042,135.33	10,035,009.98	-21,007,125.35
其中：基金申购款	39,212,239.17	-15,289,584.03	23,922,655.14
基金赎回款	-70,254,374.50	25,324,594.01	-44,929,780.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,542,832.71	-7,658,048.93	22,884,783.78

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	27,916.53
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	3,926.17
其他	1,410.34
合计	33,253.04

注：其他包括结算保证金利息收入和申购款利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-24,511,181.86
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	-24,511,181.86

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	403,131,477.29
减：卖出股票成本总额	426,767,062.70
减：交易费用	875,596.45
买卖股票差价收入	-24,511,181.86

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无股票出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	75,559.83
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-62,156.57
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	13,403.26

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总	15,264,319.47

额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	15,028,001.52
减：应计利息总额	298,456.28
减：交易费用	18.24
买卖债券差价收入	-62,156.57

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末有债券赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末有债券申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金于本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金于本报告期内无资产支持证券赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金于本报告期内无资产支持证券申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金在本报告期内未持有贵金属。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金在本报告期内未持有贵金属。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内未持有贵金属。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内未持有贵金属。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	560,277.29

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	895,474.36
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	895,474.36

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-417,046.92
股票投资	-435,201.89
债券投资	18,154.97
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-89,403.00
权证投资	-
期货投资	-89,403.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-506,449.92

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	81,768.94
基金转换费收入	55.51
合计	81,824.45

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

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

低于 25%的部分归入转出基金的基金资产。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期末产生信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	3,652.39
合计	87,954.95

6.4.7.24 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。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
兴业银行股份有限公司	基金托管人
西部证券股份有限公司	基金管理人的股东
利得科技有限公司	基金管理人的股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金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权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	988,396.18	990,263.78
其中：支付销售机构的客户维护费	80,635.53	116,149.81

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 1.20%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	164,732.66	165,043.93

注：支付基金托管人兴业银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15%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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	西部利得个股精选股票 A	西部利得个股精选股票 C	合计
西部利得基金	-	153,802.29	153,802.29
西部证券	-	-	-
兴业银行	-	-	-
合计	-	153,802.29	153,802.29
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	西部利得个股精选股票 A	西部利得个股精选股票 C	合计
西部利得基金	-	-	-
西部证券	-	-	-
兴业银行	-	-	-
合计	-	-	-

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 0.4% 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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.4\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金的情况。

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	2,556,529.35	27,916.53	19,738,183.63	35,157.93

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

2. 本基金通过“兴业银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2022年6月30日的相关余额为人民币433,234.94元。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

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(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300834	星辉环材	2022年1月6日	6个月	锁定期	55.57	30.03	191	10,613.87	5,735.73	-
301102	兆讯传媒	2022年3月15日	6个月	锁定期	39.88	31.09	197	7,856.36	6,124.73	-
301103	何氏	2022年	6个月	锁定期	42.50	32.02	151	6,417.50	4,835.02	-

	眼科	3月14日									
301103	何氏眼科	2022年6月1日	6个月	锁定期	0.00	32.02	45	0.00	1,440.90	锁定期内送股	
301110	青木股份	2022年3月4日	6个月	锁定期	63.10	39.85	103	6,499.30	4,104.55	-	
301116	益客食品	2022年1月10日	6个月	锁定期	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-	
301117	佳缘科技	2022年1月7日	6个月	锁定期	46.80	54.44	176	8,236.80	9,581.44	-	
301122	采纳股份	2022年1月19日	6个月	锁定期	50.31	70.37	170	8,552.70	11,962.90	-	
301123	奕东电子	2022年1月14日	6个月	锁定期	37.23	25.39	219	8,153.37	5,560.41	-	
301130	西点药业	2022年2月16日	6个月	锁定期	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-	
301137	哈焊华通	2022年3月14日	6个月	锁定期	15.37	15.99	481	7,392.97	7,691.19	-	
301151	冠龙节能	2022年3月30日	6个月	锁定期	30.82	21.46	188	5,794.16	4,034.48	-	
301153	中科江南	2022年5月10日	6个月	锁定期	33.68	43.98	204	6,870.72	8,971.92	-	
301158	德石股份	2022年1月7日	6个月	锁定期	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-	
301181	标榜股份	2022年2月11日	6个月	锁定期	40.25	30.59	169	6,802.25	5,169.71	-	
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	锁定期	64.08	37.52	84	5,382.72	3,151.68	-	
301200	大族数控	2022年2月18日	6个月	锁定期	76.56	51.92	126	9,646.56	6,541.92	-	

301201	诚达药业	2022年1月12日	6个月	锁定期	72.69	71.54	157	11,412.33	11,231.78	-
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	6个月	锁定期	56.88	56.42	147	8,361.36	8,293.74	-
301215	中汽股份	2022年2月28日	6个月	锁定期	3.80	6.39	2,366	8,990.80	15,118.74	-
301216	万凯新材	2022年3月21日	6个月	锁定期	35.68	29.84	187	6,672.16	5,580.08	-
301217	铜冠铜箔	2022年1月20日	6个月	锁定期	17.27	14.83	669	11,553.63	9,921.27	-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	6个月	锁定期	173.98	87.82	36	6,263.28	3,161.52	-
301219	腾远钴业	2022年5月24日	6个月	锁定期	0.00	87.82	29	0.00	2,546.78	锁定期内送股
301222	浙江恒威	2022年3月2日	6个月	锁定期	33.98	28.96	195	6,626.10	5,647.20	-
301228	实朴检测	2022年1月21日	6个月	锁定期	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-
301236	软通动力	2022年3月8日	6个月	锁定期	72.88	31.38	166	12,098.08	5,209.08	-
301236	软通动力	2022年6月9日	6个月	锁定期	0.00	31.38	83	0.00	2,604.54	锁定期内送股
301237	和顺科技	2022年3月16日	6个月	锁定期	56.69	41.86	131	7,426.39	5,483.66	-
301256	华融化学	2022年3月14日	6个月	锁定期	8.05	10.08	908	7,309.40	9,152.64	-
301258	富士莱	2022年3月21日	6个月	锁定期	48.30	41.68	111	5,361.30	4,626.48	-
301263	泰恩康	2022年3月22日	6个月	锁定期	19.93	31.38	273	5,440.89	8,566.74	-

