

西部利得量化价值一年持有期混合型证券
投资基金
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：西部利得基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 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	5
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	6
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	10
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	46
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	46
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	47
§ 8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	48
§ 9 开放式基金份额变动	48
§ 10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8 其他重大事件	50
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	50
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	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	50
§ 12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	西部利得量化价值一年持有期混合型证券投资基金
基金简称	西部利得量化价值一年持有期混合
基金主代码	011849
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 9 月 6 日
基金管理人	西部利得基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	247,448,049.73 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制组合下行风险的基础上，通过积极主动的投资管理，争取实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	大类资产配置策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、融资交易策略（详见《基金合同》）
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*80% + 中债综合指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	赵毅
	联系电话	(010) 66105799
	电子邮箱	service@westleadfund.com
客户服务电话	4007-007-818	95588
传真	021-50710261	(010) 66105798
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区耀 体路 276 号 901 室-908 室	北京市西城区复兴门内大街 55 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 55 号
邮政编码	200126	100140
法定代表人	何方	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	14,839,843.88
本期利润	18,518,374.62
加权平均基金份额本期利润	0.0762
本期加权平均净值利润率	7.59%
本期基金份额净值增长率	8.15%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	2,385,183.87
期末可供分配基金份额利润	0.0096
期末基金资产净值	249,833,233.60
期末基金份额净值	1.0096
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	1.76%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.60%	0.70%	0.97%	0.70%	-1.57%	0.00%
过去三个月	2.67%	0.73%	-3.93%	0.66%	6.60%	0.07%
过去六个月	8.15%	0.68%	-0.29%	0.67%	8.44%	0.01%
自基金合同生效起至今	1.76%	0.76%	-3.25%	0.81%	5.01%	-0.05%

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

西部利得量化价值一年持有期混合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



注：1. 本基金合同于 2022 年 9 月 6 日生效，截至本报告期末本基金合同生效未满一年。

2. 按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末本基金的各项投资组合比例符合本基金合同的有关约定。

3.3 其他指标

无

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

西部利得基金管理有限公司于 2010 年 7 月 20 日正式成立，公司总部设在上海，在北京、深圳设有分公司，是经中国证监会批准设立的第 60 家全国规范性基金管理公司，自成立以来逐步成长为一家以绝对收益产品为特色的资产管理人。目前公司具有公募基金、特定客户资产管理、受托管理保险资金、合格境内机构投资者资格（获批筹建）等多类别资产管理业务。

2015 年起公司逐步建立了一支前中后台密切配合的专业化团队，树立了绝对收益的投资管理方向，秉承专业稳健的投资风格，严谨科学的风险管理理念，以专业高效的服务，致力于打造良好业绩，为投资者创造长期稳定的价值。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从业年限	说明

		任职日期	离任日期		
盛衍	主动量化投资部总经理、投资总监、基金经理	2022 年 9 月 6 日	-	10 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 陈骅	基金经理	2023 年 2 月 3 日	-	8 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。
翟梓 舰	基金经理助理	2023 年 6 月 30 日	-	5 年	硕士毕业于美国哥伦比亚大学工业工程专业，曾任华泰证券股份有限公司算法工程师。2022 年 6 月加入本公司，具有基金从业资格，中国国籍。

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

对于场内交易，本基金管理人按照时间优先、价格优先的原则，对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金，采用了系统中的公平交易模块进行操作，实现了公平交易；对于场外交易，本基金管理人按照公司制度和流程执行。

本基金管理人风险管理部负责对各账户公平交易进行事后监察，在每日公平交易报表中记录不同投资组合当天整体收益率、分投资类别（股票、债券）同向（1日、3日、5日）交易价差分析、银行间交易价格偏离度分析；并分别于季度和年度末编制公平交易季度及年度收益率差异分析报告，对本基金管理人管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）不同时间窗口同向（1日、3日、5日）交易的交易价差以及 T 检验、银行间交易价格偏离度进行了分析。

当监控到疑似异常交易时，本基金管理人风险管理部及时要求相关投资组合经理给予解释，该解释经风险管理部辨认后确认该交易无异常情况后留档备查，公平交易季报及年报由投资组合经理、督察长、总经理签署后，由风险管理部妥善保存分析报告备查。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析，公司未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

投资策略上，本基金始终维持高股票仓位，核心持仓为低估值高股息的价值股，在国企红利指数的基础上降低周期板块的比重，增加稳定板块的比重，通过板块之间的合理搭配兼顾组合的收益进取与风险控制。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。本基金在控制组合整体波动的基础上在各板块内努力通过选股获取超额收益，以期打造价值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 2023 年三季度，影响 A 股的主要有三股力量。

其一是资本市场负债端变化

公募、私募、外资都是主要的资本市场资金来源，影响着市场的波动。其中公募、私募资金随着市场回暖，持有大票的基金或面临更大的赎回压力，主动权益类的新发公私募基金中量化相关比重提升，这可能将推动小市值风格继续强势。外资的流入流出受中美利差影响较大，2022 年及 2023 年上半年这个因素是负面的，而 2023 年下半年则要乐观许多。

