

西部利得量化优选一年持有期混合型证券  
投资基金  
2024 年中期报告

2024 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：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 29 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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59
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	59

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.....	59
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.....	59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	60
7.12 投资组合报告附注.....	60
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>61</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
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.....	61
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>62</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>62</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	62
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.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
10.4 基金投资策略的改变.....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
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.....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	63
10.8 其他重大事件.....	65
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>65</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
<b>§ 12 备查文件目录.....</b>	<b>65</b>
12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	65
12.3 查阅方式.....	65

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	西部利得量化优选一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	西部利得量化优选一年持有期混合	
基金主代码	010779	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 1 月 19 日	
基金管理人	西部利得基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	403,452,490.76 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	西部利得量化优选一年持有期混合 A	西部利得量化优选一年持有期混合 C
下属分级基金的交易代码	010779	010780
报告期末下属分级基金的份额总额	306,362,294.62 份	97,090,196.14 份

### 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、债券投资策略、资产支持证券的投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、融资交易策略等。（详见《基金合同》）
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*75%+中债综合全价（总值）指数收益率*25%
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	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵毅	石立平
	联系电话	021-38572888	010-63639180
	电子邮箱	service@westleadfund.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		4007-007-818	95595
传真		021-50710261	010-63639132
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区耀体路 276 号 901 室-908 室	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区耀体路 276 号 901 室-908 室	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码		200126	100033
法定代表人		何方	吴利军

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	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(2024年1月1日-2024年6月30日)	
	西部利得量化优选一年持有期混合 A	西部利得量化优选一年持有期混合 C
本期已实现收益	-42,317,702.91	-12,532,111.62
本期利润	-57,403,627.33	-16,816,513.32
加权平均基金份额 本期利润	-0.1764	-0.1689
本期加权平均净 值利润率	-20.11%	-19.52%
本期基金份额净 值增长率	-16.64%	-16.82%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利 润	-55,546,261.98	-18,776,967.60
期末可供分配基 金份额利润	-0.1813	-0.1934
期末基金资产净 值	253,687,131.79	79,286,435.78
期末基金份额净 值	0.8281	0.8166
3.1.3 累计期 末指标	报告期末(2024年6月30日)	

基金份额累计净值增长率	-13.12%	-14.31%
-------------	---------	---------

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用（除暂估附加税）后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益与本期暂估附加税费的合计值。

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

西部利得量化优选一年持有期混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-7.05%	1.52%	-5.04%	0.72%	-2.01%	0.80%
过去三个月	-4.72%	1.33%	-4.59%	0.85%	-0.13%	0.48%
过去六个月	-16.64%	1.64%	-5.97%	1.20%	-10.67%	0.44%
过去一年	-15.73%	1.31%	-12.49%	0.95%	-3.24%	0.36%
过去三年	-26.55%	1.41%	-19.29%	0.90%	-7.26%	0.51%
自基金合同生效起至今	-13.12%	1.43%	-16.39%	0.88%	3.27%	0.55%

西部利得量化优选一年持有期混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-7.09%	1.52%	-5.04%	0.72%	-2.05%	0.80%
过去三个月	-4.81%	1.33%	-4.59%	0.85%	-0.22%	0.48%
过去六个月	-16.82%	1.64%	-5.97%	1.20%	-10.85%	0.44%
过去一年	-16.07%	1.31%	-12.49%	0.95%	-3.58%	0.36%

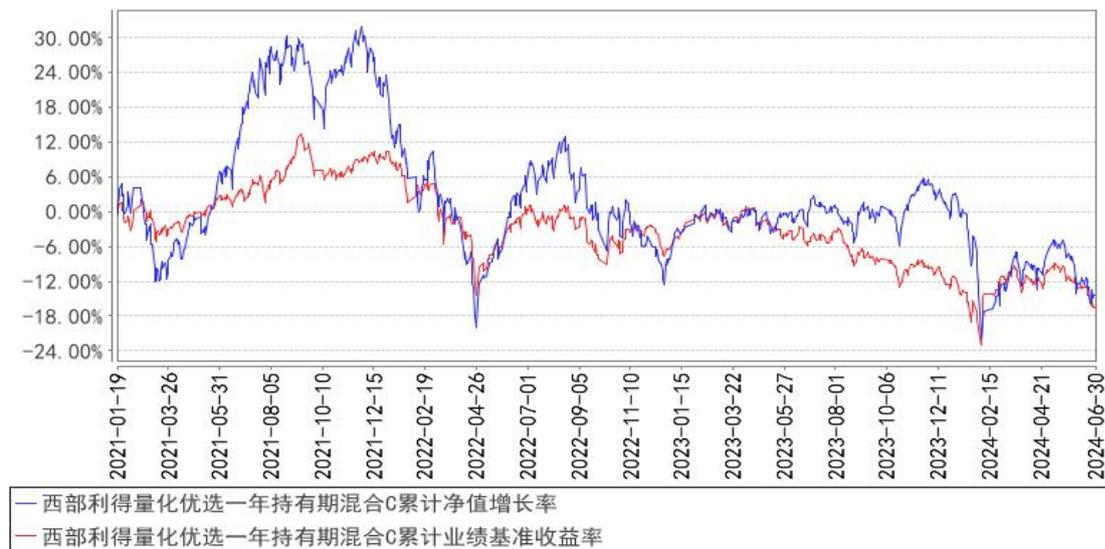
过去三年	-27.43%	1.41%	-19.29%	0.90%	-8.14%	0.51%
自基金合同生效 起至今	-14.31%	1.43%	-16.39%	0.88%	2.08%	0.55%

### 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

西部利得量化优选一年持有期混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



西部利得量化优选一年持有期混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### 3.3 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。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		
翟梓舰	基金经理	2023 年 10 月 28 日	-	6 年	美国哥伦比亚大学工业工程专业硕士。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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。当前相对基准指数正向暴露的风格因子不明显；负向暴露的风格因子主要为市值、杠杆。量子策略选择上有一定灵活度，股票持仓分散以弱化个股黑天鹅的影响。本基金量化策略的特点是基于人工智能的多因子策略、基于分域建模的主动量化策略、量化为舟主观为舵，努力打造多策略风格的优质量化基金。感谢持有人的支持与信任，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 2024 年下半年，影响 A 股的主要有三股力量。

其一是美联储降息节奏

美联储降息预期几度变化，人民币汇率和人民币资产也几经涨落。美联储降息速度可能会在

未来一段时间内成为 A 股（特别是龙头股）的重要影响因素之一。

#### 其二是中央加杠杆节奏

随着地产驱动的经济模式告一段落，居民部门、企业部门、地方政府部门的杠杆率也阶段性见顶，短期稳经济主要依赖于中央加杠杆。未来中国经济以及和经济紧密相关的股票资产表现可能取决于中央加杠杆的节奏。中央加杠杆或以对冲内外部负面压力的形式展开，危中有机。

#### 其三是高质量发展的推进

中国经济高质量发展是未来一段时间的主旋律。高质量发展对于不同行业不同所有制企业的内涵不尽相同。对于过去贡献了大量社会正外部性的国企而言，高质量发展一般意味着 ROE 的提升；对于部分民企而言，高质量发展意味着减少社会负外部性以及增加正外部性，相关行业进入高质量替代高增速的发展模式。国企、特别是央企股票值得重点关注，它们是新时代的“核心资产”。央企股票不止是高股息资产，不少央企中小票也有投资价值，这部分市场远未定价。

整体来看，A 股权益市场估值处于历史低位区域，所以当下非常看好未来权益市场表现，结构上看好央企潜力资产，其符合当下投资者的偏好，其中央企中小票当前定价并不充分。小市值风格一季度的大幅回撤和反弹深刻影响了市场对该类资产的交易模式，该板块未来潜在的波动可能加大，但考虑到其和中证 800 指数成分股的低相关性，该板块仍有配置价值。

## 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遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在《西部利得量化优选一年持有期混合型证券投资基金》（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

#### 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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《西部利得量化优选一年持有期混合型证券投资基金 2024 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

### § 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：西部利得量化优选一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	29,665,063.83	59,131,646.69
结算备付金		6,638,808.88	5,398,352.27
存出保证金		1,598,415.74	1,323,668.69
交易性金融资产	6.4.7.2	295,604,088.58	412,127,596.82
其中：股票投资		295,604,088.58	412,127,596.82
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		674,193.12	-
应收股利		-	-
应收申购款		7,026.56	117,374.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		334,187,596.71	478,098,638.48
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		36,037.18	19,438,167.55
应付赎回款		26,296.34	670,907.83
应付管理人报酬		337,026.18	466,681.36
应付托管费		56,171.03	77,780.22
应付销售服务费		26,641.07	34,611.70
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	731,857.34	992,259.44
负债合计		1,214,029.14	21,680,408.10
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	403,452,490.76	460,671,134.61
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-70,478,923.19	-4,252,904.23
净资产合计		332,973,567.57	456,418,230.38
负债和净资产总计		334,187,596.71	478,098,638.48

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，西部利得量化优选一年持有期混合 A 基金份额净值为 0.8281 元，基金份额总额为 306,362,294.62 份；西部利得量化优选一年持有期混合 C 基金份额净值为 0.8166 元，基金份额总额为 97,090,196.14 份。西部利得量化优选一年持有期混合基金总份额为 403,452,490.76 份。