		日									
301268	铭利达	2022年3月29日	6个月	锁定期	28.50	34.87	193	5,500.50	6,729.91		-
688163	赛伦生物	2022年3月2日	6个月	锁定期	33.03	23.56	2,124	70,155.72	50,041.44		-
688173	希荻微	2022年1月13日	6个月	锁定期	33.57	31.62	2,052	68,885.64	64,884.24		-
688237	超卓航科	2022年6月24日	1个月内(含)	新股未上市	41.27	41.27	1,201	49,565.27	49,565.27		-
688259	创耀科技	2022年1月5日	6个月	锁定期	66.60	79.22	931	62,004.60	73,753.82		-
688290	景业智能	2022年4月21日	6个月	锁定期	33.89	46.87	2,432	82,420.48	113,987.84		-
688400	凌云光	2022年6月27日	1个月内(含)	新股未上市	21.93	21.93	1,944	42,631.92	42,631.92		-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持暂时停牌股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款共计 2000000.00 元，于 2022 年 7 月 7 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括信用风险、流动性风险、市场风险

等。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.2.1 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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	3,147,889.45	11,995,197.40
合计	3,147,889.45	11,995,197.40

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债、超短期融资券等无信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	-	1,530.90
AAA 以下	-	171,653.00
未评级	-	-
合计	-	173,183.90

6.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金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债券资产，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。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	2,556,529.35	-	-	-	2,556,529.35
结算备付金	2,782,477.25	-	-	-	2,782,477.25
存出保证金	69,921.00	-	-	-	69,921.00
交易性金融资产	3,147,889.45	-	-	71,568,203.27	74,716,092.72
应收申购款	-	-	-	946,381.08	946,381.08
应收清算款	-	-	-	325,649.74	325,649.74
资产总计	8,556,817.05	-	-	72,840,234.09	81,397,051.14
负债					
应付赎回款	-	-	-	496,381.61	496,381.61
应付管理人报酬	-	-	-	105,703.76	105,703.76
应付托管费	-	-	-	17,617.31	17,617.31
应付清算款	-	-	-	207,464.09	207,464.09
卖出回购金融资产款	2,000,000.00	-	-	-	2,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	27,665.61	27,665.61
其他负债	-	-	-	278,832.09	278,832.09
负债总计	2,000,000.00	-	-	1,133,664.47	3,133,664.47
利率敏感度缺口	6,556,817.05	-	-	71,706,569.62	78,263,386.67
上年度末 2021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	18,517,688.11	-	-	18,517,688.11
结算备付金	2,495,889.85	-	-	2,495,889.85
存出保证金	1,607,985.66	-	-	1,607,985.66
交易性金融资产	12,168,381.30	-	-209,157,799.97	221,326,181.27
应收利息	-	-	225,580.93	225,580.93
应收申购款	-	-	91,305.20	91,305.20
资产总计	34,789,944.92	-	-209,474,686.10	244,264,631.02
负债				
应付赎回款	-	-	159,836.45	159,836.45
应付管理人报酬	-	-	252,989.24	252,989.24
应付托管费	-	-	42,164.89	42,164.89
应付证券清算款	-	-	406,458.55	406,458.55
卖出回购金融资产款	9,000,000.00	-	-	9,000,000.00
应付销售服务费	-	-	47,606.70	47,606.70
应付交易费用	-	-	148,349.33	148,349.33
应付利息	-	-	2,535.57	2,535.57
应交税费	-	-	0.15	0.15
其他负债	-	-	170,000.01	170,000.01
负债总计	9,000,000.00	-	1,229,940.89	10,229,940.89
利率敏感度缺口	25,789,944.92	-	-208,244,745.21	234,034,690.13

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2022 年 6 月 30 日，本基金主要投资于权益类金融工具，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响（2021 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021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	71,568,203.27	91.45	209,157,799.97	89.37
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	3,147,889.45	4.02	12,168,381.30	5.20
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	74,716,092.72	95.47	221,326,181.27	94.57

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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	4,309,332.04	12,850,527.64
	业绩比较基准下降5%	-4,309,332.04	-12,850,527.64

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	70,948,506.84	205,751,876.77
第二层次	3,767,585.88	15,574,304.50
第三层次	-	-
合计	74,716,092.72	221,326,181.27

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具 (2021 年 12 月 31 日：无)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2022 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	71,568,203.27	87.92
	其中：股票	71,568,203.27	87.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,147,889.45	3.87
	其中：债券	3,147,889.45	3.87
	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	5,339,006.60	6.56
8	其他各项资产	1,341,951.82	1.65

9	合计	81,397,051.14	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	1,055,921.00	1.35
B	采矿业	2,232,742.96	2.85
C	制造业	42,036,630.66	53.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,765,554.00	3.53
E	建筑业	2,424,322.00	3.10
F	批发和零售业	570,210.34	0.73
G	交通运输、仓储和邮政业	2,843,317.00	3.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,728,085.46	3.49
J	金融业	11,447,251.04	14.63
K	房地产业	1,550,032.04	1.98
L	租赁和商务服务业	580,171.93	0.74
M	科学研究和技术服务业	542,973.76	0.69
N	水利、环境和公共设施管理业	76,751.00	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	17,949.00	0.02
Q	卫生和社会工作	336,594.08	0.43
R	文化、体育和娱乐业	40,032.00	0.05
S	综合	319,665.00	0.41
	合计	71,568,203.27	91.45

