

西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金

2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：西部利得基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51
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	52

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	52
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	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
§ 8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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	54
§ 9 开放式基金份额变动	54
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
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	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§ 12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金	
基金简称	西部利得沪深 300 指数	
基金主代码	673100	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 12 月 27 日	
基金管理人	西部利得基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	318,928,560.39 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	西部利得沪深 300 指数 A	西部利得沪深 300 指数 C
下属分级基金的交易代码	673100	673101
报告期末下属分级基金的份额总额	164,087,779.28 份	154,840,781.11 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金 80%以上非现金资产投资于沪深 300 指数成分股，维持高股票仓位，风格偏蓝筹，在有效复制标的指数、控制投资组合与业绩比较基准跟踪误差的基础上，兼顾安全边际以及业绩的成长性，力争获得超越业绩比较基准的收益。（详见《基金合同》）
业绩比较基准	本基金的标的指数为：沪深 300 指数。 沪深 300 指数收益率*95%+商业银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。 本基金为指数型基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		西部利得基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵毅	潘琦
	联系电话	021-38572888	0755-22168257
	电子邮箱	service@westleadfund.com	PANQI003@pingan.com.cn
客户服务电话		4007-007-818	95511-3

传真	021-50710261	0755-82080387
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区耀 体路 276 号 901 室-908 室	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 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	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座
邮政编码	200126	518001
法定代表人	何方	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网 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(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)	
	西部利得沪深 300 指数 A	西部利得沪深 300 指数 C
本期已实现收益	3,068,454.79	2,597,889.29
本期利润	-2,090,972.83	4,126,408.91
加权平均基金份 额本期利润	-0.0089	0.0191
本期加权平均净 值利润率	-0.52%	1.13%
本期基金份额净 值增长率	0.69%	0.49%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	63,665,304.04	48,920,672.10

期末可供分配基金份额利润	0.3880	0.3159
期末基金资产净值	288,592,370.04	266,003,389.87
期末基金份额净值	1.7588	1.7179
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	89.40%	81.44%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

西部利得沪深 300 指数 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	2.76%	0.52%	2.37%	0.55%	0.39%	-0.03%
过去三个月	1.73%	1.02%	1.21%	1.04%	0.52%	-0.02%
过去六个月	0.69%	0.93%	0.07%	0.97%	0.62%	-0.04%
过去一年	13.14%	1.19%	13.12%	1.32%	0.02%	-0.13%
过去三年	-5.64%	1.00%	-11.43%	1.05%	5.79%	-0.05%
自基金合同生效起至今	89.40%	1.17%	30.23%	1.16%	59.17%	0.01%

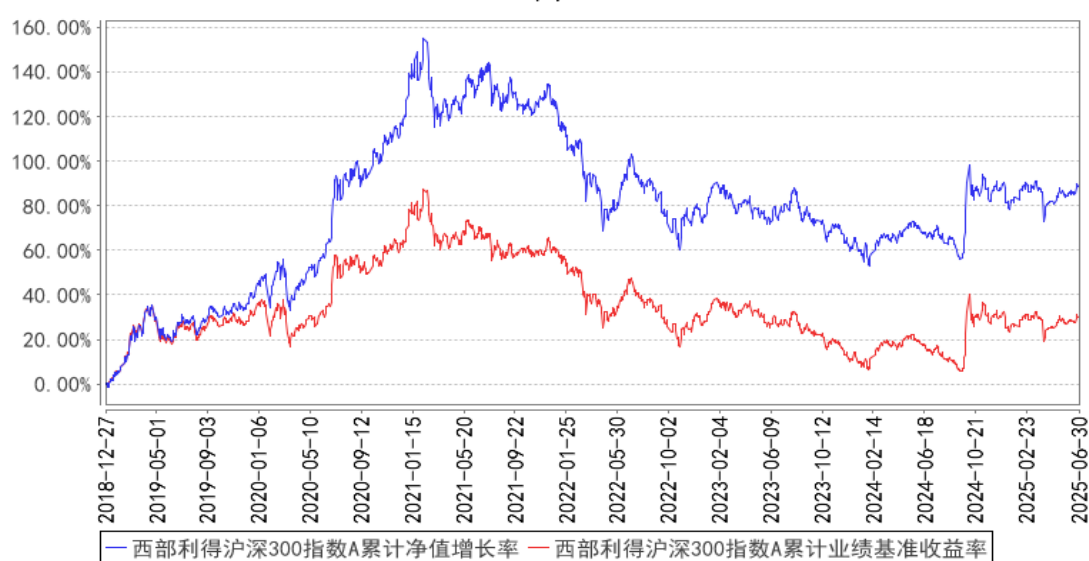
西部利得沪深 300 指数 C

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	2.72%	0.51%	2.37%	0.55%	0.35%	-0.04%
过去三个月	1.62%	1.02%	1.21%	1.04%	0.41%	-0.02%