## 6.2 利润表

会计主体：西部利得量化优选一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-71,385,625.95	61,943,319.75
1. 利息收入		157,231.95	201,500.50
其中：存款利息收入	6.4.7.13	157,231.95	201,500.50
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-52,172,531.78	31,292,113.89
其中：股票投资收益		-55,885,094.29	26,804,736.77
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
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	328,701.45	257,964.37
股利收益	6.4.7.19	3,383,861.06	4,229,412.75

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	-19,370,326.12	30,449,705.36
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	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		2,834,514.70	4,804,579.93
1. 管理人报酬		2,212,373.09	3,956,476.40
2. 托管费		368,728.92	527,530.11
3. 销售服务费		171,011.25	225,027.23
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		3,632.04	1,326.64
8. 其他费用	6.4.7.23	78,769.40	94,219.55
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		-74,220,140.65	57,138,739.82
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		-74,220,140.65	57,138,739.82
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-74,220,140.65	57,138,739.82

### 6.3 净资产变动表

会计主体：西部利得量化优选一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	460,671,134.61	-4,252,904.23	456,418,230.38
二、本年期初净资产	460,671,134.61	-4,252,904.23	456,418,230.38
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-57,218,643.85	-66,226,018.96	-123,444,662.81
(一)、综合收益总额	-	-74,220,140.65	-74,220,140.65
(二)、本期基金份额交易产生的净资	-57,218,643.85	7,994,121.69	-49,224,522.16

产变动数 (净资产减少以“-” 号填列)			
其中:1. 基金申购款	2,630,562.45	-301,361.25	2,329,201.20
2. 基金赎回 款	-59,849,206.30	8,295,482.94	-51,553,723.36
(三)、本期向基金 份额持有人分配利 润产生的净资产变 动(净资产减少以 “-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	403,452,490.76	-70,478,923.19	332,973,567.57
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	602,477,918.39	-71,230,890.43	531,247,027.96
二、本期期初净资产	602,477,918.39	-71,230,890.43	531,247,027.96
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填 列)	-76,223,870.95	61,037,984.14	-15,185,886.81
(一)、综合收益总 额	-	57,138,739.82	57,138,739.82
(二)、本期基金份 额交易产生的净资 产变动数 (净资产减少以“-” 号填列)	-76,223,870.95	3,899,244.32	-72,324,626.63
其中:1. 基金申购款	6,612,290.89	-308,481.94	6,303,808.95
2. 基金赎回 款	-82,836,161.84	4,207,726.26	-78,628,435.58
(三)、本期向基金 份额持有人分配利 润产生的净资产变 动(净资产减少以 “-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	526,254,047.44	-10,192,906.29	516,061,141.15

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

贺燕萍

贺燕萍

张皞骏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

西部利得量化优选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[2020]3017号《关于准予西部利得量化优选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《西部利得量化优选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402,595,060.25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2100001号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《西部利得量化优选一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于2021年1月19日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为402,667,413.30份基金份额,其中认购资金利息折合72,353.05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,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《西部利得量化优选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、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、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、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的二级资本债、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或票据)、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:中证500指数收益率\*75%+中债综合全价(总值)指数收益率\*25%。

#### 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》(以下合称“企业会计准则”)的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》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的要求,真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况、2024 年 1 月 1 日至 2024 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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财税[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《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《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《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》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《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《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》、财税[2023] 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》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) 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。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券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。

(b) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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。

(c) 对基金从上市公司、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，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% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(d) 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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(e) 对基金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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	29,665,063.83

等于：本金	29,658,663.55
加：应计利息	6,400.28
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	29,665,063.83

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 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	318,744,670.34	-	295,604,088.58	-23,140,581.76
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	318,744,670.34	-	295,604,088.58	-23,140,581.76

#### 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 2024 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍	-	-	-	-

生工具				
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	12,268,320.00	-	-	-
其中：股指期货投资	12,268,320.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	12,268,320.00	-	-	-

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
IC2407	IC2407	12.00	11,802,240.00	-466,080.00
合计				-466,080.00
减：可抵销期货暂收款				-466,080.00
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发生债权投资减值准备。

**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发生其他债权投资减值准备。

**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 2024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	653,287.94
其中：交易所市场	653,287.94
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	78,569.40
合计	731,857.34

**6.4.7.10 实收基金**

金额单位：人民币元

西部利得量化优选一年持有期混合 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	356,862,660.98	356,862,660.98
本期申购	2,469,329.13	2,469,329.13
本期赎回（以“-”号填列）	-52,969,695.49	-52,969,695.49
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	306,362,294.62	306,362,294.62

## 西部利得量化优选一年持有期混合 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	103,808,473.63	103,808,473.63
本期申购	161,233.32	161,233.32
本期赎回(以“-”号填列)	-6,879,510.81	-6,879,510.81
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	97,090,196.14	97,090,196.14

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

## 西部利得量化优选一年持有期混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-21,755,953.15	19,407,565.30	-2,348,387.85
本期期初	-21,755,953.15	19,407,565.30	-2,348,387.85
本期利润	-42,317,702.91	-15,085,924.42	-57,403,627.33
本期基金份额交易产生的变动数	8,527,394.08	-1,450,541.73	7,076,852.35
其中：基金申购款	-395,985.94	113,638.62	-282,347.32
基金赎回款	8,923,380.02	-1,564,180.35	7,359,199.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-55,546,261.98	2,871,099.15	-52,675,162.83

## 西部利得量化优选一年持有期混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-7,552,344.14	5,647,827.76	-1,904,516.38
本期期初	-7,552,344.14	5,647,827.76	-1,904,516.38
本期利润	-12,532,111.62	-4,284,401.70	-16,816,513.32
本期基金份额交易产生的变动数	1,307,488.16	-390,218.82	917,269.34
其中：基金申购款	-26,427.37	7,413.44	-19,013.93
基金赎回款	1,333,915.53	-397,632.26	936,283.27

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-18,776,967.60	973,207.24	-17,803,760.36

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入		135,413.38
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		20,032.09
其他		1,786.48
合计		157,231.95

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-55,885,094.29
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	-55,885,094.29

##### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	1,859,383,079.03
减：卖出股票成本总额	1,912,502,553.81
减：交易费用	2,765,619.51
买卖股票差价收入	-55,885,094.29

##### 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

本基金本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

##### 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

本基金本报告期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

本基金本报告期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

本基金本报告期末持有贵金属。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期末持有贵金属。

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末持有贵金属。

##### 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末持有贵金属。

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	328,701.45

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,383,861.06
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,383,861.06

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-18,903,006.12
股票投资	-18,903,006.12
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-467,320.00
权证投资	-
期货投资	-467,320.00
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	-19,370,326.12

## 6.4.7.21 其他收入

本基金本报告期末有其他收入。

## 6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

## 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	18,897.06

信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	200.00
合计	78,769.40

#### 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
中国光大银行股份有限公司	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均无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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 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	2,212,373.09	3,956,476.40
其中：应支付销售机构的客户维护费	808,742.37	1,481,543.94
应支付基金管理人的净管理费	1,403,630.72	2,474,932.46

注：支付基金管理人西部利得基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.20% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 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	368,728.92	527,530.11

注：支付基金托管人中国光大银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 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 2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	西部利得量化优选一 年持有期混合 A	西部利得量化优选一 年持有期混合 C	合计
西部利得基金管理有限公司	-	444.71	444.71
西部证券股份有限公司	-	652.81	652.81
中国光大银行股份有限 公司	-	148,526.77	148,526.77

合计	-	149,624.29	149,624.29
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	西部利得量化优选一年持有期混合 A	西部利得量化优选一年持有期混合 C	合计
中国光大银行股份有限公司	-	192,791.07	192,791.07
西部利得基金管理有限公司	-	501.72	501.72
西部证券股份有限公司	-	874.89	874.89
合计	-	194,167.68	194,167.68

注：支付基金销售机构的销售服务费：

按前一日 C 类基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给西部利得基金管理有限公司，再由西部利得基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均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

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	29,665,063.83	135,413.38	31,101,260.35	182,170.06

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人中国光大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“中国光大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2024年06月30日的相关余额为人民币2,901,262.79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

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

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024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
001359	平安电工	2024年3月19日	6个月	锁定期	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001379	腾达科技	2024年1月11日	6个月	锁定期	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
001387	雪祺电气	2024年1月4日	6个月	锁定期	15.38	15.25	133	2,045.54	2,028.25	-
001387	雪祺	2024年6月	6个月	锁定期	0	15.25	40	0.00	610.00	锁定期内

	电 气	月 3 日								送股
001389	广 合 科 技	2024 年 3 月 26 日	6 个月	锁定期	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301392	汇 成 真 空	2024 年 5 月 28 日	6 个月	锁定期	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华 阳 智 能	2024 年 1 月 26 日	6 个月	锁定期	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星 宸 科 技	2024 年 3 月 20 日	6 个月	锁定期	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏 鼎 达	2024 年 3 月 13 日	6 个月	锁定期	55.82	91.24	107	5,972.74	9,762.68	-
301538	骏 鼎 达	2024 年 5 月 22 日	6 个月	锁定期	0	91.24	43	0.00	3,923.32	锁定期内 送股
301539	宏 鑫 科 技	2024 年 4 月 3 日	6 个月	锁定期	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中 仑 新 材	2024 年 6 月 13 日	6 个月	锁定期	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301566	达 利 凯 普	2023 年 12 月 22 日	6 个月	锁定期	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱 迪 特	2024 年 6 月 19 日	6 个月	锁定期	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
301587	中 瑞	2024 年 3	6 个月	锁定期	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-