其二上市公司 2023 年二季报业绩以及三季报展望

每年 4 月-10 月，上市公司盈利增速是 A 股行业配置的重要参考指标。

其三是经济的结构变化

能源安全，科技自强，内需消费，对外出口，地产托底都是重要的经济议题，而政策节奏上的轻重缓急对 A 股结构有很大影响，今年或以科技为主线。人工智能技术是显著改善人类生产力的革命性工具，和互联网变革相比只强不弱。今年这种工具的普及大幅加速，是人工智能飞入寻常百姓家的元年。站在 3 年的维度，持续看好人工智能板块，我们或将逐步看到整个行业从主题投资慢慢过度到有业绩支撑的成长股投资。

整体来看，A 股权益市场估值或已调整至历史低位区域，2022 年以来的负面因素（新冠疫情、美债利率、俄乌冲突、地产下行）已基本定价，所以当下非常看好 2023 下半年、2024 年权益市场表现，结构上继续维持 2022 年 6 月以来看好小市值的判断。小市值的主要风险可能在于加速退市政策的落地，但目前未观察到相关进展。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

可参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——西部利得基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对西部利得基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：西部利得量化价值一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	16,306,757.08	22,374,093.59
结算备付金		2,153,298.71	1,320,693.56
存出保证金		347,142.06	613,797.61
交易性金融资产	6.4.7.2	230,458,414.65	203,081,822.01
其中：股票投资		228,218,861.06	200,866,738.45
基金投资		-	-
债券投资		2,239,553.59	2,215,083.56
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		1,242,651.89	573,909.58
应收股利		-	-
应收申购款		6,441.35	2,643.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		250,514,705.74	227,966,959.63
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		307,615.81	294,815.19
应付托管费		51,269.28	49,135.86
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	5,415.21
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	322,587.05	293,863.51
负债合计		681,472.14	643,229.77
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	247,448,049.73	241,590,538.80
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	2,385,183.87	-14,266,808.94
净资产合计		249,833,233.60	227,323,729.86
负债和净资产总计		250,514,705.74	227,966,959.63

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0096 元，基金份额总额 247,448,049.73 份。

6.2 利润表

会计主体：西部利得量化价值一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		20,713,283.93
1. 利息收入		38,288.83
其中：存款利息收入	6.4.7.13	38,288.83
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）		16,996,464.36
其中：股票投资收益	6.4.7.14	10,605,506.52
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	122,341.78
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-67,047.93
股利收益	6.4.7.19	6,335,663.99
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	3,678,530.74
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	-
减：二、营业总支出		2,194,909.31
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,812,577.99
2. 托管费	6.4.10.2.2	302,096.28
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		502.29
8. 其他费用	6.4.7.23	79,732.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号 填列）		18,518,374.62
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		18,518,374.62
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		18,518,374.62

注：本基金合同生效日为 2022 年 09 月 06 日，无上年度可比期间对比数据。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：西部利得量化价值一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	241,590,538.80	-	-14,266,808.94	227,323,729.86
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）	241,590,538.80	-	-14,266,808.94	227,323,729.86
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	5,857,510.93	-	16,651,992.81	22,509,503.74
（一）、综合收益总额	-	-	18,518,374.62	18,518,374.62
（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）	5,857,510.93	-	130,410.96	5,987,921.89
其中：1. 基金申购款	5,857,510.93	-	130,410.96	5,987,921.89
2. 基金赎回款	-	-	-	-
（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）	-	-	-1,996,792.77	-1,996,792.77
（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）	247,448,049.73	-	2,385,183.87	249,833,233.60

注：本基金合同生效日为 2022 年 09 月 06 日，无上年度可比期间对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

西部利得量化价值一年持有期混合型证券投资基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]683号《关于准予西部利得量化价值一年持有期混合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《西部利得量化价值一年持有期混合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240,446,484.64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2200119号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《西部利得量化价值一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于2022年9月6日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为240,487,588.11份基金份额,其中认购资金利息折合41,103.47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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《西部利得量化价值一年持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为国内依法发行上市的股票(包含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、地方政府债券、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货、股票期权、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金还可根据法律法规参与融资。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。

基金的投资组合比例为:股票(含存托凭证)资产占基金资产的60%-95%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权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。若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许,本基金管理人在履行适当程

序后，可对上述资产配置比例进行调整。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*80% + 中债综合指数收益率*20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度和中期报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况、2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金本报告期未发生重大会计政策和会计估计变更。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015]101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税 [2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008]16 号《关于做好调整证券交易印花

税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

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

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代

缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

(e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	16,306,757.08
等于：本金	16,304,921.97
加：应计利息	1,835.11
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	16,306,757.08

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	231,464,393.13	-	228,218,861.06	-3,245,532.07
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	39,773.59	2,239,553.59	-1,940.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	2,201,720.00	39,773.59	2,239,553.59
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	233,666,113.13	39,773.59	230,458,414.65	-3,247,472.07

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30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	2,332,200.00	-	-	
其中：股指期货投资	2,332,200.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	2,332,200.00	-	-	

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。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

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
IF2307	IF2307	2.00	2,298,240.00	-33,960.00
合计				-33,960.00
减：可抵销期货 暂收款				-33,960.00
净额				-