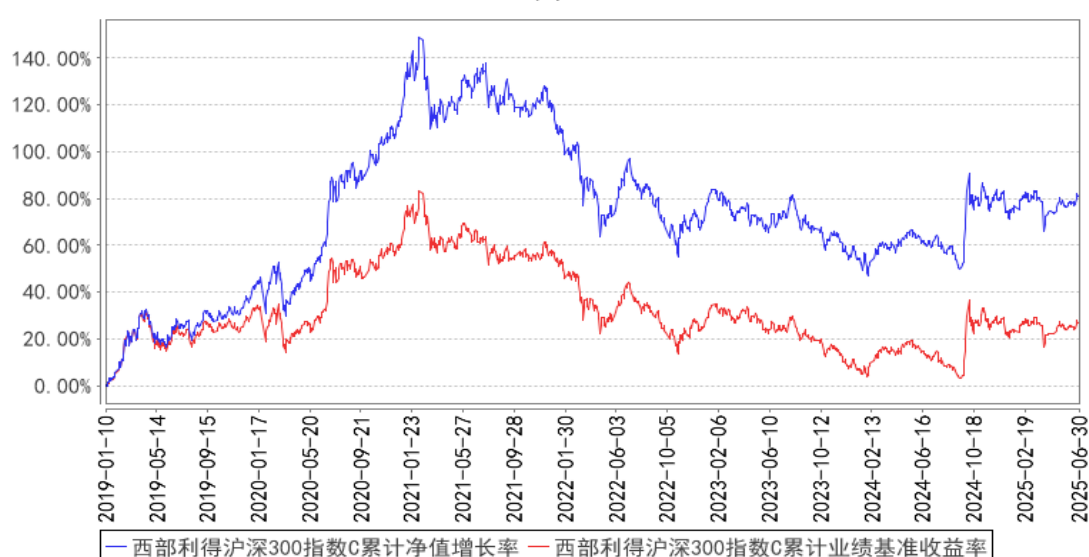
过去六个月	0.49%	0.93%	0.07%	0.97%	0.42%	-0.04%
过去一年	12.68%	1.19%	13.12%	1.32%	-0.44%	-0.13%
过去三年	-6.78%	1.00%	-11.43%	1.05%	4.65%	-0.05%
自基金合同生效 起至今	81.44%	1.18%	27.15%	1.16%	54.29%	0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

西部利得沪深300指数A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



西部利得沪深300指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金由原西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金于 2018 年 12 月 27 日转型而来，自转型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展示如图所

示。

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		
盛丰衍	总经理助理、投资总监、主动量化投资部总经理、基金经理	2018 年 12 月 27 日	—	12 年	复旦大学计算机应用技术专业硕士。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。
冯云亭	基金经理助理	2025 年 3 月 1 日	—	5 年	复旦大学金融学专业硕士。曾任上海国际集团资产管理有限公司风控助理，朱雀基金管理有限公司风控助理，汇添富基金管理股份有限公司风控助理。2023 年 10 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相关规定。

3. 西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金由西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金转型而来，转型日为 2018 年 12 月 27 日。

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参与的交易所公开竞价交易中，未发生同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 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，行业配置参考沪深 300 指数，股票持仓分散以此

弱化个股黑天鹅的影响。本基金量化策略的特点是多策略，以降低跟踪误差。本基金努力通过选股获得相对于沪深 300 指数的超额收益，以期打造优质的沪深 300 指数增强基金。

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 2025 年下半年，影响 A 股的主要有三股力量。

其一是中国时代的来临

近年来中国在新能源、国防、核能、电信设备、无人机、机器人等领域主导技术进步，在高附加值领域的优势和在供应链中的主导地位迅速提升，在 AI、动画电影、3A 游戏等领域缩短和世界顶级技术的差距。全球投资者将逐步认识到中国时代的到来，其认知的提升或将带来跨境资本的流入、地缘政治重塑以及非主权货币时代的到来。

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、民营企业部门、地方政府部门的杠杆率也大周期见顶，形成通缩压力。稳经济可能主要依赖于中央和央企部门加杠杆，对冲通缩，稳定物价。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和投放方向，我最希望看到的投放方向是投资于婴幼儿和年轻人。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很长一段时间的主旋律。被定义为高质量的行业发展提速，被定义为非高质量的行业发展相对减速。具体而言，国央企因其更符合高质量发展趋势而受益，而民企中硬科技占比高的企业受益；官方定位从低质量向高质量转变的行业因其边际变化可能有较高的股价弹性。央企股票不止是高股息资产，不少央企中小票也有较高投资价值，这部分市场未充分定价。科技股中市场认知和现实差较大的科技公司或有亮眼表现，但同时需要警惕从科技股向制造股切换时的估值换挡。

整体来看，当下看好未来权益市场表现，结构上央国企资产或走出长慢牛行情，民企热点频出百花齐放的同时伴随着高波动。风险偏好较低的投资者可以关注黄金、债券、央国企权益资产，而风险偏好较高的投资者可以在相对高波动的民企股票中寻找投资机会。

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，平安银行股份有限公司在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、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

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

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、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：西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	72,300,650.66	104,815,344.38
结算备付金		3,243,389.84	4,174,591.86
存出保证金		5,844,686.62	7,444,017.71
交易性金融资产	6.4.7.2	475,836,218.44	720,007,839.18
其中：股票投资		464,185,092.63	720,007,839.18
基金投资		-	-
债券投资		11,651,125.81	-
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		31,331.65	3,297,851.42
应收股利		-	-
应收申购款		1,283,338.02	492,748.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		558,539,615.23	840,232,393.22
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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		-	1,710,065.86
应付赎回款		2,833,633.09	2,525,560.14
应付管理人报酬		405,783.51	564,316.28
应付托管费		76,084.41	105,809.32
应付销售服务费		100,562.81	115,074.69
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,074.58	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	526,716.92	632,984.49
负债合计		3,943,855.32	5,653,810.78
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	318,928,560.39	482,204,814.42
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	235,667,199.52	352,373,768.02
净资产合计		554,595,759.91	834,578,582.44
负债和净资产总计		558,539,615.23	840,232,393.22

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 318,928,560.39 份，其中西部利得沪深 300 指数 A 份额总额 164,087,779.28 份，基金份额净值 1.7588 元；西部利得沪深 300 指数 C 份额总额 154,840,781.11 份，基金份额净值 1.7179 元。

6.2 利润表

会计主体：西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		6,512,820.74	55,349,923.85
1. 利息收入		356,999.21	523,184.32
其中：存款利息收入	6.4.7.13	356,999.21	523,184.32
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）		9,594,626.51	13,823,047.08
其中：股票投资收益		1,855,700.41	3,771,938.12