	股份	月 27 日								
301588	美新科技	2024 年 3 月 6 日	6 个月	锁定期	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301589	诺瓦星云	2024 年 2 月 1 日	6 个月	锁定期	126.89	188.01	493	62,556.77	92,688.93	-
301589	诺瓦星云	2024 年 5 月 30 日	6 个月	锁定期	0	188.01	394	0.00	74,075.94	锁定期内送股
301591	肯特股份	2024 年 2 月 20 日	6 个月	锁定期	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
601033	永兴股份	2024 年 1 月 11 日	6 个月	锁定期	16.20	15.96	680	11,016.00	10,852.80	-
603082	北自科技	2024 年 1 月 23 日	6 个月	锁定期	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	1 个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	1,287	24,002.55	24,002.55	-
603312	西典新能	2024 年 1 月 4 日	6 个月	锁定期	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024 年 1 月 3 日	6 个月	锁定期	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	1 个月内(含)	新股未上市	20.56	20.56	1,051	21,608.56	21,608.56	-
603381	永臻	2024 年 6 月	6 个月	锁定期	23.35	25.13	158	3,689.30	3,970.54	-

	股份	月 19 日								
688530	欧莱新材	2024 年 4 月 29 日	6 个月	锁定期	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688691	灿芯股份	2024 年 4 月 2 日	6 个月	锁定期	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024 年 6 月 4 日	6 个月	锁定期	86.96	174.93	130	11,304.80	22,740.90	-
688695	中创股份	2024 年 3 月 6 日	6 个月	锁定期	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600321	正源股份	2024 年 5 月 31 日	重大事项停牌	0.50	-	-	100	162.05	50.00	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括信用风险、流动性风险、市场风险等。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制

流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

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。

本基金于本报告期末及上年度末均未持有债券、资产支持证券、同业存单，因此无相关重大信用风险。

#### 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。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类：

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
货币资金	29,665,063.83	-	-	-	29,665,063.83
结算备付金	6,638,808.88	-	-	-	6,638,808.88
存出保证金	1,598,415.74	-	-	-	1,598,415.74
交易性金融资产	-	-	-	-295,604,088.58	295,604,088.58
应收申购款	-	-	-	7,026.56	7,026.56
应收清算款	-	-	-	674,193.12	674,193.12
资产总计	37,902,288.45	-	-	-296,285,308.26	334,187,596.71
负债					
应付赎回款	-	-	-	26,296.34	26,296.34
应付管理人报酬	-	-	-	337,026.18	337,026.18
应付托管费	-	-	-	56,171.03	56,171.03
应付清算款	-	-	-	36,037.18	36,037.18
应付销售服务费	-	-	-	26,641.07	26,641.07
其他负债	-	-	-	731,857.34	731,857.34
负债总计	-	-	-	1,214,029.14	1,214,029.14
利率敏感度缺口	37,902,288.45	-	-	-295,071,279.12	332,973,567.57
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	59,131,646.69	-	-	-	59,131,646.69
结算备付金	5,398,352.27	-	-	-	5,398,352.27
存出保证金	1,323,668.69	-	-	-	1,323,668.69
交易性金融资产	-	-	-	-412,127,596.82	412,127,596.82
应收申购款	-	-	-	117,374.01	117,374.01
资产总计	65,853,667.65	-	-	-412,244,970.83	478,098,638.48
负债					
应付赎回款	-	-	-	670,907.83	670,907.83
应付管理人报酬	-	-	-	466,681.36	466,681.36
应付托管费	-	-	-	77,780.22	77,780.22
应付清算款	-	-	-	19,438,167.55	19,438,167.55
应付销售服务费	-	-	-	34,611.70	34,611.70
其他负债	-	-	-	992,259.44	992,259.44
负债总计	-	-	-	21,680,408.10	21,680,408.10
利率敏感度缺口	65,853,667.65	-	-	-390,564,562.73	456,418,230.38

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 2024 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（2023 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证券，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。

于 6 月 30 日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

##### 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 2024年6月30日		上年度末 2023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	295,604,088.58	88.78	412,127,596.82	90.30
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	295,604,088.58	88.78	412,127,596.82	90.30

##### 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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升5%的影响金额	21,657,000.00	31,126,000.00
业绩比较基准下降5%的影响金额	-21,657,000.00	-31,126,000.00	

## 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	295,195,691.53	410,471,489.19
第二层次	45,661.11	-
第三层次	362,735.94	1,656,107.63
合计	295,604,088.58	412,127,596.82

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 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 (2023 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以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，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 2024 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	295,604,088.58	88.45
	其中：股票	295,604,088.58	88.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	36,303,872.71	10.86
8	其他各项资产	2,279,635.42	0.68
9	合计	334,187,596.71	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	1,062,813.00	0.32
B	采矿业	12,801,635.00	3.84
C	制造业	202,833,218.35	60.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,906,296.40	3.88
E	建筑业	4,967,289.00	1.49
F	批发和零售业	14,723,904.40	4.42
G	交通运输、仓储和邮政业	1,131,664.00	0.34
H	住宿和餐饮业	139,920.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,659,841.17	5.30
J	金融业	1,903,028.00	0.57
K	房地产业	486,279.00	0.15
L	租赁和商务服务业	4,493,830.80	1.35
M	科学研究和技术服务业	3,842,749.26	1.15
N	水利、环境和公共设施管理业	6,608,537.60	1.98
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	102,678.00	0.03
Q	卫生和社会工作	92,925.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	9,089,563.40	2.73
S	综合	757,916.20	0.23
	合计	295,604,088.58	88.78

### 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	600566	济川药业	92,000	2,917,320.00	0.88
2	600285	羚锐制药	119,300	2,888,253.00	0.87
3	300193	佳士科技	293,000	2,174,060.00	0.65
4	601127	赛力斯	23,800	2,168,656.00	0.65
5	600050	中国联通	458,300	2,154,010.00	0.65
6	000543	皖能电力	243,200	2,152,320.00	0.65
7	688226	威腾电气	119,800	2,094,104.00	0.63
8	600938	中国海油	63,200	2,085,600.00	0.63
9	688510	航亚科技	112,900	2,078,489.00	0.62
10	002027	分众传媒	342,500	2,075,550.00	0.62
11	600707	彩虹股份	303,700	2,068,197.00	0.62
12	002517	恺英网络	215,800	2,060,890.00	0.62
13	600547	山东黄金	75,000	2,053,500.00	0.62
14	605333	沪光股份	73,700	2,052,545.00	0.62
15	002159	三特索道	159,700	2,048,951.00	0.62
16	603993	洛阳钼业	239,800	2,038,300.00	0.61
17	301291	明阳电气	67,800	2,037,390.00	0.61
18	300251	光线传媒	242,000	2,035,220.00	0.61
19	603277	银都股份	67,700	2,033,708.00	0.61
20	601801	皖新传媒	293,100	2,031,183.00	0.61
21	000544	中原环保	256,100	2,015,507.00	0.61
22	300790	宇瞳光学	149,000	2,011,500.00	0.60
23	000975	银泰黄金	123,200	2,006,928.00	0.60
24	002073	软控股份	271,400	2,005,646.00	0.60
25	605196	华通线缆	190,600	2,005,112.00	0.60
26	603103	横店影视	144,600	2,001,264.00	0.60
27	002185	华天科技	245,500	2,000,825.00	0.60
28	600489	XD 中金黄	135,100	1,999,480.00	0.60
29	300679	电连技术	49,700	1,999,431.00	0.60
30	000065	北方国际	192,800	1,999,336.00	0.60
31	601500	通用股份	371,400	1,983,276.00	0.60
32	600023	浙能电力	278,800	1,982,268.00	0.60
33	002340	格林美	310,800	1,979,796.00	0.59
34	603158	腾龙股份	280,300	1,973,312.00	0.59
35	002035	华帝股份	315,400	1,964,942.00	0.59
36	300002	神州泰岳	241,900	1,964,228.00	0.59

37	603221	爱丽家居	221,300	1,962,931.00	0.59
38	002264	新华都	384,100	1,962,751.00	0.59
39	601886	江河集团	402,000	1,961,760.00	0.59
40	000050	深天马 A	269,100	1,959,048.00	0.59
41	600642	申能股份	221,500	1,955,845.00	0.59
42	300673	佩蒂股份	149,000	1,954,880.00	0.59
43	003019	宸展光电	77,070	1,952,183.10	0.59
44	603727	博迈科	147,800	1,945,048.00	0.58
45	603516	淳中科技	61,500	1,941,555.00	0.58
46	002582	好想你	360,900	1,938,033.00	0.58
47	601702	华峰铝业	105,100	1,919,126.00	0.58
48	002053	云南能投	158,000	1,910,220.00	0.57
49	688506	百利天恒	10,500	1,904,700.00	0.57
50	600095	湘财股份	319,300	1,903,028.00	0.57
51	003041	真爱美家	90,200	1,101,342.00	0.33
52	301081	严牌股份	138,900	1,041,750.00	0.31
53	600398	海澜之家	110,700	1,022,868.00	0.31
54	600210	紫江企业	191,200	1,017,184.00	0.31
55	002831	裕同科技	39,700	1,015,923.00	0.31
56	603080	新疆火炬	74,900	1,008,154.00	0.30
57	600737	中粮糖业	104,800	1,005,032.00	0.30
58	002674	兴业科技	97,700	998,494.00	0.30
59	600582	天地科技	144,600	996,294.00	0.30
60	603558	健盛集团	99,800	993,010.00	0.30
61	600916	中国黄金	102,600	987,012.00	0.30
62	002303	美盈森	409,400	986,654.00	0.30
63	603889	新澳股份	127,100	983,754.00	0.30
64	002557	洽洽食品	34,700	978,193.00	0.29
65	000858	五粮液	7,600	973,104.00	0.29
66	002833	弘亚数控	52,600	959,424.00	0.29
67	002315	焦点科技	35,400	954,384.00	0.29
68	603112	华翔股份	90,200	948,002.00	0.28
69	000568	泸州老窖	6,600	947,034.00	0.28
70	603238	诺邦股份	94,650	942,714.00	0.28
71	002345	潮宏基	199,300	940,696.00	0.28
72	300898	熊猫乳品	55,600	929,076.00	0.28
73	002991	甘源食品	15,257	925,337.05	0.28
74	600612	老凤祥	15,900	925,221.00	0.28
75	300017	网宿科技	116,300	918,770.00	0.28
76	001234	泰慕士	53,500	908,965.00	0.27
77	603508	思维列控	48,400	907,500.00	0.27
78	300403	汉宇集团	132,200	902,926.00	0.27
79	688036	传音控股	11,700	895,518.00	0.27