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 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	243,243.89
其中：交易所市场	243,243.89
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	79,343.16
合计	322,587.05

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	241,590,538.80	241,590,538.80
本期申购	5,857,510.93	5,857,510.93
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	247,448,049.73	247,448,049.73

注：申购含红利再投资、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-7,275,380.88	-6,991,428.06	-14,266,808.94
本期利润	14,839,843.88	3,678,530.74	18,518,374.62
本期基金份额交易产生的变动数	51,788.33	78,622.63	130,410.96
其中：基金申购款	51,788.33	78,622.63	130,410.96
基金赎回款	-	-	-

本期已分配利润	-1,996,792.77	-	-1,996,792.77
本期末	5,619,458.56	-3,234,274.69	2,385,183.87

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
活期存款利息收入		33,694.97
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		3,831.14
其他		762.72
合计		38,288.83

注：其他包括结算保证金利息收入和申购款利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		10,605,506.52
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		10,605,506.52

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
卖出股票成交总额		443,421,634.95
减：卖出股票成本总额		431,891,284.30
减：交易费用		924,844.13
买卖股票差价收入		10,605,506.52

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	
	2023年1月1日至2023年6月30日	

债券投资收益——利息收入	20,584.48
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	101,757.30
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	122,341.78

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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	600,857.94
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	499,000.00
减：应计利息总额	76.56
减：交易费用	24.08
买卖债券差价收入	101,757.30

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金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

本基金本报告期内未持有贵金属。

6.4.7.18 衍生工具收益**6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金在本报告期内未持有权证。

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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-67,047.93

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	6,335,663.99
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	6,335,663.99

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	3,608,930.74
股票投资	3,604,970.74
债券投资	3,960.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	69,600.00
权证投资	-
期货投资	69,600.00
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	3,678,530.74

6.4.7.21 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期未产生信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	389.59
合计	79,732.75

6.4.7.24 分部报告

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
西部利得基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构
中国工商银行股份有限公司	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

1. 本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。
2. 本基金合同生效日为 2022 年 09 月 06 日，无上年度可比期间对比数据。

6.4.10.1.2 债券交易

1. 本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。
2. 本基金合同生效日为 2022 年 09 月 06 日，无上年度可比期间对比数据。

6.4.10.1.3 债券回购交易

1. 本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。
2. 本基金合同生效日为 2022 年 09 月 06 日，无上年度可比期间对比数据。

6.4.10.1.4 权证交易

1. 本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。
2. 本基金合同生效日为 2022 年 09 月 06 日，无上年度可比期间对比数据。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

1. 本基金本报告期无应支付关联方的佣金。
2. 本基金合同生效日为 2022 年 09 月 06 日，无上年度可比期间对比数据。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,812,577.99
其中：支付销售机构的客户维护费	270,631.01

注：1. 支付基金管理人西部利得基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

2. 本基金合同生效日为 2022 年 09 月 06 日，无上年度可比期间对比数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	302,096.28

注：1. 支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

2. 本基金合同生效日为 2022 年 09 月 06 日，无上年度可比期间对比数据。

6.4.10.2.3 销售服务费

1. 本基金于本报告期末未发生应支付关联方的销售服务费。

2. 本基金合同生效日为 2022 年 9 月 6 日，无上年度可比期间对应数据。

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

1. 本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

2. 本基金合同生效日为 2022 年 09 月 06 日，无上年度可比期间对比数据。

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

1. 本基金本报告期末与关联方进行转融通证券出借业务。

2. 本基金合同生效日为 2022 年 09 月 06 日，无上年度可比期间对比数据。

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

1. 本基金本报告期末与关联方进行转融通证券出借业务。

2. 本基金合同生效日为 2022 年 09 月 06 日，无上年度可比期间对比数据。

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

份额单位：份

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2022 年 9 月 6 日）持有的基金份额	9,999,275.00
报告期初持有的基金份额	9,999,275.00
报告期间申购/买入总份额	0.00
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	9,999,275.00
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	4.0410%

注：本基金合同生效日为 2022 年 9 月 6 日，无上年度可比期间对比数据。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	16,306,757.08	33,694.97

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人中国工商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“中国工商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 2023 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 925,611.93 元。

3. 本基金合同生效日为 2022 年 09 月 06 日，无上年度可比期间对比数据。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

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	2023 年 5 月 18 日	-	2023 年 5 月 18 日	0.0820	1,733,161.88	263,630.89	1,996,792.77	-
合计	-	-	-	0.0820	1,733,161.88	263,630.89	1,996,792.77	-

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	-------	-----	--------	------	--------	----------	--------	--------	----

601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	锁定期	10.36	11.84	295	3,056.20	3,492.80	-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	锁定期	11.66	12.26	248	2,891.68	3,040.48	-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	锁定期	25.98	24.53	96	2,494.08	2,354.88	-
603135	中重科技	2023年3月29日	6个月	锁定期	17.80	17.89	266	4,734.80	4,758.74	-
603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月	锁定期	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	锁定期	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688146	中船特气	2023年4月13日	6个月	锁定期	36.15	38.13	247	8,929.05	9,418.11	-
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	锁定期	14.16	16.21	551	7,802.16	8,931.71	-
688352	顾中科技	2023年4月11日	6个月	锁定期	12.10	12.07	721	8,724.10	8,702.47	-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	锁定期	19.20	25.53	284	5,452.80	7,250.52	-
688458	美芯晟	2023年5月15日	6个月	锁定期	75.00	90.76	97	7,275.00	8,803.72	-