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	33,179.45	-
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	439,847.33	1,827,710.10
股利收益	6.4.7.19	7,265,899.32	8,223,398.86
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	-3,630,908.00	38,016,457.63
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	192,103.02	2,987,234.82
减：二、营业总支出		4,477,384.66	5,586,352.49
1. 管理人报酬		3,054,003.75	4,019,422.34
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费		572,625.69	753,641.74
3. 销售服务费		724,673.12	624,014.05
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		1,362.23	8,218.84
8. 其他费用	6.4.7.23	124,719.87	181,055.52
三、利润总额(亏损总 额以“-”号填列)		2,035,436.08	49,763,571.36
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以 “-”号填列)		2,035,436.08	49,763,571.36
五、其他综合收益的税 后净额		-	-
六、综合收益总额		2,035,436.08	49,763,571.36

6.3 净资产变动表

会计主体：西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025 年 1 月 1 日至 2025 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	482,204,814.42	-	352,373,768.02	834,578,582.44
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	482,204,814.42	-	352,373,768.02	834,578,582.44
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	-	-279,982,822.53
	163,276,254.03		116,706,568.50	
(一)、综合收益总额	-	-	2,035,436.08	2,035,436.08
(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)	-	-	-	-282,018,258.61
	163,276,254.03		118,742,004.58	
其中：1. 基金申购款	105,369,955.23	-	69,879,323.88	175,249,279.11
2. 基金赎回款	-	-	-	-457,267,537.72
	268,646,209.26		188,621,328.46	
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	318,928,560.39	-	235,667,199.52	554,595,759.91
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	631,080,424.22	-	332,517,569.94	963,597,994.16
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	631,080,424.22	-	332,517,569.94	963,597,994.16
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 148,956,729.96	-	-70,330,453.33	-219,287,183.29
(一)、综合收益总额	-	-	49,763,571.36	49,763,571.36
(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)	- 148,956,729.96	-	- 120,094,024.69	-269,050,754.65
其中：1. 基金申购款	594,816,521.82	-	281,096,796.00	875,913,317.82
2. 基金赎回款	- 743,773,251.78	-	- 401,190,820.69	- 1,144,964,072.47
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	482,123,694.26	-	262,187,116.61	744,310,810.87

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

贺燕萍

贺燕萍

张皞骏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）是由西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“原基金”）转型而来。原基金经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]2113 号《关于准予西部利得久安回报灵活配置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《西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。原基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 200,484,720.05 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 1700239 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 21 日正式生效，原基金合同生效日的基金份额总额为 200,520,789.91 份基金份额，其中认购资金利息折合 36,069.86 份基金份额。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成分股、备选成分股、其他国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、国债、央行票据、金融债、地方政府债、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更基金投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投

资比例。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*95%+商业银行活期存款利率（税后）*5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金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>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

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 2025 年 06 月 30 日的财务状况、2025 年上半年度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》、财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延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》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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	72,300,650.66
等于：本金	72,283,669.58
加：应计利息	16,981.08
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	72,300,650.66

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 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		454,470,309.26	-	464,185,092.63	9,714,783.37
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	11,583,415.91	61,565.81	11,651,125.81	6,144.09
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	11,583,415.91	61,565.81	11,651,125.81	6,144.09
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		466,053,725.17	61,565.81	475,836,218.44	9,720,927.46

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 2025 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	45,906,780.00	-	-	-
其中： 股指期货投资	45,906,780.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	45,906,780.00	-	-	-

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
IF2507	IF2507	40.00	46,893,600.00	986,820.00
合计				986,820.00
减：可抵销期货暂收款				986,820.00
净额				0.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	366.84
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	351,630.21
其中：交易所市场	351,630.21
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用	80,830.98
应付指数使用费	93,888.89

合计	526,716.92
----	------------

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

西部利得沪深 300 指数 A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	275,156,688.22	275,156,688.22
本期申购	15,893,620.17	15,893,620.17
本期赎回（以“-”号填列）	-126,962,529.11	-126,962,529.11
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	164,087,779.28	164,087,779.28

西部利得沪深 300 指数 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	207,048,126.20	207,048,126.20
本期申购	89,476,335.06	89,476,335.06
本期赎回（以“-”号填列）	-141,683,680.15	-141,683,680.15
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	154,840,781.11	154,840,781.11

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

西部利得沪深 300 指数 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	101,503,983.59	103,963,010.71	205,466,994.30
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	101,503,983.59	103,963,010.71	205,466,994.30
本期利润	3,068,454.79	-5,159,427.62	-2,090,972.83
本期基金份额交易产	-40,907,134.34	-37,964,296.37	-78,871,430.71

生的变动数			
其中：基金申购款	5,974,962.78	5,536,835.61	11,511,798.39
基金赎回款	-46,882,097.12	-43,501,131.98	-90,383,229.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	63,665,304.04	60,839,286.72	124,504,590.76

西部利得沪深 300 指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	62,240,537.39	84,666,236.33	146,906,773.72
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	62,240,537.39	84,666,236.33	146,906,773.72
本期利润	2,597,889.29	1,528,519.62	4,126,408.91
本期基金份额交易产生的变动数	-15,917,754.58	-23,952,819.29	-39,870,573.87
其中：基金申购款	26,661,463.89	31,706,061.60	58,367,525.49
基金赎回款	-42,579,218.47	-55,658,880.89	-98,238,099.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	48,920,672.10	62,241,936.66	111,162,608.76

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	339,475.95
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	13,279.93
其他	4,243.33
合计	356,999.21

注：其他包括结算保证金利息收入以及销售款利息收入。

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,855,700.41
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	1,855,700.41

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,902,655,097.66
减：卖出股票成本总额	1,898,891,672.72
减：交易费用	1,907,724.53
买卖股票差价收入	1,855,700.41

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 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	33,179.45
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	—
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	33,179.45

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**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	439,847.33

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	7,265,899.32
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	7,265,899.32

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-4,723,628.00
股票投资	-4,729,772.09

债券投资	6,144.09
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	1,092,720.00
权证投资	—
期货投资	1,092,720.00
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	-3,630,908.00