80	300791	仙乐健康	35,360	891,072.00	0.27
81	603726	朗迪集团	65,400	876,360.00	0.26
82	002832	比音勒芬	36,100	872,537.00	0.26
83	600694	大商股份	50,640	851,258.40	0.26
84	603027	千禾味业	63,826	848,885.80	0.25
85	603408	建霖家居	64,000	844,160.00	0.25
86	605599	菜百股份	66,000	840,180.00	0.25
87	603345	安井食品	11,200	832,272.00	0.25
88	603589	口子窖	21,200	830,828.00	0.25
89	301015	百洋医药	35,200	828,256.00	0.25
90	002003	伟星股份	65,900	827,045.00	0.25
91	000803	山高环能	233,000	813,170.00	0.24
92	000593	德龙汇能	165,400	770,764.00	0.23
93	002164	宁波东力	200,700	770,688.00	0.23
94	601339	百隆东方	141,800	738,778.00	0.22
95	300966	共同药业	44,600	728,764.00	0.22
96	002227	奥特迅	89,600	720,384.00	0.22
97	000952	广济药业	142,100	709,079.00	0.21
98	603289	泰瑞机器	78,700	702,004.00	0.21
99	002420	毅昌科技	149,900	683,544.00	0.21
100	300153	科泰电源	114,400	680,680.00	0.20
101	603701	德宏股份	62,900	665,482.00	0.20
102	002187	广百股份	160,700	663,691.00	0.20
103	603335	迪生力	161,700	662,970.00	0.20
104	600784	鲁银投资	139,800	662,652.00	0.20
105	603982	泉峰汽车	82,800	662,400.00	0.20
106	002972	科安达	72,200	661,352.00	0.20
107	300440	运达科技	125,700	659,925.00	0.20
108	001360	南矿集团	53,300	655,057.00	0.20
109	600278	东方创业	121,800	654,066.00	0.20
110	603551	奥普科技	66,600	652,680.00	0.20
111	605268	王力安防	90,500	645,265.00	0.19
112	002398	垒知集团	173,400	645,048.00	0.19
113	600829	人民同泰	114,900	644,589.00	0.19
114	300485	赛升药业	104,300	640,402.00	0.19
115	002301	齐心集团	132,500	639,975.00	0.19
116	002853	皮阿诺	85,700	636,751.00	0.19
117	603116	红蜻蜓	141,500	636,750.00	0.19
118	002658	雪迪龙	124,000	636,120.00	0.19
119	601086	国芳集团	172,300	635,787.00	0.19
120	605208	永茂泰	101,700	633,591.00	0.19
121	600620	天宸股份	148,300	633,241.00	0.19
122	002846	英联股份	92,400	631,092.00	0.19

123	605388	均瑶健康	115,120	630,857.60	0.19
124	603122	合富中国	123,600	629,124.00	0.19
125	600135	乐凯胶片	128,500	627,080.00	0.19
126	605366	宏柏新材	107,600	625,156.00	0.19
127	600526	菲达环保	168,300	624,393.00	0.19
128	002666	德联集团	171,900	622,278.00	0.19
129	603901	永创智能	87,700	621,793.00	0.19
130	300774	倍杰特	94,900	619,697.00	0.19
131	603808	歌力思	97,800	619,074.00	0.19
132	002566	益盛药业	101,100	618,732.00	0.19
133	600796	钱江生化	141,200	615,632.00	0.18
134	600851	海欣股份	133,700	611,009.00	0.18
135	000973	佛塑科技	165,400	610,326.00	0.18
136	000419	通程控股	148,500	607,365.00	0.18
137	002686	亿利达	144,500	605,455.00	0.18
138	002333	罗普斯金	112,700	605,199.00	0.18
139	600636	国新文化	80,200	601,500.00	0.18
140	002082	万邦德	142,800	601,188.00	0.18
141	002631	德尔未来	166,300	595,354.00	0.18
142	603028	赛福天	105,300	592,839.00	0.18
143	002571	德力股份	121,400	591,218.00	0.18
144	688373	盟科药业	135,900	591,165.00	0.18
145	002787	华源控股	87,300	590,148.00	0.18
146	300615	欣天科技	60,800	581,856.00	0.17
147	000931	中关村	163,000	575,390.00	0.17
148	603106	恒银科技	134,900	574,674.00	0.17
149	603378	亚士创能	113,400	573,804.00	0.17
150	001313	粤海饲料	76,200	573,024.00	0.17
151	300211	亿通科技	108,100	571,849.00	0.17
152	603070	万控智造	51,000	570,690.00	0.17
153	301256	华融化学	92,800	569,792.00	0.17
154	000633	合金投资	144,600	569,724.00	0.17
155	002238	天威视讯	72,400	568,340.00	0.17
156	603330	天洋新材	118,000	565,220.00	0.17
157	601566	九牧王	67,100	564,982.00	0.17
158	002817	黄山胶囊	104,300	556,962.00	0.17
159	301149	隆华新材	58,800	543,312.00	0.16
160	600152	维科技术	113,100	542,880.00	0.16
161	600613	神奇制药	101,000	540,350.00	0.16
162	600191	华资实业	111,800	538,876.00	0.16
163	002376	新北洋	99,800	537,922.00	0.16
164	002863	今飞凯达	130,300	530,321.00	0.16
165	603697	有友食品	91,400	530,120.00	0.16

166	603861	白云电器	63,100	528,147.00	0.16
167	000524	岭南控股	65,100	524,706.00	0.16
168	300805	电声股份	81,500	518,340.00	0.16
169	603256	宏和科技	73,400	518,204.00	0.16
170	603339	四方科技	57,100	517,897.00	0.16
171	300279	和晶科技	123,800	516,246.00	0.16
172	601956	东贝集团	112,300	514,334.00	0.15
173	002949	华阳国际	54,600	513,786.00	0.15
174	600429	三元股份	137,600	513,248.00	0.15
175	002989	中天精装	33,700	512,577.00	0.15
176	603387	基蛋生物	66,000	512,160.00	0.15
177	603937	丽岛新材	65,700	509,832.00	0.15
178	002573	清新环境	131,700	509,679.00	0.15
179	002905	金逸影视	82,100	509,020.00	0.15
180	603815	交建股份	88,400	505,648.00	0.15
181	301198	喜悦智行	63,000	504,630.00	0.15
182	000635	英力特	86,000	503,100.00	0.15
183	605188	国光连锁	64,800	502,200.00	0.15
184	605179	一鸣食品	55,000	502,150.00	0.15
185	600292	远达环保	106,800	500,892.00	0.15
186	301365	矩阵股份	45,574	500,858.26	0.15
187	002694	顾地科技	129,500	498,575.00	0.15
188	301277	新天地	38,400	498,432.00	0.15
189	603232	格尔软件	47,700	497,034.00	0.15
190	002873	新天药业	59,800	496,340.00	0.15
191	300326	凯利泰	130,247	494,938.60	0.15
192	603777	来伊份	52,700	493,799.00	0.15
193	300967	晓鸣股份	54,400	493,408.00	0.15
194	300246	宝莱特	81,350	492,167.50	0.15
195	688165	埃夫特	62,854	491,518.28	0.15
196	002062	宏润建设	140,600	489,288.00	0.15
197	002795	永和智控	131,000	487,320.00	0.15
198	600249	两面针	132,700	487,009.00	0.15
199	603739	蔚蓝生物	37,600	485,792.00	0.15
200	300649	杭州园林	46,400	483,952.00	0.15
201	688319	欧林生物	54,000	483,300.00	0.15
202	002136	安纳达	53,300	482,898.00	0.15
203	002909	集泰股份	116,200	476,420.00	0.14
204	603916	苏博特	70,700	474,397.00	0.14
205	002290	禾盛新材	35,600	474,192.00	0.14
206	301355	南王科技	49,200	471,828.00	0.14
207	003016	欣贺股份	74,700	467,622.00	0.14
208	603359	东珠生态	128,600	466,818.00	0.14