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	1,600	3,272,000.00	4.18
2	600900	长江电力	84,500	1,953,640.00	2.50
3	002594	比亚迪	5,800	1,934,242.00	2.47
4	600438	通威股份	29,800	1,783,828.00	2.28
5	300059	东方财富	65,422	1,661,718.80	2.12
6	300750	宁德时代	2,300	1,228,200.00	1.57
7	601328	交通银行	220,000	1,095,600.00	1.40

8	002466	天齐锂业	8,500	1,060,800.00	1.36
9	600089	特变电工	37,700	1,032,603.00	1.32
10	600809	山西汾酒	3,060	993,888.00	1.27
11	600048	保利发展	56,600	988,236.00	1.26
12	002129	TCL 中环	16,300	959,907.00	1.23
13	601668	中国建筑	168,300	895,356.00	1.14
14	600036	招商银行	20,400	860,880.00	1.10
15	601318	中国平安	17,900	835,751.00	1.07
16	000725	京东方 A	206,900	815,186.00	1.04
17	601225	陕西煤业	34,900	739,182.00	0.94
18	300498	温氏股份	34,500	734,505.00	0.94
19	601816	京沪高铁	135,300	679,206.00	0.87
20	600837	海通证券	67,300	660,213.00	0.84
21	601012	隆基绿能	9,740	648,976.20	0.83
22	000858	五粮液	3,200	646,176.00	0.83
23	600406	国电南瑞	23,660	638,820.00	0.82
24	002049	紫光国微	3,300	626,076.00	0.80
25	600111	北方稀土	16,800	590,688.00	0.75
26	002352	顺丰控股	10,400	580,424.00	0.74
27	688981	中芯国际	12,000	542,040.00	0.69
28	000333	美的集团	8,100	489,159.00	0.63
29	002459	晶澳科技	5,680	448,152.00	0.57
30	601669	中国电建	55,000	432,850.00	0.55
31	002230	科大讯飞	9,800	403,956.00	0.52
32	601390	中国中铁	63,500	389,890.00	0.50
33	002415	海康威视	10,700	387,340.00	0.49
34	601628	中国人寿	12,400	385,392.00	0.49
35	601888	中国中免	1,640	382,005.20	0.49
36	000776	广发证券	19,600	366,520.00	0.47
37	300661	圣邦股份	2,000	364,040.00	0.47
38	300142	沃森生物	7,500	362,925.00	0.46
39	600958	东方证券	35,464	362,087.44	0.46
40	600460	士兰微	6,900	358,800.00	0.46
41	600176	中国巨石	20,244	352,448.04	0.45
42	600233	圆通速递	17,200	350,708.00	0.45
43	002001	新和成	15,316	349,357.96	0.45
44	600030	中信证券	16,045	347,534.70	0.44
45	601615	明阳智能	10,200	344,760.00	0.44
46	000166	申万宏源	80,100	343,629.00	0.44
47	000768	中航西飞	11,300	342,277.00	0.44
48	603259	药明康德	3,280	341,087.20	0.44
49	000338	潍柴动力	26,400	329,208.00	0.42

50	600887	伊利股份	8,427	328,231.65	0.42
51	002410	广联达	5,600	304,864.00	0.39
52	601857	中国石油	56,400	298,920.00	0.38
53	000568	泸州老窖	1,200	295,848.00	0.38
54	601138	工业富联	29,300	288,312.00	0.37
55	601238	广汽集团	18,900	288,036.00	0.37
56	002555	三七互娱	13,200	280,236.00	0.36
57	601398	工商银行	57,800	275,706.00	0.35
58	600276	恒瑞医药	7,337	272,129.33	0.35
59	002475	立讯精密	8,000	270,320.00	0.35
60	000651	格力电器	7,800	263,016.00	0.34
61	600522	中天科技	11,100	256,410.00	0.33
62	600309	万华化学	2,600	252,174.00	0.32
63	601111	中国国航	21,600	250,776.00	0.32
64	300760	迈瑞医疗	800	250,560.00	0.32
65	002180	纳思达	4,900	248,038.00	0.32
66	002714	牧原股份	4,400	243,188.00	0.31
67	600115	中国东航	44,200	242,658.00	0.31
68	000001	平安银行	16,000	239,680.00	0.31
69	002142	宁波银行	6,500	232,765.00	0.30
70	000002	万科 A	11,200	229,600.00	0.29
71	603605	珀莱雅	1,380	227,948.40	0.29
72	601117	中国化学	24,200	227,722.00	0.29
73	300285	国瓷材料	6,300	226,296.00	0.29
74	002812	恩捷股份	900	225,405.00	0.29
75	000596	古井贡酒	900	224,694.00	0.29
76	601899	紫金矿业	23,800	222,054.00	0.28
77	000963	华东医药	4,800	216,768.00	0.28
78	600487	亨通光电	14,900	216,646.00	0.28
79	000792	盐湖股份	7,200	215,712.00	0.28
80	000970	中科三环	11,200	210,336.00	0.27
81	603288	海天味业	2,323	209,906.28	0.27
82	601066	中信建投	7,100	205,261.00	0.26
83	300769	德方纳米	500	204,340.00	0.26
84	601838	成都银行	12,300	203,934.00	0.26
85	000988	华工科技	8,800	203,896.00	0.26
86	600018	上港集团	34,800	202,884.00	0.26
87	300015	爱尔眼科	4,508	201,823.16	0.26
88	600085	同仁堂	3,800	200,944.00	0.26
89	603019	中科曙光	6,900	200,238.00	0.26
90	600885	宏发股份	4,760	199,206.00	0.25
91	600141	兴发集团	4,500	197,955.00	0.25