688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	锁定期	5.69	5.41	2,871	16,335.99	15,532.11	-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	锁定期	11.10	17.04	1,099	12,198.90	18,726.96	-
688478	晶升股份	2023年4月13日	6个月	锁定期	32.52	42.37	289	9,398.28	12,244.93	-
688479	友车科技	2023年5月4日	6个月	锁定期	33.99	29.49	186	6,322.14	5,485.14	-
688512	慧智微	2023年5月8日	6个月	锁定期	20.92	19.16	361	7,552.12	6,916.76	-
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	锁定期	21.86	23.85	388	8,481.68	9,253.80	-
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月	锁定期	35.00	51.23	156	5,460.00	7,991.88	-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	锁定期	43.67	53.05	185	8,078.95	9,814.25	-
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	锁定期	21.17	23.50	355	7,515.35	8,342.50	-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	锁定期	12.68	22.31	520	6,593.60	11,601.20	-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	锁定期	125.80	118.03	64	8,051.20	7,553.92	-

688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	锁定期	26.74	40.68	300	8,022.00	12,204.00	-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	锁定期	11.18	14.59	613	6,853.34	8,943.67	-
688603	天承科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	55.00	55.00	1,321	72,655.00	72,655.00	-
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	锁定期	10.68	12.34	781	8,341.08	9,637.54	-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	锁定期	125.88	86.79	68	8,559.84	5,901.72	-
688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月	锁定期	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	锁定期	25.28	29.87	210	5,308.80	6,272.70	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.2.1 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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	2,239,553.59	2,215,083.56

合计	2,239,553.59	2,215,083.56
----	--------------	--------------

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	16,306,757.08	-	-	-	16,306,757.08
结算备付金	2,153,298.71	-	-	-	2,153,298.71
存出保证金	347,142.06	-	-	-	347,142.06
交易性金融资产	2,239,553.59	-	-	-228,218,861.06	230,458,414.65
应收申购款	-	-	-	6,441.35	6,441.35
应收清算款	-	-	-	1,242,651.89	1,242,651.89
资产总计	21,046,751.44	-	-	-229,467,954.30	250,514,705.74
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	307,615.81	307,615.81
应付托管费	-	-	-	51,269.28	51,269.28
其他负债	-	-	-	322,587.05	322,587.05
负债总计	-	-	-	681,472.14	681,472.14
利率敏感度缺口	21,046,751.44	-	-	-229,467,954.30	249,833,233.60
上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	22,374,093.59	-	-	-	22,374,093.59
结算备付金	1,320,693.56	-	-	-	1,320,693.56
存出保证金	613,797.61	-	-	-	613,797.61
交易性金融资产	2,215,083.56	-	-	-200,866,738.45	203,081,822.01
应收申购款	-	-	-	2,643.28	2,643.28
应收清算款	-	-	-	573,909.58	573,909.58
资产总计	26,523,668.32	-	-	-201,443,291.31	227,966,959.63
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	294,815.19	294,815.19
应付托管费	-	-	-	49,135.86	49,135.86

应交税费	-	-	-	5,415.21	5,415.21
其他负债	-	-	-	293,863.51	293,863.51
负债总计	-	-	-	643,229.77	643,229.77
利率敏感度缺口	26,523,668.32	-	-	-200,800,061.54	227,323,729.86

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 6 月 30 日，本基金主要投资于权益类金融工具，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响（2022 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	228,218,861.06	91.35	200,866,738.45	88.36
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,239,553.59	0.90	2,215,083.56	0.98
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	230,458,414.65	92.24	203,081,822.01	89.34

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准上升5%的影响金额	8,795,000.00	7,968,000.00
业绩比较基准下降5%的影响金额	-8,795,000.00	-7,968,000.00	

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	227,915,524.46	200,696,241.21
第二层次	2,312,208.59	2,215,083.56
第三层次	230,681.60	170,497.24
合计	230,458,414.65	203,081,822.01

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年6月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2022年12月31日)：

无)

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2023 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告**7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	228,218,861.06	91.10
	其中：股票	228,218,861.06	91.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,239,553.59	0.89
	其中：债券	2,239,553.59	0.89
	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	18,460,055.79	7.37
8	其他各项资产	1,596,235.30	0.64
9	合计	250,514,705.74	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	102,784.00	0.04
B	采矿业	11,670,945.00	4.67
C	制造业	73,060,504.16	29.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,864,396.00	2.75
E	建筑业	16,188,160.71	6.48
F	批发和零售业	13,294,768.00	5.32
G	交通运输、仓储和邮政业	21,977,865.00	8.80
H	住宿和餐饮业	2,358,040.00	0.94