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	56,772.11
基金转换费收入	135,330.91
合计	192,103.02

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

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费不低于 25% 的部分归入转出基金的基金资产。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	21,323.61
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
指数使用费	43,888.89
合计	124,719.87

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额 的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
西部证券股份有 限公司	304,733,223.74	8.60	1,017,210,010.03	20.34

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 （%）
西部证券股份有 限公司	62,748.96	8.60	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 （%）
西部证券股份有 限公司	453,567.39	19.10	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2024 年 7 月 1 日前，该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。自 2024 年 7 月 1 日起，券商不再为本基金提供除交易单元租用以外服务。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,054,003.75	4,019,422.34
其中：应支付销售机构的客户维 护费	765,115.95	952,051.00
应支付基金管理人的净管理费	2,288,887.80	3,067,371.34

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 0.80%的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	572,625.69	753,641.74

注：支付基金托管人平安银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	西部利得沪深 300 指数 A	西部利得沪深 300 指数 C	合计
平安银行股份有限公司	-	24,143.16	24,143.16
西部利得基金管理有限公司	-	297,754.23	297,754.23
西部证券股份有限公司	-	2,705.80	2,705.80
合计	-	324,603.19	324,603.19
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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		
	西部利得沪深 300 指数 A	西部利得沪深 300 指数 C	合计
平安银行股份有限公司	-	5,980.84	5,980.84
西部利得基金管理有限公司	-	183,370.09	183,370.09
西部证券股份有限公司	-	2,737.22	2,737.22
合计	-	192,088.15	192,088.15

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给西部利得基金，再由西部利得基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间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通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

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

本基金管理人于本报告期及上年度可比区间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

本报告期末及上年度可比区间无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行股份有限公司	72,300,650.66	339,475.95	75,263,015.14	466,140.24

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

2. 本基金通过“平安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 2025 年 06 月 30 日的相关余额为人民币 2,025,134.80 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（2025 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
001335	信凯科技	2025 年 4 月 2 日	6 个月	锁定期	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001382	新亚电缆	2025 年 3 月 13 日	6 个月	锁定期	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股未上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	锁定期	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
301173	毓恬冠佳	2025 年 2 月 24 日	6 个月	锁定期	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
301275	汉朔科技	2025 年 3 月 4 日	6 个月	锁定期	27.50	56.19	397	10,917.50	22,307.43	-
301458	钧崴电子	2025 年 1 月 2 日	6 个月	锁定期	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-
301479	弘景光电	2025 年 3 月 6 日	6 个月	锁定期	41.90	77.87	130	5,447.00	10,123.10	-
301479	弘景光电	2025 年 5 月 28 日	6 个月	锁定期	0	77.87	52	0.00	4,049.24	锁定期内送股

301501	恒鑫生活	2025 年 3 月 11 日	6 个月	锁定期	39.92	45.22	241	9,620.72	10,898.02	-
301501	恒鑫生活	2025 年 6 月 6 日	6 个月	锁定期	0	45.22	109	0.00	4,928.98	锁定期内送股
301560	众捷汽车	2025 年 4 月 17 日	6 个月	锁定期	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优优绿能	2025 年 5 月 28 日	6 个月	锁定期	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
301595	太力科技	2025 年 5 月 12 日	6 个月	锁定期	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301601	惠通科技	2025 年 1 月 8 日	6 个月	锁定期	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
301602	超研股份	2025 年 1 月 15 日	6 个月	锁定期	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
301636	泽润新能	2025 年 4 月 30 日	6 个月	锁定期	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首航新能	2025 年 3 月 26 日	6 个月	锁定期	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301662	宏工科技	2025 年 4 月 10 日	6 个月	锁定期	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301665	泰禾股份	2025 年 4 月 2 日	6 个月	锁定期	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-

603014	威高血净	2025 年 5 月 12 日	6 个月	锁定期	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月	锁定期	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-
603120	肯特催化	2025 年 4 月 9 日	6 个月	锁定期	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603124	江南新材	2025 年 3 月 12 日	6 个月	锁定期	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603202	天有为	2025 年 4 月 16 日	6 个月	锁定期	93.50	90.66	135	12,622.50	12,239.10	-
603210	泰鸿万立	2025 年 4 月 1 日	6 个月	锁定期	8.60	15.61	29	249.40	452.69	-
603271	永杰新材	2025 年 3 月 4 日	6 个月	锁定期	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-
603382	海阳科技	2025 年 6 月 5 日	6 个月	锁定期	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
603409	汇通控股	2025 年 2 月 25 日	6 个月	锁定期	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-
688411	海博思创	2025 年 1 月 20 日	6 个月	锁定期	19.38	83.49	560	10,852.80	46,754.40	-
688583	思看科技	2025 年 1 月 8 日	6 个月	锁定期	33.46	79.68	175	5,855.50	13,944.00	-

688583	思看科技	2025 年 6 月 19 日	6 个月	锁定期	0	79.68	52	0.00	4,143.36	锁定期内送股
688755	汉邦科技	2025 年 5 月 9 日	6 个月	锁定期	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
688757	胜科纳米	2025 年 3 月 18 日	6 个月	锁定期	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
688775	影石创新	2025 年 6 月 4 日	6 个月	锁定期	47.27	124.16	573	27,085.71	71,143.68	-

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等流通受限股票。

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。

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	11,651,125.81	-
合计	11,651,125.81	-

- 注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。
2. 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等级的债券。