209	603917	合力科技	41,200	445,784.00	0.13
210	002492	恒基达鑫	96,000	441,600.00	0.13
211	002735	王子新材	44,900	441,367.00	0.13
212	605299	舒华体育	53,700	436,044.00	0.13
213	001217	华尔泰	46,500	425,475.00	0.13
214	603065	宿迁联盛	56,400	421,308.00	0.13
215	301439	泓淋电力	33,200	420,644.00	0.13
216	002695	煌上煌	64,800	420,552.00	0.13
217	300962	中金辐照	30,500	416,020.00	0.12
218	300945	曼卡龙	46,500	414,315.00	0.12
219	002454	松芝股份	74,100	414,219.00	0.12
220	300943	春晖智控	38,300	413,257.00	0.12
221	300654	世纪天鸿	48,300	410,550.00	0.12
222	300120	经纬辉开	78,900	409,491.00	0.12
223	301058	中粮科工	42,400	401,528.00	0.12
224	300248	新开普	61,600	399,784.00	0.12
225	300447	全信股份	32,100	397,398.00	0.12
226	002404	嘉欣丝绸	74,600	394,634.00	0.12
227	300625	三雄极光	37,600	394,424.00	0.12
228	603081	大丰实业	42,200	393,304.00	0.12
229	600405	动力源	108,900	393,129.00	0.12
230	002634	棒杰股份	109,500	393,105.00	0.12
231	600738	丽尚国潮	107,100	393,057.00	0.12
232	002644	佛慈制药	61,100	392,262.00	0.12
233	300771	智莱科技	44,600	392,034.00	0.12
234	300824	北鼎股份	53,800	390,050.00	0.12
235	603032	德新科技	34,100	389,763.00	0.12
236	002367	康力电梯	67,500	389,475.00	0.12
237	600819	耀皮玻璃	92,200	389,084.00	0.12
238	002282	博深股份	60,800	388,512.00	0.12
239	000779	甘咨询	55,400	388,354.00	0.12
240	002956	西麦食品	28,200	387,468.00	0.12
241	601999	出版传媒	74,200	387,324.00	0.12
242	300664	鹏鹞环保	86,700	385,815.00	0.12
243	603006	联明股份	39,600	385,308.00	0.12
244	300424	航新科技	31,500	385,245.00	0.12
245	300978	东箭科技	41,600	383,968.00	0.12
246	002235	安妮股份	96,600	382,536.00	0.11
247	002825	纳尔股份	61,400	382,522.00	0.11
248	603578	三星新材	31,600	382,360.00	0.11
249	002029	七匹狼	75,600	381,024.00	0.11
250	002538	司尔特	85,000	380,800.00	0.11
251	603999	读者传媒	80,400	380,292.00	0.11

252	002529	海源复材	72,300	373,068.00	0.11
253	605300	佳禾食品	34,100	373,054.00	0.11
254	000045	深纺织 A	46,500	372,930.00	0.11
255	002769	普路通	71,100	371,853.00	0.11
256	301500	飞南资源	21,300	371,685.00	0.11
257	300605	恒锋信息	41,000	371,460.00	0.11
258	600081	东风科技	42,200	369,250.00	0.11
259	301158	德石股份	29,800	368,626.00	0.11
260	000576	甘化科工	61,300	367,800.00	0.11
261	605228	神通科技	42,800	367,224.00	0.11
262	603101	汇嘉时代	73,900	364,327.00	0.11
263	002066	瑞泰科技	45,700	363,315.00	0.11
264	603856	东宏股份	35,600	362,408.00	0.11
265	300986	志特新材	53,200	360,164.00	0.11
266	688148	芳源股份	85,212	358,742.52	0.11
267	002360	同德化工	70,700	357,742.00	0.11
268	002474	榕基软件	81,600	355,776.00	0.11
269	301025	读客文化	35,200	351,648.00	0.11
270	000715	中兴商业	73,200	348,432.00	0.10
271	300335	迪森股份	89,900	347,913.00	0.10
272	300483	首华燃气	47,700	344,871.00	0.10
273	301388	欣灵电气	13,900	343,469.00	0.10
274	000159	国际实业	61,400	320,508.00	0.10
275	002823	凯中精密	25,200	307,440.00	0.09
276	300800	力合科技	29,400	304,584.00	0.09
277	603015	弘讯科技	38,700	292,572.00	0.09
278	603018	华设集团	31,700	288,153.00	0.09
279	002843	泰嘉股份	18,600	284,766.00	0.09
280	603676	卫信康	35,400	283,554.00	0.09
281	301197	工大科雅	21,600	283,392.00	0.09
282	300848	美瑞新材	17,100	281,124.00	0.08
283	002451	摩恩电气	52,300	280,851.00	0.08
284	002319	乐通股份	31,900	274,978.00	0.08
285	601798	蓝科高新	54,600	270,270.00	0.08
286	600476	湘邮科技	22,300	267,600.00	0.08
287	300435	中泰股份	22,400	263,648.00	0.08
288	603977	国泰集团	25,900	263,403.00	0.08
289	002734	利民股份	38,000	261,820.00	0.08
290	000788	北大医药	52,400	261,476.00	0.08
291	002381	双箭股份	38,900	261,019.00	0.08
292	300239	东宝生物	55,400	260,934.00	0.08
293	300950	德固特	17,100	260,604.00	0.08
294	002616	长青集团	60,200	260,064.00	0.08

295	603618	杭电股份	59,100	258,858.00	0.08
296	300291	百纳千成	60,700	258,582.00	0.08
297	603689	皖天然气	31,400	258,108.00	0.08
298	000026	飞亚达	29,200	257,252.00	0.08
299	002412	汉森制药	49,700	256,949.00	0.08
300	603848	好太太	20,400	256,836.00	0.08
301	000920	沃顿科技	35,000	256,550.00	0.08
302	300434	金石亚药	34,200	256,500.00	0.08
303	000534	万泽股份	25,800	256,194.00	0.08
304	300858	科拓生物	17,400	256,128.00	0.08
305	300491	通合科技	17,800	255,608.00	0.08
306	603811	诚意药业	40,800	255,000.00	0.08
307	000815	美利云	35,400	254,526.00	0.08
308	002103	广博股份	51,300	254,448.00	0.08
309	002669	康达新材	30,900	254,307.00	0.08
310	600228	返利科技	52,200	253,692.00	0.08
311	300426	唐德影视	37,300	252,894.00	0.08
312	603768	常青股份	22,300	252,882.00	0.08
313	300797	钢研纳克	27,300	252,798.00	0.08
314	300275	梅安森	25,300	252,241.00	0.08
315	000852	石化机械	46,900	251,384.00	0.08
316	002365	永安药业	34,800	251,256.00	0.08
317	300608	思特奇	27,900	250,542.00	0.08
318	002022	科华生物	44,300	250,295.00	0.08
319	301292	海科新源	20,200	249,874.00	0.08
320	300520	科大国创	15,600	248,820.00	0.07
321	601968	宝钢包装	53,100	248,508.00	0.07
322	300453	三鑫医疗	38,800	247,932.00	0.07
323	002574	明牌珠宝	59,300	247,874.00	0.07
324	000521	长虹美菱	32,700	247,866.00	0.07
325	301370	国科恒泰	22,800	247,836.00	0.07
326	603960	克来机电	11,700	246,870.00	0.07
327	301161	唯万密封	15,800	245,374.00	0.07
328	600731	湖南海利	53,100	245,322.00	0.07
329	301265	华新环保	30,300	239,673.00	0.07
330	301017	漱玉平民	24,100	237,144.00	0.07
331	000548	湖南投资	58,900	236,778.00	0.07
332	603817	海峡环保	49,700	236,572.00	0.07
333	300512	中亚股份	39,800	235,616.00	0.07
334	300539	横河精密	29,200	235,060.00	0.07
335	300448	浩云科技	56,000	234,640.00	0.07
336	002858	力盛体育	22,500	234,000.00	0.07
337	600858	银座股份	59,400	233,442.00	0.07

338	300399	天利科技	26,200	230,298.00	0.07
339	600470	六国化工	60,200	229,964.00	0.07
340	603329	上海雅仕	20,800	229,216.00	0.07
341	605567	春雪食品	29,900	229,034.00	0.07
342	600826	兰生股份	42,560	228,972.80	0.07
343	600616	金枫酒业	47,700	228,960.00	0.07
344	301227	森鹰窗业	11,700	220,077.00	0.07
345	300519	新光药业	20,100	218,085.00	0.07
346	002723	小崧股份	34,600	216,942.00	0.07
347	002760	凤形股份	13,200	174,240.00	0.05
348	301589	诺瓦星云	887	166,764.87	0.05
349	301120	新特电气	15,200	157,928.00	0.05
350	600571	信雅达	14,900	155,556.00	0.05
351	300387	富邦股份	24,800	148,552.00	0.04
352	300436	广生堂	9,300	146,103.00	0.04
353	300466	赛摩智能	23,700	145,281.00	0.04
354	002587	奥拓电子	26,600	143,108.00	0.04
355	605167	利柏特	18,000	140,580.00	0.04
356	002090	金智科技	16,200	139,968.00	0.04
357	301326	捷邦科技	4,300	139,922.00	0.04
358	601007	金陵饭店	22,000	139,920.00	0.04
359	603600	永艺股份	13,400	139,896.00	0.04
360	300830	金现代	23,000	139,840.00	0.04
361	603357	设计总院	15,200	139,688.00	0.04
362	603633	徕木股份	17,500	138,425.00	0.04
363	603890	春秋电子	15,200	137,712.00	0.04
364	300534	陇神戎发	19,400	137,352.00	0.04
365	002248	华东数控	22,900	137,171.00	0.04
366	605158	华达新材	21,200	136,316.00	0.04
367	002877	智能自控	18,400	135,976.00	0.04
368	300011	鼎汉技术	27,200	135,728.00	0.04
369	300173	福能东方	36,000	135,720.00	0.04
370	688277	天智航	17,500	135,450.00	0.04
371	600551	时代出版	19,080	135,086.40	0.04
372	603191	望变电气	9,100	134,680.00	0.04
373	000880	潍柴重机	16,800	134,232.00	0.04
374	002337	赛象科技	35,300	134,140.00	0.04
375	300439	美康生物	14,600	133,736.00	0.04
376	300441	鲍斯股份	22,400	132,832.00	0.04
377	000612	焦作万方	20,400	132,600.00	0.04
378	000421	南京公用	29,800	132,312.00	0.04
379	600962	国投中鲁	11,000	131,560.00	0.04
380	300523	辰安科技	8,700	131,283.00	0.04