92	603799	华友钴业	2,070	197,933.40	0.25
93	300124	汇川技术	3,000	197,610.00	0.25
94	600547	山东黄金	10,616	197,032.96	0.25
95	603833	欧派家居	1,300	195,884.00	0.25
96	600150	中国船舶	10,300	195,494.00	0.25
97	600096	云天化	6,200	195,176.00	0.25
98	603613	国联股份	2,200	194,920.00	0.25
99	000876	新希望	12,700	194,310.00	0.25
100	688008	澜起科技	3,200	193,856.00	0.25
101	600011	华能国际	27,500	193,600.00	0.25
102	600989	宝丰能源	13,200	193,380.00	0.25
103	002460	赣锋锂业	1,300	193,310.00	0.25
104	000977	浪潮信息	7,200	190,656.00	0.24
105	000009	中国宝安	14,100	190,209.00	0.24
106	600031	三一重工	9,800	186,788.00	0.24
107	002736	国信证券	19,500	186,615.00	0.24
108	600332	白云山	5,800	183,222.00	0.23
109	002304	洋河股份	1,000	183,150.00	0.23
110	601088	中国神华	5,390	179,487.00	0.23
111	600436	片仔癀	500	178,365.00	0.23
112	002241	歌尔股份	5,300	178,080.00	0.23
113	300014	亿纬锂能	1,800	175,500.00	0.22
114	300033	同花顺	1,800	173,070.00	0.22
115	600690	海尔智家	6,200	170,252.00	0.22
116	002353	杰瑞股份	4,200	169,260.00	0.22
117	002916	深南电路	1,800	168,678.00	0.22
118	000408	藏格矿业	5,100	167,994.00	0.21
119	002756	永兴材料	1,100	167,431.00	0.21
120	002271	东方雨虹	3,250	167,277.50	0.21
121	300274	阳光电源	1,700	167,025.00	0.21
122	688297	中无人机	3,128	166,347.04	0.21
123	603456	九洲药业	3,200	165,440.00	0.21
124	601881	中国银河	17,000	164,390.00	0.21
125	002648	卫星化学	6,300	162,855.00	0.21
126	603986	兆易创新	1,120	159,275.20	0.20
127	600352	浙江龙盛	15,500	157,790.00	0.20
128	000877	天山股份	12,800	157,440.00	0.20
129	601555	东吴证券	22,700	157,311.00	0.20
130	603501	韦尔股份	900	155,727.00	0.20
131	601995	中金公司	3,500	155,715.00	0.20
132	601288	农业银行	51,400	155,228.00	0.20
133	600000	浦发银行	19,300	154,593.00	0.20

134	600016	民生银行	40,900	152,148.00	0.19
135	600183	生益科技	8,700	147,813.00	0.19
136	688122	西部超导	1,600	147,520.00	0.19
137	600486	扬农化工	1,100	146,608.00	0.19
138	601919	中远海控	10,400	144,560.00	0.18
139	002203	海亮股份	12,500	144,375.00	0.18
140	300122	智飞生物	1,300	144,313.00	0.18
141	600161	天坛生物	5,900	143,252.00	0.18
142	000703	恒逸石化	13,600	142,936.00	0.18
143	000625	长安汽车	8,184	141,746.88	0.18
144	600655	豫园股份	15,000	141,600.00	0.18
145	600585	海螺水泥	4,000	141,120.00	0.18
146	002414	高德红外	10,832	139,407.84	0.18
147	600919	江苏银行	19,420	138,270.40	0.18
148	600104	上汽集团	7,709	137,297.29	0.18
149	002709	天赐材料	2,200	136,532.00	0.17
150	601688	华泰证券	9,500	134,900.00	0.17
151	600875	东方电气	8,100	133,245.00	0.17
152	000063	中兴通讯	5,200	132,756.00	0.17
153	601601	中国太保	5,600	131,768.00	0.17
154	600673	东阳光	14,400	129,456.00	0.17
155	300363	博腾股份	1,600	124,784.00	0.16
156	000630	铜陵有色	36,100	117,686.00	0.15
157	000661	长春高新	500	116,710.00	0.15
158	002273	水晶光电	9,500	115,045.00	0.15
159	688290	景业智能	2,432	113,987.84	0.15
160	300450	先导智能	1,800	113,724.00	0.15
161	601077	渝农商行	30,600	113,220.00	0.14
162	601988	中国银行	34,700	113,122.00	0.14
163	601211	国泰君安	7,400	112,480.00	0.14
164	002027	分众传媒	16,700	112,391.00	0.14
165	000100	TCL 科技	23,181	111,036.99	0.14
166	688599	天合光能	1,700	110,925.00	0.14
167	002371	北方华创	400	110,848.00	0.14
168	601169	北京银行	24,400	110,776.00	0.14
169	600660	福耀玻璃	2,600	108,706.00	0.14
170	002557	洽洽食品	1,900	108,167.00	0.14
171	000519	中兵红箭	3,700	107,855.00	0.14
172	601229	上海银行	16,400	107,420.00	0.14
173	601985	中国核电	15,600	107,016.00	0.14
174	600050	中国联通	30,700	106,222.00	0.14
175	600170	上海建工	34,800	105,444.00	0.13