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。

本基金持有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。本基金的生息资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金等。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，并按照合约规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 2025 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	72,300,650.66	-	-	-	72,300,650.66
结算备付金	3,243,389.84	-	-	-	3,243,389.84
存出保证金	5,844,686.62	-	-	-	5,844,686.62
交易性金融资产	11,651,125.81	-	-	-464,185,092.63	475,836,218.44
应收申购款	-	-	-	1,283,338.02	1,283,338.02
应收清算款	-	-	-	31,331.65	31,331.65
资产总计	93,039,852.93	-	-	-465,499,762.30	558,539,615.23
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,833,633.09	2,833,633.09
应付管理人报酬	-	-	-	405,783.51	405,783.51
应付托管费	-	-	-	76,084.41	76,084.41
应付销售服务费	-	-	-	100,562.81	100,562.81
应交税费	-	-	-	1,074.58	1,074.58
其他负债	-	-	-	526,716.92	526,716.92
负债总计	-	-	-	3,943,855.32	3,943,855.32
利率敏感度缺口	93,039,852.93	-	-	-461,555,906.98	554,595,759.91
上年度末 2024 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	104,815,344.38	-	-	-	104,815,344.38
结算备付金	4,174,591.86	-	-	-	4,174,591.86
存出保证金	7,444,017.71	-	-	-	7,444,017.71
交易性金融资产	-	-	-	-720,007,839.18	720,007,839.18
应收申购款	-	-	-	492,748.67	492,748.67
应收清算款	-	-	-	3,297,851.42	3,297,851.42
资产总计	116,433,953.95	-	-	-723,798,439.27	840,232,393.22
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,525,560.14	2,525,560.14
应付管理人报酬	-	-	-	564,316.28	564,316.28
应付托管费	-	-	-	105,809.32	105,809.32
应付清算款	-	-	-	1,710,065.86	1,710,065.86
应付销售服务费	-	-	-	115,074.69	115,074.69
其他负债	-	-	-	632,984.49	632,984.49
负债总计	-	-	-	5,653,810.78	5,653,810.78
利率敏感度缺口	116,433,953.95	-	-	-718,144,628.49	834,578,582.44

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 2025 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（2024 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 2025 年 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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	464,185,092.63	83.70	720,007,839.18	86.27
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	11,651,125.81	2.10	—	—
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	475,836,218.44	85.80	720,007,839.18	86.27

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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%的影响金额	27,263,000.00	41,083,000.00

	业绩比较基准下降 5%的影响金额	-27,263,000.00	-41,083,000.00
--	---------------------	----------------	----------------

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	463,784,435.24	713,963,370.58
第二层次	11,666,511.35	5,608,074.50
第三层次	385,271.85	436,394.10
合计	475,836,218.44	720,007,839.18

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 2025 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（2024 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 2025 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	464,185,092.63	83.11
	其中：股票	464,185,092.63	83.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,651,125.81	2.09
	其中：债券	11,651,125.81	2.09
	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	75,544,040.50	13.53
8	其他各项资产	7,159,356.29	1.28
9	合计	558,539,615.23	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	3,644,085.40	0.66
B	采矿业	21,324,265.50	3.85
C	制造业	211,144,327.23	38.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,242,613.00	4.01
E	建筑业	10,071,616.00	1.82
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	20,489,320.00	3.69
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,684,043.50	5.71
J	金融业	127,000,309.16	22.90
K	房地产业	1,127,035.00	0.20
L	租赁和商务服务业	7,520,337.90	1.36

M	科学研究和技术服务业	5,885,378.55	1.06
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	1,651,104.00	0.30
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	463,784,435.24	83.63

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	372,932.85	0.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	2,244.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	25,480.54	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—

S	综合	-	-
	合计	400,657.39	0.07

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	388,719	21,566,130.12	3.89
2	600519	贵州茅台	9,875	13,919,010.00	2.51
3	600900	XD 长江电	339,200	10,223,488.00	1.84
4	600036	招商银行	183,722	8,442,025.90	1.52
5	601328	交通银行	983,800	7,870,400.00	1.42
6	601899	紫金矿业	389,693	7,599,013.50	1.37
7	600887	伊利股份	259,398	7,232,016.24	1.30
8	300750	宁德时代	27,840	7,021,804.80	1.27
9	601398	工商银行	860,200	6,528,918.00	1.18
10	601166	兴业银行	269,700	6,294,798.00	1.14
11	601766	中国中车	893,230	6,288,339.20	1.13
12	601658	邮储银行	1,140,763	6,239,973.61	1.13
13	601728	中国电信	804,100	6,231,775.00	1.12
14	300433	蓝思科技	267,600	5,967,480.00	1.08
15	600011	华能国际	830,200	5,927,628.00	1.07
16	603259	药明康德	84,021	5,843,660.55	1.05
17	688981	中芯国际	64,933	5,725,142.61	1.03
18	601988	中国银行	984,000	5,530,080.00	1.00
19	601816	京沪高铁	920,500	5,292,875.00	0.95
20	601390	XD 中国中	926,400	5,197,104.00	0.94
21	688008	澜起科技	61,230	5,020,860.00	0.91
22	000100	TCL 科技	1,145,319	4,959,231.27	0.89
23	601288	农业银行	830,500	4,883,340.00	0.88
24	601006	大秦铁路	734,400	4,847,040.00	0.87
25	601319	中国人保	550,700	4,796,597.00	0.86
26	600050	中国联通	898,100	4,795,854.00	0.86
27	600089	特变电工	385,100	4,594,243.00	0.83
28	600660	福耀玻璃	79,500	4,532,295.00	0.82
29	000333	美的集团	62,500	4,512,500.00	0.81
30	601939	建设银行	470,400	4,440,576.00	0.80
31	000425	徐工机械	564,200	4,383,834.00	0.79
32	002027	分众传媒	590,300	4,309,190.00	0.78