381	601368	绿城水务	32,400	130,896.00	0.04
382	000919	金陵药业	20,900	130,834.00	0.04
383	300970	华绿生物	11,400	130,758.00	0.04
384	002279	久其软件	30,300	130,593.00	0.04
385	300616	尚品宅配	11,800	130,508.00	0.04
386	300249	依米康	20,100	130,248.00	0.04
387	603209	兴通股份	9,400	130,096.00	0.04
388	600560	金自天正	9,700	129,980.00	0.04
389	300286	安科瑞	6,000	129,840.00	0.04
390	603222	济民医疗	23,600	129,800.00	0.04
391	300219	鸿利智汇	23,200	129,688.00	0.04
392	000701	厦门信达	34,600	129,404.00	0.04
393	002394	联发股份	21,000	129,360.00	0.04
394	002521	齐峰新材	11,000	129,250.00	0.04
395	300603	立昂技术	18,700	129,217.00	0.04
396	605580	恒盛能源	14,500	129,195.00	0.04
397	603788	宁波高发	10,500	128,940.00	0.04
398	603706	东方环宇	8,800	128,920.00	0.04
399	605337	李子园	13,100	128,642.00	0.04
400	000505	京粮控股	23,600	128,384.00	0.04
401	000798	中水渔业	22,800	128,364.00	0.04
402	600215	派斯林	18,000	128,340.00	0.04
403	600860	京城股份	15,900	128,313.00	0.04
404	603698	航天工程	10,700	128,079.00	0.04
405	600814	杭州解百	21,700	128,030.00	0.04
406	601116	三江购物	16,800	127,848.00	0.04
407	600367	红星发展	12,900	127,839.00	0.04
408	002515	金字火腿	33,700	127,723.00	0.04
409	300471	厚普股份	16,200	127,656.00	0.04
410	003013	地铁设计	9,000	127,620.00	0.04
411	603615	茶花股份	12,100	127,413.00	0.04
412	002057	中钢天源	18,200	127,400.00	0.04
413	300048	合康新能	27,500	127,325.00	0.04
414	300938	信测标准	6,400	127,232.00	0.04
415	600619	海立股份	24,600	127,182.00	0.04
416	600336	澳柯玛	29,700	127,116.00	0.04
417	300586	美联新材	20,200	127,058.00	0.04
418	605199	葫芦娃	13,000	126,750.00	0.04
419	600724	宁波富达	34,900	126,687.00	0.04
420	002116	中国海诚	13,600	126,616.00	0.04
421	300580	贝斯特	8,600	126,420.00	0.04
422	300299	富春股份	36,400	126,308.00	0.04
423	300712	永福股份	5,800	126,150.00	0.04

424	601177	杭齿前进	18,200	125,944.00	0.04
425	301112	信邦智能	5,800	125,802.00	0.04
426	600184	光电股份	14,700	125,097.00	0.04
427	002481	双塔食品	32,300	125,001.00	0.04
428	000655	金岭矿业	22,600	124,978.00	0.04
429	000833	粤桂股份	26,640	124,675.20	0.04
430	002246	北化股份	14,800	124,468.00	0.04
431	300505	川金诺	10,200	124,338.00	0.04
432	605050	福然德	14,100	124,221.00	0.04
433	300918	南山智尚	13,000	124,020.00	0.04
434	603836	海程邦达	9,200	123,924.00	0.04
435	002386	天原股份	32,400	123,768.00	0.04
436	300565	科信技术	12,300	123,615.00	0.04
437	300733	西菱动力	12,400	123,504.00	0.04
438	603085	天成自控	13,800	123,372.00	0.04
439	600727	鲁北化工	19,500	122,850.00	0.04
440	001300	三柏硕	10,800	122,796.00	0.04
441	301111	粤万年青	8,800	122,760.00	0.04
442	002641	公元股份	31,200	122,616.00	0.04
443	600769	祥龙电业	19,400	122,026.00	0.04
444	002731	萃华珠宝	14,500	121,655.00	0.04
445	301332	德尔玛	13,700	121,108.00	0.04
446	301303	真兰仪表	10,500	120,960.00	0.04
447	002169	智光电气	27,400	120,834.00	0.04
448	300766	每日互动	12,200	120,658.00	0.04
449	300730	科创信息	11,600	120,524.00	0.04
450	603291	联合水务	9,800	120,148.00	0.04
451	600617	国新能源	47,740	119,350.00	0.04
452	301125	腾亚精工	12,040	119,075.60	0.04
453	603630	拉芳家化	11,300	118,763.00	0.04
454	301226	祥明智能	7,100	118,144.00	0.04
455	002838	道恩股份	13,000	117,780.00	0.04
456	300907	康平科技	6,200	117,738.00	0.04
457	301053	远信工业	5,800	115,768.00	0.03
458	603458	勘设股份	20,400	115,260.00	0.03
459	002887	绿茵生态	17,700	115,227.00	0.03
460	605005	合兴股份	7,200	114,912.00	0.03
461	300840	酷特智能	12,400	114,700.00	0.03
462	688247	宣泰医药	13,800	113,436.00	0.03
463	001210	金房能源	8,520	113,060.40	0.03
464	301390	经纬股份	3,400	112,676.00	0.03
465	300789	唐源电气	8,500	112,540.00	0.03
466	605003	众望布艺	7,000	112,350.00	0.03

467	300865	大宏立	7,000	112,280.00	0.03
468	688616	西力科技	9,900	112,266.00	0.03
469	301057	汇隆新材	9,800	112,112.00	0.03
470	605287	德才股份	8,900	112,051.00	0.03
471	301287	康力源	4,200	111,930.00	0.03
472	301118	恒光股份	7,500	111,825.00	0.03
473	300588	熙菱信息	14,400	111,456.00	0.03
474	300851	交大思诺	4,800	110,976.00	0.03
475	300932	三友联众	11,500	110,745.00	0.03
476	300780	德恩精工	8,200	110,618.00	0.03
477	300235	方直科技	13,750	110,275.00	0.03
478	300553	集智股份	4,500	110,205.00	0.03
479	300717	华信新材	6,400	110,016.00	0.03
480	301448	开创电气	5,300	109,816.00	0.03
481	300112	万讯自控	15,900	109,710.00	0.03
482	301298	东利机械	8,600	109,650.00	0.03
483	600097	开创国际	13,300	109,459.00	0.03
484	688607	康众医疗	8,800	109,296.00	0.03
485	603311	金海高科	12,800	109,056.00	0.03
486	301007	德迈仕	9,300	108,624.00	0.03
487	688466	金科环境	9,100	108,472.00	0.03
488	002652	扬子新材	40,900	108,385.00	0.03
489	300234	开尔新材	27,300	108,381.00	0.03
490	301167	建研设计	9,300	108,252.00	0.03
491	688613	奥精医疗	8,500	108,205.00	0.03
492	603331	百达精工	11,900	107,933.00	0.03
493	001209	洪兴股份	7,800	107,640.00	0.03
494	688455	科捷智能	13,400	107,602.00	0.03
495	688669	聚石化学	9,500	107,540.00	0.03
496	001230	劲旅环境	7,720	107,230.80	0.03
497	603137	恒尚节能	10,500	107,100.00	0.03
498	001255	博菲电气	4,900	107,016.00	0.03
499	301192	泰祥股份	6,200	107,012.00	0.03
500	300743	天地数码	7,900	106,966.00	0.03
501	003023	彩虹集团	6,700	106,865.00	0.03
502	300549	优德精密	7,900	106,808.00	0.03
503	300920	润阳科技	7,100	106,784.00	0.03
504	600444	国机通用	8,800	106,568.00	0.03
505	603656	泰禾智能	9,800	106,428.00	0.03
506	301006	迈拓股份	9,100	106,379.00	0.03
507	301002	崧盛股份	6,300	106,281.00	0.03
508	603988	中电电机	13,600	106,216.00	0.03
509	301234	五洲医疗	4,900	106,085.00	0.03