176	601128	常熟银行	13,800	105,432.00	0.13
177	600348	华阳股份	6,800	105,128.00	0.13
178	601766	中国中车	20,000	104,000.00	0.13
179	002625	光启技术	6,000	103,620.00	0.13
180	300347	泰格医药	900	103,005.00	0.13
181	002422	科伦药业	5,500	102,850.00	0.13
182	600745	闻泰科技	1,200	102,132.00	0.13
183	300088	长信科技	13,600	100,912.00	0.13
184	600893	航发动力	2,200	100,122.00	0.13
185	601658	邮储银行	17,900	96,481.00	0.12
186	600580	卧龙电驱	6,600	95,172.00	0.12
187	603659	璞泰来	1,100	92,840.00	0.12
188	600009	上海机场	1,600	90,720.00	0.12
189	600028	中国石化	22,100	90,168.00	0.12
190	600905	三峡能源	14,200	89,318.00	0.11
191	601009	南京银行	8,500	88,570.00	0.11
192	600019	宝钢股份	14,700	88,494.00	0.11
193	600196	复星医药	2,000	88,180.00	0.11
194	600010	包钢股份	37,500	88,125.00	0.11
195	600999	招商证券	6,100	87,901.00	0.11
196	600763	通策医疗	500	87,220.00	0.11
197	000895	双汇发展	2,900	84,970.00	0.11
198	603198	迎驾贡酒	1,300	84,682.00	0.11
199	600325	华发股份	11,100	84,027.00	0.11
200	002311	海大集团	1,400	84,014.00	0.11
201	600570	恒生电子	1,920	83,596.80	0.11
202	600600	青岛啤酒	800	83,136.00	0.11
203	601636	旗滨集团	6,500	82,875.00	0.11
204	002050	三花智控	3,000	82,440.00	0.11
205	002179	中航光电	1,300	82,316.00	0.11
206	601818	光大银行	27,300	82,173.00	0.10
207	603589	口子窖	1,400	82,054.00	0.10
208	000629	攀钢钒钛	21,500	81,700.00	0.10
209	000999	华润三九	1,800	81,000.00	0.10
210	600415	小商品城	14,300	79,651.00	0.10
211	600820	隧道股份	13,000	79,560.00	0.10
212	600862	中航高科	2,800	78,680.00	0.10
213	600497	驰宏锌锗	15,100	78,369.00	0.10
214	300496	中科创达	600	78,288.00	0.10
215	600598	北大荒	5,300	78,228.00	0.10
216	600346	恒力石化	3,500	77,840.00	0.10
217	002493	荣盛石化	5,050	77,719.50	0.10

218	600867	通化东宝	7,500	77,550.00	0.10
219	600760	中航沈飞	1,280	77,376.00	0.10
220	002408	齐翔腾达	9,500	77,045.00	0.10
221	000623	吉林敖东	5,200	76,752.00	0.10
222	603568	伟明环保	2,300	76,751.00	0.10
223	300759	康龙化成	800	76,176.00	0.10
224	300999	金龙鱼	1,400	75,628.00	0.10
225	300316	晶盛机电	1,100	74,349.00	0.09
226	601633	长城汽车	2,000	74,080.00	0.09
227	002920	德赛西威	500	74,000.00	0.09
228	688259	创耀科技	931	73,753.82	0.09
229	600755	厦门国贸	9,800	73,500.00	0.09
230	600926	杭州银行	4,900	73,402.00	0.09
231	600132	重庆啤酒	500	73,300.00	0.09
232	600426	华鲁恒升	2,500	73,000.00	0.09
233	000400	许继电气	3,800	72,960.00	0.09
234	002074	国轩高科	1,600	72,960.00	0.09
235	001979	招商蛇口	5,228	70,212.04	0.09
236	000538	云南白药	1,160	70,052.40	0.09
237	688012	中微公司	600	70,050.00	0.09
238	601989	中国重工	18,800	69,748.00	0.09
239	002202	金风科技	4,600	68,080.00	0.09
240	601939	建设银行	11,000	66,660.00	0.09
241	603993	洛阳钼业	11,400	65,322.00	0.08
242	688173	希荻微	2,052	64,884.24	0.08
243	300782	卓胜微	480	64,800.00	0.08
244	601006	大秦铁路	9,800	64,582.00	0.08
245	601877	正泰电器	1,800	64,404.00	0.08
246	600584	长电科技	2,300	62,100.00	0.08
247	601377	兴业证券	8,800	62,040.00	0.08
248	600029	南方航空	8,400	61,404.00	0.08
249	601600	中国铝业	12,900	61,275.00	0.08
250	600588	用友网络	2,820	61,222.20	0.08
251	600383	金地集团	4,500	60,480.00	0.08
252	600582	天地科技	12,600	60,228.00	0.08
253	300207	欣旺达	1,900	60,040.00	0.08
254	601186	中国铁建	7,600	60,040.00	0.08
255	600704	物产中大	11,700	60,021.00	0.08
256	300896	爱美客	100	60,001.00	0.08
257	600741	华域汽车	2,600	59,800.00	0.08
258	600985	淮北矿业	4,100	59,696.00	0.08
259	000778	新兴铸管	12,300	59,286.00	0.08