33	600018	上港集团	740,800	4,229,968.00	0.76
34	601668	中国建筑	709,600	4,094,392.00	0.74
35	300394	天孚通信	50,760	4,052,678.40	0.73
36	000792	盐湖股份	237,216	4,051,649.28	0.73
37	688256	寒武纪	6,715	4,039,072.50	0.73
38	000858	五 粮 液	32,500	3,864,250.00	0.70
39	601628	中国人寿	89,500	3,686,505.00	0.66
40	601360	三六零	354,100	3,611,820.00	0.65
41	000651	格力电器	78,900	3,544,188.00	0.64
42	000975	山金国际	186,800	3,537,992.00	0.64
43	601877	正泰电器	155,100	3,516,117.00	0.63
44	600000	浦发银行	249,700	3,465,836.00	0.62
45	600016	民生银行	676,000	3,211,000.00	0.58
46	601600	中国铝业	453,800	3,194,752.00	0.58
47	002601	龙佰集团	196,700	3,188,507.00	0.57
48	002493	荣盛石化	376,000	3,113,280.00	0.56
49	601888	中国中免	50,870	3,101,543.90	0.56
50	601211	国泰海通	160,794	3,080,813.04	0.56
51	002236	大华股份	192,700	3,060,076.00	0.55
52	300014	亿纬锂能	66,300	3,037,203.00	0.55
53	601898	中煤能源	275,600	3,015,064.00	0.54
54	600009	上海机场	92,500	2,938,725.00	0.53
55	600436	片仔癀	14,600	2,920,146.00	0.53
56	300408	三环集团	86,400	2,885,760.00	0.52
57	600941	中国移动	24,300	2,734,965.00	0.49
58	002736	国信证券	236,200	2,721,024.00	0.49
59	000166	申万宏源	537,206	2,696,774.12	0.49
60	000338	潍柴动力	173,798	2,673,013.24	0.48
61	600030	中信证券	94,425	2,608,018.50	0.47
62	000807	云铝股份	159,300	2,545,614.00	0.46
63	002415	海康威视	78,800	2,185,124.00	0.39
64	300498	温氏股份	126,530	2,161,132.40	0.39
65	603501	豪威集团	16,800	2,144,520.00	0.39
66	605499	东鹏饮料	6,700	2,104,135.00	0.38
67	688111	金山办公	7,300	2,044,365.00	0.37
68	000157	中联重科	279,760	2,022,664.80	0.36
69	000999	华润三九	63,900	1,998,792.00	0.36
70	601336	新华保险	34,000	1,989,000.00	0.36
71	600905	三峡能源	452,400	1,927,224.00	0.35
72	601169	北京银行	279,400	1,908,302.00	0.34
73	600015	华夏银行	236,549	1,871,102.59	0.34
74	688012	中微公司	10,258	1,870,033.40	0.34
75	002241	歌尔股份	79,300	1,849,276.00	0.33

76	000538	云南白药	33,100	1,846,649.00	0.33
77	601066	中信建投	75,100	1,806,155.00	0.33
78	600919	江苏银行	151,100	1,804,134.00	0.33
79	600482	中国动力	77,300	1,783,311.00	0.32
80	603296	华勤技术	21,748	1,754,628.64	0.32
81	000063	中兴通讯	53,800	1,747,962.00	0.32
82	601377	兴业证券	270,100	1,671,919.00	0.30
83	601688	华泰证券	92,900	1,654,549.00	0.30
84	300015	爱尔眼科	132,300	1,651,104.00	0.30
85	002938	鹏鼎控股	51,265	1,642,017.95	0.30
86	600999	招商证券	93,100	1,637,629.00	0.30
87	600989	宝丰能源	100,100	1,615,614.00	0.29
88	002230	科大讯飞	33,300	1,594,404.00	0.29
89	600346	恒力石化	111,100	1,584,286.00	0.29
90	603799	华友钴业	41,283	1,528,296.66	0.28
91	600196	复星医药	60,900	1,527,981.00	0.28
92	603392	万泰生物	24,800	1,512,800.00	0.27
93	688169	石头科技	9,540	1,493,487.00	0.27
94	600104	上汽集团	92,800	1,489,440.00	0.27
95	002714	牧原股份	35,300	1,482,953.00	0.27
96	600028	中国石化	260,000	1,466,400.00	0.26
97	301269	华大九天	11,800	1,461,784.00	0.26
98	601881	中国银河	84,582	1,450,581.30	0.26
99	603288	海天味业	37,072	1,442,471.52	0.26
100	000301	东方盛虹	172,900	1,440,257.00	0.26
101	000408	藏格矿业	33,700	1,437,979.00	0.26
102	603019	中科曙光	20,400	1,436,160.00	0.26
103	002142	宁波银行	52,400	1,433,664.00	0.26
104	002648	卫星化学	82,700	1,433,191.00	0.26
105	600019	宝钢股份	214,492	1,413,502.28	0.25
106	600406	国电南瑞	62,900	1,409,589.00	0.25
107	002594	比亚迪	4,200	1,394,022.00	0.25
108	300274	阳光电源	20,400	1,382,508.00	0.25
109	600309	万华化学	25,400	1,378,204.00	0.25
110	688041	海光信息	9,695	1,369,806.55	0.25
111	603986	兆易创新	10,700	1,353,871.00	0.24
112	601799	星宇股份	10,700	1,337,500.00	0.24
113	601872	招商轮船	208,700	1,306,462.00	0.24
114	002304	洋河股份	20,200	1,303,910.00	0.24
115	603260	合盛硅业	27,500	1,303,500.00	0.24
116	600795	国电电力	268,300	1,298,572.00	0.23
117	600690	海尔智家	52,400	1,298,472.00	0.23
118	600027	华电国际	236,900	1,295,843.00	0.23