510	688011	新光光电	7,000	106,050.00	0.03
511	002998	优彩资源	18,700	106,029.00	0.03
512	600356	恒丰纸业	17,900	105,968.00	0.03
513	300837	浙矿股份	5,100	105,876.00	0.03
514	301163	宏德股份	5,200	105,664.00	0.03
515	300828	锐新科技	8,900	105,643.00	0.03
516	603029	天鹅股份	7,600	105,564.00	0.03
517	688171	纬德信息	7,000	105,560.00	0.03
518	002576	通达动力	9,300	105,555.00	0.03
519	300694	蠡湖股份	12,400	105,524.00	0.03
520	300823	建科智能	8,680	105,462.00	0.03
521	688395	正弦电气	7,400	105,450.00	0.03
522	300562	乐心医疗	11,800	105,138.00	0.03
522	603286	日盈电子	6,600	105,138.00	0.03
523	301209	联合化学	4,800	105,120.00	0.03
524	300692	中环环保	22,700	105,101.00	0.03
525	301043	绿岛风	4,400	105,028.00	0.03
526	603041	美思德	10,500	105,000.00	0.03
527	603683	晶华新材	13,200	104,808.00	0.03
528	002347	泰尔股份	27,800	104,806.00	0.03
529	300022	吉峰科技	29,500	104,725.00	0.03
530	603926	铁流股份	12,600	104,580.00	0.03
531	688511	天微电子	4,800	104,496.00	0.03
532	603903	中持股份	14,900	104,449.00	0.03
533	002883	中设股份	11,800	104,430.00	0.03
534	603079	圣达生物	10,400	104,416.00	0.03
535	605155	西大门	11,400	104,310.00	0.03
536	300984	金沃股份	4,700	104,293.00	0.03
537	300703	创源股份	12,900	104,232.00	0.03
538	603333	尚纬股份	33,500	104,185.00	0.03
539	603682	锦和商管	26,100	104,139.00	0.03
540	301119	正强股份	5,500	104,060.00	0.03
541	002899	英派斯	7,900	104,043.00	0.03
542	301001	凯淳股份	5,900	104,017.00	0.03
543	688013	天臣医疗	7,000	103,880.00	0.03
544	300371	汇中股份	12,400	103,788.00	0.03
545	000605	渤海股份	22,400	103,712.00	0.03
546	688203	海正生材	12,200	103,700.00	0.03
547	603790	雅运股份	10,800	103,680.00	0.03
548	603089	正裕工业	12,400	103,664.00	0.03
549	300515	三德科技	10,500	103,635.00	0.03
550	300610	晨化股份	11,800	103,486.00	0.03
551	300509	新美星	22,100	103,428.00	0.03

551	301113	雅艺科技	5,200	103,428.00	0.03
552	301059	金三江	11,600	103,356.00	0.03
553	301065	本立科技	6,500	103,350.00	0.03
554	300826	测绘股份	7,900	103,332.00	0.03
555	000985	大庆华科	8,200	103,320.00	0.03
556	300281	金明精机	22,900	103,279.00	0.03
557	300897	山科智能	5,600	103,264.00	0.03
558	603700	宁水集团	11,000	103,180.00	0.03
559	002921	联诚精密	10,300	103,103.00	0.03
560	002826	易明医药	13,000	103,090.00	0.03
561	600969	郴电国际	18,800	103,024.00	0.03
562	002209	达意隆	13,500	103,005.00	0.03
563	603958	哈森股份	12,600	102,942.00	0.03
564	301107	瑜欣电子	4,100	102,910.00	0.03
565	688285	高铁电气	16,000	102,880.00	0.03
566	603536	惠发食品	13,000	102,830.00	0.03
567	301056	森赫股份	13,400	102,778.00	0.03
568	600778	友好集团	26,400	102,696.00	0.03
569	002659	凯文教育	31,400	102,678.00	0.03
570	603073	彩蝶实业	7,100	102,666.00	0.03
571	300922	天秦装备	7,900	102,621.00	0.03
572	600192	长城电工	22,400	102,592.00	0.03
573	002682	龙洲股份	28,800	102,528.00	0.03
574	001225	和泰机电	3,700	102,527.00	0.03
575	301052	果麦文化	5,000	102,500.00	0.03
576	002828	贝肯能源	12,000	102,480.00	0.03
576	603637	镇海股份	16,800	102,480.00	0.03
577	300321	同大股份	5,500	102,465.00	0.03
578	300980	祥源新材	6,500	102,440.00	0.03
579	301010	晶雪节能	8,900	102,439.00	0.03
580	003017	大洋生物	6,300	102,438.00	0.03
581	603102	百合股份	3,400	102,374.00	0.03
582	603506	南都物业	12,200	102,236.00	0.03
583	688113	联测科技	3,600	102,132.00	0.03
584	600235	民丰特纸	22,200	102,120.00	0.03
585	001211	双枪科技	6,700	102,108.00	0.03
586	002357	富临运业	19,900	102,087.00	0.03
587	600137	浪莎股份	8,600	102,082.00	0.03
588	603159	上海亚虹	9,800	102,018.00	0.03
589	688355	明志科技	7,600	101,992.00	0.03
590	300675	建科院	9,100	101,920.00	0.03
591	000678	襄阳轴承	27,100	101,896.00	0.03
592	605033	美邦股份	8,200	101,844.00	0.03

593	301063	海锅股份	7,100	101,814.00	0.03
594	300838	浙江力诺	9,900	101,772.00	0.03
595	600051	宁波联合	19,300	101,711.00	0.03
596	688291	金橙子	5,900	101,598.00	0.03
597	300126	锐奇股份	22,400	101,472.00	0.03
598	603176	汇通集团	27,200	101,456.00	0.03
599	300106	西部牧业	16,900	101,400.00	0.03
600	300254	仟源医药	12,900	101,394.00	0.03
601	688077	大地熊	6,400	101,312.00	0.03
602	301008	宏昌科技	5,800	101,268.00	0.03
603	603177	德创环保	14,400	101,232.00	0.03
604	600099	林海股份	14,700	101,136.00	0.03
605	688345	博力威	5,984	101,069.76	0.03
606	600371	万向德农	14,600	101,032.00	0.03
607	688386	泛亚微透	3,600	101,016.00	0.03
608	605255	天普股份	8,400	100,968.00	0.03
609	002796	世嘉科技	12,700	100,965.00	0.03
610	300892	品渥食品	7,400	100,936.00	0.03
611	300155	安居宝	28,900	100,861.00	0.03
612	603183	建研院	31,400	100,794.00	0.03
613	600423	柳化股份	43,600	100,716.00	0.03
614	688026	洁特生物	10,100	100,596.00	0.03
615	300611	美力科技	13,200	100,584.00	0.03
616	605055	迎丰股份	24,700	100,529.00	0.03
617	603585	苏利股份	10,300	100,528.00	0.03
618	002188	中天服务	23,000	100,510.00	0.03
619	600697	欧亚集团	10,000	100,500.00	0.03
620	300164	通源石油	28,700	100,450.00	0.03
621	603320	迪贝电气	7,100	100,394.00	0.03
622	301336	趣睡科技	3,400	100,368.00	0.03
623	002133	广宇集团	45,000	100,350.00	0.03
624	603822	嘉澳环保	5,300	100,223.00	0.03
625	000619	海螺新材	24,800	100,192.00	0.03
626	002671	龙泉股份	27,900	100,161.00	0.03
627	300710	万隆光电	6,600	100,122.00	0.03
628	605122	四方新材	10,300	100,116.00	0.03
629	301335	天元宠物	6,300	100,107.00	0.03
630	300642	透景生命	8,600	100,104.00	0.03
631	300074	华平股份	30,600	100,062.00	0.03
632	301105	鸿铭股份	4,000	99,960.00	0.03
633	603182	嘉华股份	9,500	99,940.00	0.03
634	688216	气派科技	5,600	99,904.00	0.03
635	001366	播恩集团	9,000	99,900.00	0.03

636	001231	农心科技	7,100	99,897.00	0.03
637	002693	双成药业	22,700	99,880.00	0.03
638	002679	福建金森	14,400	99,792.00	0.03
639	688655	迅捷兴	9,500	99,750.00	0.03
640	000856	冀东装备	16,400	99,712.00	0.03
641	000586	汇源通信	12,700	99,695.00	0.03
642	003033	征和工业	4,300	99,631.00	0.03
643	002105	信隆健康	24,300	99,630.00	0.03
644	003042	中农联合	8,500	99,535.00	0.03
645	002715	登云股份	8,400	99,456.00	0.03
646	603709	中源家居	8,000	99,440.00	0.03
647	300992	泰福泵业	6,300	99,414.00	0.03
648	603192	汇得科技	7,400	99,382.00	0.03
649	603214	爱婴室	8,800	99,352.00	0.03
650	003011	海象新材	7,400	99,234.00	0.03
651	002963	豪尔赛	9,700	99,231.00	0.03
652	001259	利仁科技	4,600	99,222.00	0.03
653	300871	回盛生物	10,400	99,216.00	0.03
654	603839	安正时尚	22,700	99,199.00	0.03
655	003030	祖名股份	6,900	99,153.00	0.03
656	301148	嘉戎技术	5,600	99,120.00	0.03
657	002890	弘宇股份	12,350	99,047.00	0.03
658	603818	曲美家居	35,500	99,045.00	0.03
659	002820	桂发祥	13,400	99,026.00	0.03
660	300584	海辰药业	6,500	98,995.00	0.03
661	605069	正和生态	16,100	98,854.00	0.03
662	603332	苏州龙杰	13,400	98,758.00	0.03
663	603725	天安新材	15,900	98,739.00	0.03
664	603059	倍加洁	5,000	98,700.00	0.03
665	300931	通用电梯	18,000	98,640.00	0.03
666	301300	远翔新材	4,500	98,595.00	0.03
667	002802	洪汇新材	11,100	98,568.00	0.03
668	300845	捷安高科	9,100	98,553.00	0.03
669	300927	江天化学	7,200	98,424.00	0.03
670	688098	申联生物	23,600	98,412.00	0.03
671	002830	名雕股份	10,000	98,400.00	0.03
672	300813	泰林生物	5,800	98,310.00	0.03
673	002809	红墙股份	13,700	98,229.00	0.03
674	688092	爱科科技	4,600	98,210.00	0.03
675	300883	龙利得	23,200	98,136.00	0.03
676	301037	保立佳	11,060	97,991.60	0.03
677	002114	罗平锌电	23,000	97,980.00	0.03
678	300960	通业科技	6,500	97,955.00	0.03