260	600188	兖矿能源	1,500	59,220.00	0.08
261	688111	金山办公	300	59,136.00	0.08
262	600863	内蒙华电	16,200	59,130.00	0.08
263	600236	桂冠电力	9,700	59,073.00	0.08
264	000786	北新建材	1,700	58,854.00	0.08
265	002821	凯莱英	200	57,800.00	0.07
266	603806	福斯特	880	57,657.60	0.07
267	300834	星辉环材	1,904	57,571.11	0.07
268	600795	国电电力	14,700	57,477.00	0.07
269	300408	三环集团	1,900	57,190.00	0.07
270	603392	万泰生物	366	56,839.80	0.07
271	601100	恒立液压	900	55,548.00	0.07
272	003816	中国广核	19,500	54,600.00	0.07
273	601800	中国交建	5,800	53,824.00	0.07
274	688396	华润微	900	53,163.00	0.07
275	600015	华夏银行	10,100	52,621.00	0.07
276	688005	容百科技	400	51,776.00	0.07
277	600886	国投电力	4,900	51,450.00	0.07
278	603369	今世缘	1,000	51,000.00	0.07
279	601868	中国能建	21,400	50,718.00	0.06
280	000157	中联重科	8,200	50,512.00	0.06
281	601788	光大证券	3,200	50,432.00	0.06
282	688163	赛伦生物	2,124	50,041.44	0.06
283	300601	康泰生物	1,100	49,698.00	0.06
284	688237	超卓航科	1,201	49,565.27	0.06
285	002236	大华股份	3,000	49,260.00	0.06
286	300751	迈为股份	100	49,090.00	0.06
287	000301	东方盛虹	2,900	49,039.00	0.06
288	603486	科沃斯	400	48,756.00	0.06
289	000425	徐工机械	9,000	48,510.00	0.06
290	002601	龙佰集团	2,400	48,120.00	0.06
291	603260	合盛硅业	400	47,184.00	0.06
292	603185	上机数控	300	46,797.00	0.06
293	000938	紫光股份	2,400	46,560.00	0.06
294	002008	大族激光	1,400	46,382.00	0.06
295	601869	长飞光纤	1,500	46,380.00	0.06
296	300628	亿联网络	600	45,690.00	0.06
297	601901	方正证券	6,800	45,628.00	0.06
298	601916	浙商银行	13,700	45,484.00	0.06
299	601336	新华保险	1,400	45,066.00	0.06
300	600171	上海贝岭	1,800	45,054.00	0.06
301	688036	传音控股	500	44,615.00	0.06

302	601139	深圳燃气	6,400	44,416.00	0.06
303	000069	华侨城 A	6,800	44,132.00	0.06
304	600219	南山铝业	11,600	42,804.00	0.05
305	688400	凌云光	1,944	42,631.92	0.05
306	300763	锦浪科技	200	42,600.00	0.05
307	600941	中国移动	700	42,350.00	0.05
308	300454	深信服	400	41,512.00	0.05
309	688126	沪硅产业	1,800	41,364.00	0.05
310	601618	中国中冶	11,800	41,300.00	0.05
311	603882	金域医学	500	41,275.00	0.05
312	002007	华兰生物	1,800	41,040.00	0.05
313	002120	韵达股份	2,400	40,944.00	0.05
314	300529	健帆生物	800	40,712.00	0.05
315	601360	三六零	4,700	40,044.00	0.05
316	300595	欧普康视	700	40,033.00	0.05
317	300413	芒果超媒	1,200	40,032.00	0.05
318	600845	宝信软件	720	39,312.00	0.05
319	300003	乐普医疗	2,100	38,997.00	0.05
320	603290	斯达半导	100	38,590.00	0.05
321	601155	新城控股	1,500	38,145.00	0.05
322	603355	莱克电气	1,500	37,845.00	0.05
323	002841	视源股份	500	37,660.00	0.05
324	300919	中伟股份	300	37,170.00	0.05
325	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.05
326	300433	蓝思科技	3,300	36,531.00	0.05
327	601878	浙商证券	3,200	36,416.00	0.05
328	603056	德邦股份	2,700	36,261.00	0.05
329	002396	星网锐捷	1,600	36,224.00	0.05
330	600167	联美控股	4,800	35,952.00	0.05
331	001872	招商港口	2,300	35,880.00	0.05
332	002815	崇达技术	2,800	35,868.00	0.05
333	002595	豪迈科技	1,600	35,744.00	0.05
334	000869	张裕 A	1,200	35,688.00	0.05
335	600718	东软集团	3,100	35,681.00	0.05
336	600489	中金黄金	4,800	35,472.00	0.05
337	002831	裕同科技	1,200	35,460.00	0.05
338	002416	爱施德	3,800	35,340.00	0.05
339	600064	南京高科	3,200	35,200.00	0.04
340	600918	中泰证券	4,600	35,190.00	0.04
341	002602	世纪华通	7,300	35,186.00	0.04
342	002945	华林证券	2,300	35,075.00	0.04
343	601021	春秋航空	600	35,010.00	0.04