I	信息传输、软件和信息技术服务业	781,279.04	0.31
J	金融业	59,587,333.44	23.85
K	房地产业	21,156,125.00	8.47
L	租赁和商务服务业	150,968.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	90,305.71	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	695,041.00	0.28
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	76,806.00	0.03
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	163,540.00	0.07
	合计	228,218,861.06	91.35

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。

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	600985	淮北矿业	634,700	7,311,744.00	2.93
2	600820	隧道股份	1,216,000	7,308,160.00	2.93
3	600755	厦门国贸	940,000	7,275,600.00	2.91
4	600502	安徽建工	1,369,349	7,230,162.72	2.89
5	600919	江苏银行	977,200	7,182,420.00	2.87
6	600064	南京高科	1,079,300	7,134,173.00	2.86
7	600350	山东高速	1,117,300	7,117,201.00	2.85
8	601336	新华保险	193,502	7,115,068.54	2.85
9	600035	楚天高速	1,743,700	7,114,296.00	2.85
10	601006	大秦铁路	956,700	7,108,281.00	2.85
11	601577	长沙银行	895,300	6,947,528.00	2.78
12	601166	兴业银行	421,700	6,599,605.00	2.64
13	600642	申能股份	935,800	6,541,242.00	2.62
14	600901	江苏金租	1,549,940	6,401,252.20	2.56
15	601838	成都银行	511,200	6,241,752.00	2.50
16	601009	南京银行	766,800	6,134,400.00	2.46
17	601658	邮储银行	1,160,400	5,674,356.00	2.27
18	600325	华发股份	515,700	5,079,645.00	2.03
19	600546	山煤国际	333,500	4,825,745.00	1.93
20	603013	亚普股份	300,000	4,704,000.00	1.88
21	600665	天地源	1,097,400	4,444,470.00	1.78
22	600348	华阳股份	551,100	4,359,201.00	1.74
23	001979	招商蛇口	300,000	3,909,000.00	1.56

24	600926	杭州银行	316,300	3,716,525.00	1.49
25	002966	苏州银行	545,714	3,574,426.70	1.43
26	603298	杭叉集团	122,300	2,880,165.00	1.15
27	605300	佳禾食品	123,800	2,691,412.00	1.08
28	603519	立霸股份	178,200	2,640,924.00	1.06
29	002533	金杯电工	322,300	2,629,968.00	1.05
30	603156	养元饮品	106,000	2,618,200.00	1.05
31	600211	西藏药业	43,600	2,589,840.00	1.04
32	600166	福田汽车	751,500	2,555,100.00	1.02
33	000534	万泽股份	151,700	2,544,009.00	1.02
34	600572	康恩贝	368,900	2,526,965.00	1.01
35	300718	长盛轴承	111,600	2,483,100.00	0.99
36	002345	潮宏基	315,400	2,479,044.00	0.99
37	605499	东鹏饮料	14,200	2,455,180.00	0.98
38	603507	振江股份	65,700	2,382,282.00	0.95
39	605108	同庆楼	70,600	2,358,040.00	0.94
40	002275	桂林三金	129,400	2,330,494.00	0.93
41	300129	泰胜风能	240,800	2,309,272.00	0.92
42	002919	名臣健康	51,080	2,303,708.00	0.92
43	603567	珍宝岛	149,000	2,229,040.00	0.89
44	002991	甘源食品	28,900	2,216,630.00	0.89
45	600129	太极集团	36,200	2,153,538.00	0.86
46	600479	千金药业	136,100	1,535,208.00	0.61
47	600997	开滦股份	193,300	1,154,001.00	0.46
48	600355	精伦电子	200,000	692,000.00	0.28
49	600448	华纺股份	218,200	648,054.00	0.26
50	002247	聚力文化	200,000	420,000.00	0.17
51	688525	佰维存储	4,430	353,912.70	0.14
52	603828	柯利达	106,000	315,880.00	0.13
53	603042	华脉科技	12,400	311,984.00	0.12
54	002921	联诚精密	11,600	208,916.00	0.08
55	301007	德迈仕	13,400	206,762.00	0.08
56	600137	浪莎股份	10,600	203,308.00	0.08
57	603286	日盈电子	10,100	199,475.00	0.08
58	600791	京能置业	42,000	192,780.00	0.08
59	300749	顶固集创	20,700	190,233.00	0.08
60	603615	茶花股份	20,000	188,800.00	0.08
61	600768	宁波富邦	17,400	188,790.00	0.08
62	600148	长春一东	11,300	188,710.00	0.08
63	002199	东晶电子	22,100	188,071.00	0.08
64	002780	三夫户外	13,800	187,680.00	0.08
65	300823	建科机械	9,100	187,005.00	0.07
66	603725	天安新材	23,000	186,990.00	0.07