679	300876	蒙泰高新	5,700	97,926.00	0.03
680	301429	森泰股份	6,400	97,920.00	0.03
681	603928	兴业股份	12,500	97,875.00	0.03
682	002942	新农股份	8,300	97,857.00	0.03
683	002743	富煌钢构	26,500	97,785.00	0.03
684	688314	康拓医疗	5,193	97,732.26	0.03
685	300955	嘉亨家化	7,700	97,559.00	0.03
686	002780	三夫户外	10,800	97,524.00	0.03
687	605566	福莱茵特	6,400	97,472.00	0.03
688	002295	精艺股份	18,300	97,356.00	0.03
689	300746	汉嘉设计	15,500	97,340.00	0.03
690	603968	醋化股份	9,800	97,216.00	0.03
691	300819	聚杰微纤	8,400	97,188.00	0.03
692	003027	同兴环保	7,900	97,170.00	0.03
693	600149	廊坊发展	30,100	96,922.00	0.03
694	002800	天顺股份	6,700	96,882.00	0.03
695	002910	庄园牧场	15,600	96,720.00	0.03
696	603685	晨丰科技	8,400	96,432.00	0.03
697	300564	筑博设计	11,300	96,389.00	0.03
698	688656	浩欧博	4,200	96,306.00	0.03
699	688600	皖仪科技	7,200	96,264.00	0.03
700	600624	复旦复华	32,400	96,228.00	0.03
701	002691	冀凯股份	21,900	96,141.00	0.03
702	002718	友邦吊顶	9,200	96,048.00	0.03
703	605180	华生科技	8,100	95,985.00	0.03
704	605189	富春染织	9,000	95,940.00	0.03
705	600689	上海三毛	14,200	95,850.00	0.03
706	300689	澄天伟业	6,700	95,810.00	0.03
707	688501	青达环保	7,000	95,760.00	0.03
708	300640	德艺文创	24,300	95,742.00	0.03
709	600857	宁波中百	16,900	95,485.00	0.03
710	600831	ST广网	35,600	95,408.00	0.03
711	300658	延江股份	22,600	95,372.00	0.03
712	300906	日月明	4,600	95,358.00	0.03
713	002767	先锋电子	7,900	95,195.00	0.03
714	603616	韩建河山	32,200	94,990.00	0.03
715	002494	华斯股份	30,400	94,848.00	0.03
716	603810	丰山集团	11,300	94,468.00	0.03
717	300247	融捷健康	38,800	94,284.00	0.03
718	300030	阳普医疗	25,300	94,116.00	0.03
719	002084	海鸥住工	38,400	94,080.00	0.03
720	002591	恒大高新	25,600	93,696.00	0.03
721	002696	百洋股份	23,700	93,615.00	0.03

722	600156	华升股份	30,100	93,611.00	0.03
723	002862	实丰文化	6,900	93,288.00	0.03
724	002524	光正眼科	29,500	92,925.00	0.03
725	301156	美农生物	7,600	92,872.00	0.03
726	600791	京能置业	29,100	92,829.00	0.03
727	001218	丽臣实业	6,200	92,814.00	0.03
728	003008	开普检测	5,700	92,739.00	0.03
729	300385	雪浪环境	27,400	92,338.00	0.03
730	603908	牧高笛	4,560	91,473.60	0.03
731	600665	天地源	40,700	90,354.00	0.03
732	300749	顶固集创	17,000	90,100.00	0.03
733	603090	宏盛股份	5,000	89,100.00	0.03
734	000702	正虹科技	20,700	87,975.00	0.03
735	300591	万里马	28,100	87,672.00	0.03
736	002871	伟隆股份	10,800	86,400.00	0.03
737	002370	亚太药业	33,900	84,411.00	0.03
738	300622	博士眼镜	6,600	80,322.00	0.02
739	301012	扬电科技	3,200	79,232.00	0.02
740	603860	中公高科	2,400	69,600.00	0.02
741	000906	浙商中拓	9,300	62,682.00	0.02
742	603136	天目湖	5,100	55,743.00	0.02
743	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.01
744	688692	达梦数据	130	22,740.90	0.01
745	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
746	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
747	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
748	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
749	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
750	601033	永兴股份	680	10,852.80	0.00
751	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
752	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
753	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
754	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
755	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
756	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
757	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
758	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
759	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
760	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
761	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
762	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
763	603381	永臻股份	158	3,970.54	0.00
764	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00

765	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
766	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
767	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
768	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
769	600321	正源股份	100	50.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000403	派林生物	6,832,691.00	1.50
2	300192	科德教育	6,675,696.00	1.46
3	600057	厦门象屿	5,998,741.00	1.31
4	600582	天地科技	5,788,115.00	1.27
5	600489	XD 中金黄	5,697,708.05	1.25
6	002264	新华都	5,695,928.04	1.25
7	300001	特锐德	5,514,249.00	1.21
8	603993	洛阳钼业	5,298,554.00	1.16
9	600312	平高电气	5,001,940.00	1.10
10	603551	奥普科技	4,848,775.00	1.06
11	603221	爱丽家居	4,756,140.00	1.04
12	601108	财通证券	4,743,836.00	1.04
13	000997	新大陆	4,729,537.00	1.04
14	600642	申能股份	4,667,731.00	1.02
15	600050	中国联通	4,658,648.50	1.02
16	002371	北方华创	4,577,564.00	1.00
17	300679	电连技术	4,523,103.50	0.99
18	301339	通行宝	4,377,919.00	0.96
19	600023	浙能电力	4,370,833.00	0.96
20	000921	海信家电	4,363,752.00	0.96

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

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000403	派林生物	7,142,865.00	1.56
2	300192	科德教育	6,889,891.00	1.51
3	600312	平高电气	6,373,743.00	1.40
4	600057	厦门象屿	6,237,726.00	1.37
5	000921	海信家电	6,177,636.00	1.35

6	300001	特锐德	5,959,272.00	1.31
7	600066	宇通客车	5,213,317.00	1.14
8	002001	新和成	5,190,299.00	1.14
9	601019	山东出版	4,815,062.00	1.05
10	601108	财通证券	4,801,904.00	1.05
11	600582	天地科技	4,777,324.00	1.05
12	000997	新大陆	4,774,090.00	1.05
13	603556	海兴电力	4,727,992.80	1.04
14	603551	奥普科技	4,566,049.00	1.00
15	002371	北方华创	4,531,780.00	0.99
16	300394	天孚通信	4,469,270.74	0.98
17	601857	中国石油	4,417,861.00	0.97
18	301339	通行宝	4,380,588.00	0.96
19	600461	洪城环境	4,315,067.80	0.95
20	601163	三角轮胎	4,270,418.00	0.94

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	1,814,882,051.69
卖出股票收入（成交）总额	1,859,383,079.03

注：本表“买入股票成本（成交）总额”，“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金于本报告期末未持有权证。

#### 7.10 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	1,598,415.74
2	应收清算款	674,193.12
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,026.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,279,635.42

### 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 (%)
西部利得量化优选一年持有期混合 A	9,847	31,112.25	4,313,622.19	1.41	302,048,672.43	98.59
西部利得量化优选一年持有期混合 C	730	133,000.27	0.00	0.00	97,090,196.14	100.00
合计	10,521	38,347.35	4,313,622.19	1.07	399,138,868.57	98.93

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	西部利得量化优选一年持有期混合 A	4,697,802.10	1.5334
	西部利得量化优选一年持有期混合 C	40,267.70	0.0415
	合计	4,738,069.80	1.1744

### 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	西部利得量化优选一年持有期混合 A	50~100
	西部利得量化优选一年持有期混合 C	-
	合计	50~100

本基金基金经理持有 本开放式基金	西部利得量化优选一年持有期混合 A	>100
	西部利得量化优选一年持有期混合 C	-
	合计	>100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	西部利得量化优选一年持有期混合 A	西部利得量化优选一年持有期混合 C
基金合同生效日 (2021 年 1 月 19 日) 基金份额总额	266,149,101.37	136,518,311.93
本报告期期初基金份额总额	356,862,660.98	103,808,473.63
本报告期基金总申购份额	2,469,329.13	161,233.32
减：本报告期基金总赎回份额	52,969,695.49	6,879,510.81
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	306,362,294.62	97,090,196.14

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

本报告期内本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 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，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中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 (%)	
浙商证券	2	1,972,241,526.16	53.70	511,397.56	31.96	-
财通证券	2	566,557,322.96	15.43	422,600.10	26.41	-
银河证券	2	522,854,636.04	14.24	234,429.26	14.65	-
东海证券	2	356,401,124.61	9.70	265,838.15	16.61	-
中泰证券	2	254,859,757.37	6.94	165,863.30	10.37	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富	2	-	-	-	-	-

注：1. 基金租用席位的选择标准是：(1) 资历雄厚，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 (%)
浙商证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

## 10.8 其他重大事件

报告期内本基金未发生其他重大事件。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

2024 年 8 月 29 日