344	600060	海信视像	2,800	35,000.00	0.04
345	603927	中科软	1,500	34,980.00	0.04
346	600970	中材国际	3,600	34,884.00	0.04
347	603983	丸美股份	1,300	34,840.00	0.04
348	000066	中国长城	3,200	34,624.00	0.04
349	600500	中化国际	5,200	34,580.00	0.04
350	601778	晶科科技	6,400	34,560.00	0.04
351	601958	金铂股份	3,900	34,476.00	0.04
352	000708	中信特钢	1,700	34,255.00	0.04
353	601799	星宇股份	200	34,200.00	0.04
354	000559	万向钱潮	5,700	33,858.00	0.04
355	603899	晨光股份	600	33,648.00	0.04
356	002048	宁波华翔	2,100	33,642.00	0.04
357	601728	中国电信	8,911	33,238.03	0.04
358	002938	鹏鼎控股	1,100	33,231.00	0.04
359	300223	北京君正	300	31,875.00	0.04
360	601898	中煤能源	3,000	31,140.00	0.04
361	301123	奕东电子	1,183	30,769.01	0.04
362	601865	福莱特	800	30,480.00	0.04
363	600362	江西铜业	1,700	30,311.00	0.04
364	002191	劲嘉股份	2,700	28,944.00	0.04
365	688363	华熙生物	200	28,436.00	0.04
366	000062	深圳华强	2,200	27,940.00	0.04
367	688561	奇安信	500	27,900.00	0.04
368	601611	中国核建	3,300	27,687.00	0.04
369	002387	维信诺	4,100	27,552.00	0.04
370	300072	海新能科	5,400	27,324.00	0.03
371	600350	山东高速	5,200	27,300.00	0.03
372	601319	中国人保	5,295	26,792.70	0.03
373	600061	国投资本	4,200	26,712.00	0.03
374	601106	中国一重	8,600	26,402.00	0.03
375	002791	坚朗五金	200	25,944.00	0.03
376	601966	玲珑轮胎	1,000	25,370.00	0.03
377	002568	百润股份	840	25,233.60	0.03
378	600606	绿地控股	6,325	25,047.00	0.03
379	603160	汇顶科技	400	24,772.00	0.03
380	688819	天能股份	700	24,206.00	0.03
381	601998	中信银行	5,000	23,750.00	0.03
382	002600	领益智造	4,700	23,594.00	0.03
383	000937	冀中能源	3,100	23,126.00	0.03
384	688065	凯赛生物	200	22,360.00	0.03
385	300957	贝泰妮	100	21,753.00	0.03

386	002064	华峰化学	2,500	21,100.00	0.03
387	600025	华能水电	3,000	20,970.00	0.03
388	300866	安克创新	300	19,896.00	0.03
389	603087	甘李药业	400	19,188.00	0.02
390	002607	中公教育	3,100	17,949.00	0.02
391	605499	东鹏饮料	100	17,086.00	0.02
392	002032	苏泊尔	300	16,902.00	0.02
393	603195	公牛集团	100	15,291.00	0.02
394	301215	中汽股份	2,366	15,118.74	0.02
395	300979	华利集团	200	14,616.00	0.02
396	000800	一汽解放	1,500	14,010.00	0.02
397	601808	中海油服	1,000	13,950.00	0.02
398	601236	红塔证券	1,500	13,695.00	0.02
399	301122	采纳股份	170	11,962.90	0.02
400	301116	益客食品	577	11,805.42	0.02
401	301201	诚达药业	157	11,231.78	0.01
402	301211	亨迪药业	484	10,493.12	0.01
403	601825	沪农商行	1,600	10,032.00	0.01
404	301217	铜冠铜箔	669	9,921.27	0.01
405	301221	光庭信息	148	9,594.84	0.01
406	301117	佳缘科技	176	9,581.44	0.01
407	301256	华融化学	908	9,152.64	0.01
408	301153	中科江南	204	8,971.92	0.01
409	301130	西点药业	237	8,934.90	0.01
410	301263	泰恩康	273	8,566.74	0.01
411	301207	华兰疫苗	147	8,293.74	0.01
412	601698	中国卫通	700	7,917.00	0.01
413	301236	软通动力	249	7,813.62	0.01
414	301158	德石股份	379	7,724.02	0.01
415	301137	哈焊华通	481	7,691.19	0.01
416	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.01
417	301190	善水科技	301	7,142.73	0.01
418	301182	凯旺科技	294	6,985.44	0.01
419	301100	风光股份	322	6,948.76	0.01
420	301268	铭利达	193	6,729.91	0.01
421	301200	大族数控	126	6,541.92	0.01
422	301166	优宁维	110	6,474.60	0.01
423	301103	何氏眼科	196	6,275.92	0.01
424	301102	兆讯传媒	197	6,124.73	0.01
425	301219	腾远钴业	65	5,708.30	0.01
426	301222	浙江恒威	195	5,647.20	0.01
427	301189	奥尼电子	169	5,629.39	0.01

428	301216	万凯新材	187	5,580.08	0.01
429	301237	和顺科技	131	5,483.66	0.01
430	301181	标榜股份	169	5,169.71	0.01
431	301258	富士莱	111	4,626.48	0.01
432	001289	龙源电力	200	4,352.00	0.01
433	301110	青木股份	103	4,104.55	0.01
434	301151	冠龙节能	188	4,034.48	0.01
435	301196	唯科科技	84	3,151.68	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	7,799,214.00	3.33
2	601328	交通银行	6,590,305.00	2.82
3	002594	比亚迪	6,322,752.00	2.70
4	300059	东方财富	6,034,420.94	2.58
5	300750	宁德时代	5,581,274.00	2.38
6	600900	长江电力	5,334,093.69	2.28
7	600887	伊利股份	4,181,947.00	1.79
8	600030	中信证券	3,725,465.70	1.59
9	002475	立讯精密	3,111,036.15	1.33
10	300124	汇川技术	2,742,796.52	1.17
11	600809	山西汾酒	2,530,773.00	1.08
12	601088	中国神华	2,522,018.00	1.08
13	600438	通威股份	2,430,705.71	1.04
14	002241	歌尔股份	2,394,833.00	1.02
15	002466	天齐锂业	2,285,272.00	0.98
16	002129	TCL 中环	2,179,617.16	0.93
17	000725	京东方 A	2,173,960.00	0.93
18	002271	东方雨虹	2,145,844.00	0.92
19	600089	特变电工	2,108,405.21	0.90
20	002049	紫光国微	2,037,886.23	0.87

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	14,779,673.00	6.32
2	300750	宁德时代	9,765,011.00	4.17
3	002594	比亚迪	7,479,250.28	3.20