119	688187	时代电气	29,500	1,258,175.00	0.23
120	300033	同花顺	4,400	1,201,244.00	0.22
121	002371	北方华创	2,700	1,193,967.00	0.22
122	600938	中国海油	45,500	1,188,005.00	0.21
123	600489	中金黄金	77,900	1,139,677.00	0.21
124	601229	上海银行	107,400	1,139,514.00	0.21
125	601919	中远海控	75,200	1,131,008.00	0.20
126	688271	联影医疗	8,800	1,124,112.00	0.20
127	002422	科伦药业	29,800	1,070,416.00	0.19
128	300442	润泽科技	21,300	1,054,989.00	0.19
129	600918	中泰证券	163,200	1,049,376.00	0.19
130	601698	中国卫通	51,000	1,043,970.00	0.19
131	601009	南京银行	89,800	1,043,476.00	0.19
132	600547	山东黄金	32,400	1,034,532.00	0.19
133	300124	汇川技术	16,000	1,033,120.00	0.19
134	600031	三一重工	56,800	1,019,560.00	0.18
135	600332	白云山	38,500	1,014,860.00	0.18
136	601818	光大银行	244,010	1,012,641.50	0.18
137	600893	航发动力	26,200	1,009,748.00	0.18
138	601012	隆基绿能	66,100	992,822.00	0.18
139	600958	东方证券	102,036	987,708.48	0.18
140	002252	上海莱士	142,400	978,288.00	0.18
141	601878	浙商证券	85,500	932,805.00	0.17
142	300059	东方财富	40,200	929,826.00	0.17
143	002074	国轩高科	28,500	925,110.00	0.17
144	601916	浙商银行	265,700	900,723.00	0.16
145	688009	中国通号	174,169	895,228.66	0.16
146	000596	古井贡酒	6,600	878,790.00	0.16
147	603806	福斯特	67,800	878,688.00	0.16
148	600048	保利发展	107,200	868,320.00	0.16
149	600372	中航机载	71,933	867,511.98	0.16
150	000617	中油资本	117,300	856,290.00	0.15
151	601236	红塔证券	97,600	826,672.00	0.15
152	002179	中航光电	20,000	807,200.00	0.15
153	600161	天坛生物	42,060	807,131.40	0.15
154	601088	中国神华	19,900	806,746.00	0.15
155	001289	龙源电力	49,700	804,146.00	0.14
156	601989	中国重工	172,200	799,008.00	0.14
157	300308	中际旭创	5,400	787,644.00	0.14
158	600039	四川路桥	78,800	780,120.00	0.14
159	600809	山西汾酒	4,400	776,116.00	0.14
160	688303	大全能源	36,000	767,520.00	0.14
161	601127	赛力斯	5,400	725,328.00	0.13

162	600276	恒瑞医药	13,780	715,182.00	0.13
163	300628	亿联网络	19,800	688,248.00	0.12
164	300760	迈瑞医疗	3,030	680,992.50	0.12
165	000568	泸州老窖	5,800	657,720.00	0.12
166	600150	中国船舶	19,800	644,292.00	0.12
167	600760	中航沈飞	10,800	633,096.00	0.11
168	601985	XD 中国核	67,600	630,032.00	0.11
169	601225	陕西煤业	31,900	613,756.00	0.11
170	600570	恒生电子	17,600	590,304.00	0.11
171	688223	晶科能源	109,852	570,131.88	0.10
172	600085	同仁堂	15,800	569,748.00	0.10
173	600588	用友网络	41,700	557,529.00	0.10
174	000938	紫光股份	23,100	554,169.00	0.10
175	000977	浪潮信息	10,800	549,504.00	0.10
176	000876	新 希 望	58,400	547,792.00	0.10
177	601058	赛轮轮胎	40,000	524,800.00	0.09
178	600160	巨化股份	18,200	521,976.00	0.09
179	688036	传音控股	6,500	518,050.00	0.09
180	002475	立讯精密	14,605	506,647.45	0.09
181	600029	南方航空	85,400	503,860.00	0.09
182	002460	赣锋锂业	14,900	503,173.00	0.09
183	002600	领益智造	56,400	484,476.00	0.09
184	603369	今世缘	12,400	482,732.00	0.09
185	601689	拓普集团	10,200	481,950.00	0.09
186	002459	晶澳科技	47,700	476,046.00	0.09
187	300661	圣邦股份	6,480	471,549.60	0.09
188	301236	软通动力	8,600	469,904.00	0.08
189	002180	纳思达	20,400	467,976.00	0.08
190	600875	东方电气	27,800	465,372.00	0.08
191	600600	青岛啤酒	6,600	458,436.00	0.08
192	000983	山西焦煤	70,400	450,560.00	0.08
193	601699	潞安环能	40,000	422,000.00	0.08
194	601059	信达证券	24,600	420,660.00	0.08
195	601136	首创证券	20,600	409,528.00	0.07
196	603833	欧派家居	7,200	406,440.00	0.07
197	000800	一汽解放	59,100	405,426.00	0.07
198	300896	爱美客	2,300	402,063.00	0.07
199	603195	公牛集团	8,120	391,790.00	0.07
200	002916	深南电路	2,600	280,306.00	0.05
201	001979	招商蛇口	29,500	258,715.00	0.05
202	600115	中国东航	59,400	239,382.00	0.04
203	000661	长春高新	2,300	228,114.00	0.04
204	300782	卓胜微	2,900	206,973.00	0.04

205	000786	北新建材	7,700	203,896.00	0.04
206	688506	百利天恒	600	177,672.00	0.03
207	601100	恒立液压	2,000	144,000.00	0.03
208	600023	浙能电力	25,600	135,680.00	0.02
209	600415	小商品城	5,300	109,604.00	0.02
210	688126	沪硅产业	4,898	91,690.56	0.02
211	601633	长城汽车	2,687	57,716.76	0.01
212	000625	长安汽车	4,520	57,675.20	0.01
213	600741	华域汽车	3,076	54,291.40	0.01
214	603993	洛阳钼业	6,000	50,520.00	0.01
215	300418	昆仑万维	1,300	43,719.00	0.01
216	300759	康龙化成	1,700	41,718.00	0.01
217	600176	中国巨石	1,000	11,400.00	0.00
218	600584	长电科技	300	10,107.00	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	688775	影石创新	573	71,143.68	0.01
2	688411	海博思创	560	46,754.40	0.01
3	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.00
4	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
5	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
6	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
7	301501	恒鑫生活	350	15,827.00	0.00
8	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
9	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
10	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
11	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
12	603202	天有为	135	12,239.10	0.00
13	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
14	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
15	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
16	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
17	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
18	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
19	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
20	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
21	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
22	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
23	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
24	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
25	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00