67	300611	美力科技	19,200	185,088.00	0.07
68	300807	天迈科技	6,300	184,275.00	0.07
69	603709	中源家居	10,100	183,214.00	0.07
70	300717	华信新材	10,600	180,730.00	0.07
71	603879	永悦科技	26,500	179,670.00	0.07
72	300743	天地数码	11,400	179,208.00	0.07
73	002806	华锋股份	14,000	179,200.00	0.07
74	603926	铁流股份	17,500	179,025.00	0.07
75	300665	飞鹿股份	20,500	178,145.00	0.07
76	301053	远信工业	7,000	177,590.00	0.07
77	605255	天普股份	11,200	176,960.00	0.07
78	603038	华立股份	20,100	176,880.00	0.07
79	002899	英派斯	11,800	176,646.00	0.07
80	600250	南纺股份	28,300	175,743.00	0.07
81	600192	长城电工	30,300	175,437.00	0.07
82	600593	大连圣亚	10,700	175,266.00	0.07
83	600615	丰华股份	19,900	174,523.00	0.07
84	300195	长荣股份	27,600	173,328.00	0.07
85	600099	林海股份	18,500	173,160.00	0.07
86	301131	聚赛龙	4,300	172,774.00	0.07
87	300851	交大思诺	6,400	172,416.00	0.07
88	301182	凯旺科技	7,500	172,275.00	0.07
89	301070	开勒股份	4,600	172,040.00	0.07
90	603238	诺邦股份	13,600	171,496.00	0.07
91	605258	协和电子	6,600	171,468.00	0.07
92	300030	阳普医疗	22,900	171,063.00	0.07
93	002357	富临运业	25,400	170,688.00	0.07
94	301163	宏德股份	5,400	170,370.00	0.07
95	600444	国机通用	12,400	170,252.00	0.07
96	603089	正裕工业	19,000	168,910.00	0.07
97	603316	诚邦股份	27,500	168,850.00	0.07
98	001296	长江材料	8,000	168,080.00	0.07
99	603696	安记食品	17,800	168,032.00	0.07
100	603928	兴业股份	13,900	167,773.00	0.07
101	002963	豪尔赛	11,500	167,325.00	0.07
102	603499	翔港科技	17,500	166,950.00	0.07
103	603045	福达合金	11,000	166,540.00	0.07
104	301042	安联锐视	4,900	166,355.00	0.07
105	301098	金埔园林	13,800	166,290.00	0.07
106	003003	天元股份	15,700	166,106.00	0.07
107	600302	标准股份	31,500	166,005.00	0.07
108	300074	华平股份	38,400	165,504.00	0.07
109	300329	海伦钢琴	23,400	165,438.00	0.07

110	002830	名雕股份	12,900	165,249.00	0.07
111	000605	渤海股份	26,100	164,952.00	0.07
112	603159	上海亚虹	11,200	164,752.00	0.07
113	603090	宏盛股份	7,400	164,650.00	0.07
114	300281	金明精机	30,700	164,552.00	0.07
115	000702	正虹科技	30,000	164,400.00	0.07
116	600883	博闻科技	21,600	163,944.00	0.07
117	000609	中迪投资	34,000	163,540.00	0.07
118	002715	登云股份	11,100	163,059.00	0.07
119	002778	中晟高科	11,200	162,624.00	0.07
120	002861	瀛通通讯	14,200	162,448.00	0.07
121	001202	炬申股份	11,000	162,360.00	0.06
122	300243	瑞丰高材	18,400	161,920.00	0.06
123	603332	苏州龙杰	14,800	161,764.00	0.06
124	603037	凯众股份	11,830	161,716.10	0.06
125	605180	华生科技	13,000	160,810.00	0.06
126	002718	友邦吊顶	10,600	160,696.00	0.06
127	003001	中岩大地	9,800	160,524.00	0.06
128	000929	兰州黄河	16,400	160,392.00	0.06
129	603536	惠发食品	24,800	159,712.00	0.06
130	600889	南京化纤	33,900	159,669.00	0.06
131	000985	大庆华科	9,800	158,760.00	0.06
132	002826	易明医药	14,400	158,544.00	0.06
133	600149	廊坊发展	28,200	158,202.00	0.06
134	002802	洪汇新材	14,300	158,158.00	0.06
135	603389	亚振家居	29,700	158,004.00	0.06
136	603079	圣达生物	12,300	157,563.00	0.06
137	002105	信隆健康	26,400	157,080.00	0.06
138	301057	汇隆新材	9,100	156,884.00	0.06
139	603838	四通股份	27,800	156,514.00	0.06
140	300703	创源股份	16,400	156,128.00	0.06
141	603226	菲林格尔	30,600	156,060.00	0.06
142	300854	中兰环保	9,800	155,820.00	0.06
143	301003	江苏博云	6,700	154,837.00	0.06
144	603726	朗迪集团	12,200	154,452.00	0.06
145	603813	原尚股份	10,700	154,401.00	0.06
146	000590	启迪药业	17,700	154,344.00	0.06
147	600051	宁波联合	21,000	152,880.00	0.06
148	600697	欧亚集团	12,400	152,644.00	0.06
149	603506	南都物业	12,800	151,424.00	0.06
150	301130	西点药业	5,500	151,140.00	0.06
151	600539	狮头股份	22,600	150,968.00	0.06
152	002910	庄园牧场	13,700	150,700.00	0.06