4	300059	东方财富	7,068,910.40	3.02
5	601328	交通银行	6,557,711.00	2.80
6	600900	长江电力	5,659,656.00	2.42
7	600887	伊利股份	5,417,953.00	2.32
8	600036	招商银行	5,090,484.00	2.18
9	600030	中信证券	5,023,652.21	2.15
10	601318	中国平安	4,942,998.00	2.11
11	002475	立讯精密	4,295,230.00	1.84
12	000858	五粮液	3,776,391.00	1.61
13	300124	汇川技术	3,740,582.00	1.60
14	002271	东方雨虹	3,165,133.00	1.35
15	601088	中国神华	3,142,221.00	1.34
16	601012	隆基绿能	3,075,718.00	1.31
17	000333	美的集团	3,042,505.00	1.30
18	002241	歌尔股份	2,932,122.01	1.25
19	601398	工商银行	2,871,754.00	1.23
20	600809	山西汾酒	2,802,233.00	1.20

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	289,612,667.89
卖出股票收入（成交）总额	403,131,477.29

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	3,147,889.45	4.02
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,147,889.45	4.02

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019664	21 国债 16	25,000	2,541,155.48	3.25
2	019666	22 国债 01	6,000	606,733.97	0.78

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金于本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

风险控制：

（一）基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%。

（二）基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。

其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等。

（三）基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%。

整体操作符合既定的投资政策和投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货不在本基金投资范围内。

7.11.2 本期国债期货投资评价

国债期货不在本基金投资范围内。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年

内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	69,921.00
2	应收清算款	325,649.74
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	946,381.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,341,951.82

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
西部利得 个股精选 股票 A	542	23,603.16	11,981,942.97	93.66	810,972.12	6.34
西部利得 个股精选 股票 C	8,832	3,834.86	18,095,746.91	53.43	15,773,752.47	46.57

合计	9,365	4,982.64	30,077,689.88	64.46	16,584,724.59	35.54
----	-------	----------	---------------	-------	---------------	-------

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（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	西部利得个股精选股票 A	317.34	0.0025
	西部利得个股精选股票 C	1,203.50	0.0036
	合计	1,520.84	0.0033

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	西部利得个股精选股票 A	0~10
	西部利得个股精选股票 C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	西部利得个股精选股票 A	0~10
	西部利得个股精选股票 C	0~10
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	西部利得个股精选股票 A	西部利得个股精选股票 C
基金合同生效日 （2017年1月23日） 基金份额总额	200,125,973.37	-
本报告期期初基金份额总额	58,234,097.27	67,944,848.14
本报告期基金总申购份额	1,030,730.60	38,421,439.28
减：本报告期基金总赎回份额	46,471,912.78	72,496,788.04

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	12,792,915.09	33,869,499.38

注：其中“总申购份额”含红利再投、转换入份额；“总赎回份额”含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开本基金份额持有人大会，无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人无重大人事变动。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

本报告期内未涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金进行审计。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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 (%)	
中信建投	2	213,117,410.68	31.06	168,167.07	42.46	-
华创证券	2	138,155,275.90	20.13	45,771.68	11.56	-
东兴证券	2	79,410,247.1	11.57	26,309.01	6.64	-

		9				
东吴证券	2	70,500,278.38	10.27	37,457.42	9.46	-
广发证券	1	53,798,184.78	7.84	39,342.89	9.93	-
东北证券	2	47,241,768.42	6.88	20,375.56	5.14	-
财信证券	1	41,009,124.33	5.98	29,988.86	7.57	-
华金证券	3	29,041,967.15	4.23	21,238.07	5.36	-
华西证券	2	13,342,861.80	1.94	7,088.90	1.79	-
太平洋证券	2	508,548.55	0.07	321.01	0.08	-
兴业证券	1	84,918.00	0.01	25.46	0.01	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-

注：1. 基金租用席位的选择标准是：（1）财力雄厚，信誉良好；（2）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营情况稳定；（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(%)

中信建投	7,512,808.00	53.95	68,200,000.00	68.06	-	-
华创证券	1,835,786.00	13.18	12,000,000.00	11.98	-	-
东兴证券	16,405.54	0.12	-	-	-	-
东吴证券	91,022.57	0.65	-	-	-	-
广发证券	2,003,090.00	14.39	7,000,000.00	6.99	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
财信证券	2,465,393.90	17.71	4,000,000.00	3.99	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	9,000,000.00	8.98	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

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	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	2022 年 1 月 5 日
2	西部利得基金管理有限公司关于注册资本变更的公告	同上	2022 年 2 月 15 日
3	西部利得基金管理有限公司关于终止北京晟视天下基金销售有限公司办理相关销售业务的提示性公告	同上	2022 年 4 月 2 日
4	西部利得基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司办理相关销售业务的提示性公告	同上	2022 年 4 月 28 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
产品	1	20220210-20220601	22,523,403.96	0.00	22,523,403.96	0.00	0.0000
	2	20220519-20220525	0.00	18,681,113.39	18,681,113.39	0.00	0.0000
	3	20220529-20220627	0.00	18,681,113.39	18,681,113.39	0.00	0.0000

产品特有风险

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准本基金设立的相关文件;
- (2) 本基金《基金合同》;
- (3) 本基金《招募说明书》;
- (4) 本基金《托管协议》;
- (5) 基金管理人《基金管理资格证书》及《企业法人营业执照》;
- (6) 报告期内本基金公告的各项原稿。

12.2 存放地点

本基金管理人处——上海市浦东新区耀体路 276 号晶耀商务广场 3 号楼 9 层

12.3 查阅方式

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

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

西部利得基金管理有限公司

2022 年 8 月 30 日