153	301040	中环海陆	7,300	150,015.00	0.06
154	600272	开开实业	16,600	149,898.00	0.06
155	603716	塞力医疗	15,800	148,994.00	0.06
156	300218	安利股份	15,800	148,836.00	0.06
157	605069	正和生态	17,000	148,750.00	0.06
158	600692	亚通股份	26,600	148,428.00	0.06
159	600678	四川金顶	27,700	147,918.00	0.06
160	603616	韩建河山	28,400	147,680.00	0.06
161	000619	海螺新材	24,200	147,620.00	0.06
162	600319	亚星化学	29,300	147,086.00	0.06
163	002620	瑞和股份	28,200	146,640.00	0.06
164	603021	山东华鹏	28,400	145,124.00	0.06
165	300562	乐心医疗	14,700	144,060.00	0.06
166	603717	天域生态	21,200	143,948.00	0.06
167	600107	美尔雅	26,800	143,916.00	0.06
168	605081	太和水	8,900	132,521.00	0.05
169	605303	园林股份	11,400	126,540.00	0.05
170	605003	众望布艺	5,500	105,765.00	0.04
171	300106	西部牧业	12,800	102,784.00	0.04
172	000608	阳光股份	35,500	96,205.00	0.04
173	605178	时空科技	3,700	83,176.00	0.03
174	002890	弘宇股份	5,600	82,712.00	0.03
175	300816	艾可蓝	2,800	82,684.00	0.03
176	300564	筑博设计	6,100	81,374.00	0.03
177	002209	达意隆	7,900	80,975.00	0.03
178	300694	蠡湖股份	7,600	80,788.00	0.03
179	301113	雅艺科技	2,800	80,668.00	0.03
180	603023	威帝股份	19,600	79,968.00	0.03
181	603059	倍加洁	3,500	79,590.00	0.03
182	603580	艾艾精工	5,500	78,265.00	0.03
183	600493	凤竹纺织	13,900	77,840.00	0.03
184	605318	法狮龙	5,600	77,616.00	0.03
185	003017	大洋生物	2,300	77,395.00	0.03
186	600857	宁波中百	7,800	77,220.00	0.03
187	603041	美思德	6,400	76,928.00	0.03
188	600847	万里股份	6,300	76,923.00	0.03
189	600455	博通股份	3,400	76,806.00	0.03
190	603937	丽岛新材	6,600	76,494.00	0.03
191	603150	万朗磁塑	2,900	76,444.00	0.03
192	002136	安纳达	6,700	76,246.00	0.03
193	600561	江西长运	14,400	75,888.00	0.03
194	002278	神开股份	14,100	75,153.00	0.03
195	300176	派生科技	12,200	75,152.00	0.03

196	000679	大连友谊	15,200	74,936.00	0.03
197	600281	华阳新材	18,500	74,925.00	0.03
198	002492	恒基达鑫	13,000	74,750.00	0.03
199	301016	雷尔伟	3,700	74,222.00	0.03
200	603139	康惠制药	4,500	73,710.00	0.03
201	600538	国发股份	17,400	73,428.00	0.03
202	688603	天承科技	1,321	72,655.00	0.03
203	301065	本立科技	3,450	71,380.50	0.03
204	301023	江南奕帆	1,300	60,385.00	0.02
205	002671	龙泉股份	13,200	55,572.00	0.02
206	300283	温州宏丰	8,000	47,200.00	0.02
207	688472	阿特斯	1,099	18,726.96	0.01
208	688469	中芯集成	2,871	15,532.11	0.01
209	301063	海锅股份	500	13,930.00	0.01
210	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.01
211	688478	晶升股份	289	12,244.93	0.00
212	688582	芯动联科	300	12,204.00	0.00
213	688562	航天软件	520	11,601.20	0.00
214	688543	国科军工	185	9,814.25	0.00
215	688620	安凯微	781	9,637.54	0.00
216	688146	中船特气	247	9,418.11	0.00
217	688523	航天环宇	388	9,253.80	0.00
218	688593	新相微	613	8,943.67	0.00
219	688334	西高院	551	8,931.71	0.00
220	688458	美芯晟	97	8,803.72	0.00
221	688352	颀中科技	721	8,702.47	0.00
222	688552	航天南湖	355	8,342.50	0.00
223	688535	华海诚科	156	7,991.88	0.00
224	688581	安杰思	64	7,553.92	0.00
225	688429	时创能源	284	7,250.52	0.00
226	688512	慧智微	361	6,916.76	0.00
227	688631	莱斯信息	210	6,272.70	0.00
228	688623	双元科技	68	5,901.72	0.00
229	688479	友车科技	186	5,485.14	0.00
230	603135	中重科技	266	4,758.74	0.00
231	601065	江盐集团	295	3,492.80	0.00
232	601133	柏诚股份	248	3,040.48	0.00
233	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
234	603125	常青科技	96	2,354.88	0.00
235	603172	万丰股份	122	1,967.86	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	600035	楚天高速	13,492,662.00	5.94
2	600325	华发股份	11,146,467.00	4.90
3	600704	物产中大	10,929,741.00	4.81
4	000906	浙商中拓	10,908,683.16	4.80
5	600985	淮北矿业	10,643,080.00	4.68
6	600582	天地科技	10,573,639.00	4.65
7	601857	中国石油	10,283,860.00	4.52
8	600502	安徽建工	8,102,957.25	3.56
9	601699	潞安环能	7,621,477.20	3.35
10	300129	泰胜风能	7,440,304.76	3.27
11	688009	中国通号	7,383,595.76	3.25
12	601336	新华保险	7,292,414.42	3.21
13	601577	长沙银行	7,198,550.00	3.17
14	000708	中信特钢	7,123,328.00	3.13
15	000932	华菱钢铁	6,975,238.00	3.07
16	600674	川投能源	6,829,804.72	3.00
17	601598	中国外运	6,673,204.00	2.94
18	600642	申能股份	6,153,513.00	2.71
19	600710	苏美达	5,569,057.00	2.45
20	600348	华阳股份	5,426,816.50	2.39
21	600211	西藏药业	5,206,093.00	2.29
22	600312	平高电气	5,168,819.00	2.27
23	603369	今世缘	5,159,368.39	2.27
24	002270	华明装备	5,140,819.50	2.26
25	600166	福田汽车	5,134,752.00	2.26
26	000534	万泽股份	5,088,506.00	2.24
27	002275	桂林三金	5,078,743.00	2.23
28	605108	同庆楼	5,027,025.00	2.21
29	002128	电投能源	4,995,879.74	2.20
30	600350	山东高速	4,910,300.00	2.16
31	603507	振江股份	4,904,403.00	2.16
32	600665	天地源	4,761,183.00	2.09
33	600479	千金药业	4,749,016.00	2.09
34	600019	宝钢股份	4,730,123.00	2.08
35	603013	亚普股份	4,699,778.00	2.07

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

	码			
1	600704	物产中大	14,793,316.00	6.51
2	601857	中国石油	11,242,024.00	4.95
3	600325	华发股份	10,974,432.00	4.83
4	601298	青岛港	10,848,295.26	4.77
5	600582	天地科技	10,387,726.00	4.57
6	000906	浙商中拓	10,255,245.86	4.51
7	002128	电投能源	9,307,914.30	4.09
8	600035	楚天高速	8,404,713.85	3.70
9	600057	厦门象屿	8,264,811.74	3.64
10	688009	中国通号	8,246,708.07	3.63
11	600674	川投能源	8,171,586.00	3.59
12	600028	中国石化	8,131,175.00	3.58
13	601098	中南传媒	7,950,239.00	3.50
14	601939	建设银行	7,872,978.00	3.46
15	601668	中国建筑	7,743,531.40	3.41
16	600449	宁夏建材	7,580,051.00	3.33
17	601699	潞安环能	7,340,270.60	3.23
18	000932	华菱钢铁	6,942,551.80	3.05
19	601598	中国外运	6,287,251.00	2.77
20	601225	陕西煤业	5,736,235.00	2.52
21	000708	中信特钢	5,717,751.66	2.52
22	300129	泰胜风能	5,694,391.28	2.50
23	600710	苏美达	5,617,580.69	2.47
24	002270	华明装备	5,281,663.97	2.32
25	600350	山东高速	5,214,488.00	2.29
26	600312	平高电气	5,044,898.00	2.22
27	601601	中国太保	4,834,072.00	2.13
28	603369	今世缘	4,796,209.61	2.11
29	000090	天健集团	4,771,180.00	2.10

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	455,638,436.17
卖出股票收入（成交）总额	443,421,634.95

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	2,239,553.59	0.90
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	2,239,553.59	0.90

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	019679	22 国债 14	22,000	2,239,553.59	0.90

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金于本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，选择流动性好、交易活跃的标的指数对应的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，同时兼顾基差的变化，以达到有效跟踪并力争超越标的指数的目的。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	347,142.06
2	应收清算款	1,242,651.89
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,441.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,596,235.30

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

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
4,106	60,264.99	123,049,267.86	49.73	124,398,781.87	50.27

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	3,706,312.13	1.4978

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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2022年9月6日）基金份额总额	240,487,588.11
本报告期期初基金份额总额	241,590,538.80
本报告期基金总申购份额	5,857,510.93
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	247,448,049.73

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、基金财产的诉讼事项。

本报告期内未涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金进行审计。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其高级管理人员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 (%)	
长江证券	1	633,090,791.94	70.67	273,056.73	66.93	-
天风证券	1	190,758,292.11	21.29	82,278.23	20.17	-
光大证券股份有限公司	2	72,012,490.78	8.04	52,661.68	12.91	-

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
长江证券	600,857.94	100.00	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

光大证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
------------------------	---	---	---	---	---	---

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	西部利得基金管理有限公司关于即将终止民商基金销售（上海）有限公司办理相关销售业务的提示性公告	基金管理人公司网站、中国证监会基金电子披露网站及本基金选定的信息披露报纸	2023 年 4 月 6 日
2	西部利得基金管理有限公司关于即将终止浦领基金销售有限公司办理相关销售业务并为投资者办理转托管业务的提示性公告	同上	2023 年 6 月 1 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本报告期内，本基金未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.westleadfund.com> 投资人对本报告如有疑问，

可咨询本基金管理人西部利得基金管理有限公司，咨询电话 4007-007-818（免长途话费）或发电子邮件，E-mail:service@westleadfund.com。

西部利得基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日