26	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
27	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
28	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
29	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
30	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
31	603210	泰鸿万立	29	452.69	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	688256	寒武纪	18,292,114.43	2.19
2	600406	国电南瑞	18,034,666.00	2.16
3	600482	中国动力	17,235,986.00	2.07
4	601668	中国建筑	17,204,597.00	2.06
5	300433	蓝思科技	16,684,443.00	2.00
6	688981	中芯国际	16,605,066.67	1.99
7	601766	中国中车	16,112,388.19	1.93
8	000975	山金国际	14,413,658.00	1.73
9	000425	徐工机械	14,289,021.77	1.71
10	300750	宁德时代	14,012,910.20	1.68
11	601398	工商银行	13,796,639.00	1.65
12	601328	交通银行	13,782,705.00	1.65
13	002938	鹏鼎控股	13,601,420.89	1.63
14	600570	恒生电子	13,571,060.00	1.63
15	601633	长城汽车	13,474,330.03	1.61
16	601319	中国人保	13,366,893.00	1.60
17	600900	XD 长江电	13,360,266.00	1.60
18	600941	中国移动	13,340,774.00	1.60
19	000858	五 粮 液	13,223,773.00	1.58
20	600011	华能国际	12,957,762.00	1.55

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	300750	宁德时代	22,286,672.20	2.67
2	601668	中国建筑	20,257,401.00	2.43
3	600406	国电南瑞	20,072,850.28	2.41
4	300433	蓝思科技	19,368,317.00	2.32

5	600019	宝钢股份	17,365,407.40	2.08
6	002938	鹏鼎控股	16,795,712.00	2.01
7	601398	工商银行	15,670,982.00	1.88
8	600489	中金黄金	15,561,383.00	1.86
9	601328	交通银行	15,505,062.00	1.86
10	000895	双汇发展	15,489,648.87	1.86
11	600482	中国动力	15,063,425.00	1.80
12	600941	中国移动	14,961,627.00	1.79
13	688009	中国通号	14,737,616.62	1.77
14	000333	美的集团	14,633,764.00	1.75
15	000725	京东方 A	14,569,511.00	1.75
16	688981	中芯国际	14,487,438.76	1.74
17	000425	徐工机械	14,171,554.72	1.70
18	601766	中国中车	14,127,448.00	1.69
19	600570	恒生电子	13,972,926.00	1.67
20	601658	邮储银行	13,968,040.00	1.67

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	1,647,798,698.26
卖出股票收入（成交）总额	1,902,655,097.66

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	11,651,125.81	2.10
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	11,651,125.81	2.10

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	019766	25 国债 01	116,000	11,651,125.81	2.10

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投资。

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

国债期货不在本基金投资范围内。

7.11.2 本期国债期货投资评价

国债期货不在本基金投资范围内。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,844,686.62
2	应收清算款	31,331.65
3	应收股利	—
4	应收利息	—

5	应收申购款	1,283,338.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,159,356.29

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688775	影石创新	71,143.68	0.01	锁定期
2	688411	海博思创	46,754.40	0.01	锁定期
3	301458	钧崴电子	23,911.11	0.00	锁定期
4	301275	汉朔科技	22,307.43	0.00	锁定期
5	688583	思看科技	18,087.36	0.00	锁定期

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（%）
西部利得沪深 300 指数 A	24,000	6,836.99	15,237,826.56	9.29	148,849,952.72	90.71
西部利得沪深 300 指数 C	40,775	3,797.44	74,792,346.89	48.30	80,048,434.22	51.70

合计	63,080	5,055.94	90,030,173.45	28.23	228,898,386.94	71.77
----	--------	----------	---------------	-------	----------------	-------

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	西部利得沪深 300 指数 A	2,180,660.85	1.3290
	西部利得沪深 300 指数 C	33,246.78	0.0215
	合计	2,213,907.63	0.6942

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	西部利得沪深 300 指数 A	0~10
	西部利得沪深 300 指数 C	—
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	西部利得沪深 300 指数 A	—
	西部利得沪深 300 指数 C	—
	合计	—

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	西部利得沪深 300 指数 A	西部利得沪深 300 指数 C
基金合同生效日（2018 年 12 月 27 日）基金份额总额	18,506,196.98	—
本报告期期初基金份额总额	275,156,688.22	207,048,126.20
本报告期基金总申购份额	15,893,620.17	89,476,335.06
减：本报告期基金	126,962,529.11	141,683,680.15

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	164,087,779.28	154,840,781.11

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的重大人事变动如下：

根据基金管理人第二届董事会第四十二次会议决议，自 2025 年 3 月 26 日起聘任王汗青担任公司副总经理职务，免去孙威公司副总经理职务。

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	元数量	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 (%)	
东方证券	2	2,733,129,809.80	77.09	562,757.91	77.09	-
招商证券	2	507,348,432.86	14.31	104,465.49	14.31	-
西部证券	2	304,733,223.74	8.60	62,748.96	8.60	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通	2	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 本基金交易单元的选择标准主要包括：(1)主体指标，包括证券公司的财务状况评估、经营规范评估、合规内控评估；(2)交易服务指标，包括证券公司的交易服务评估、经纪业务评估、协作满意度评估等。选择程序主要如下：基于上述评估指标，公司定期进行券商准入评估，结合负面剔除情形，形成交易服务准入白名单，对于进入交易服务准入白名单且达到分佣要求的券商可根据业务需要推动交易席位租用流程，与对应券商签订席位租用协议。

2. 上表为本基金通过证券公司进行股票投资及佣金支付情况，报告期间为 2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日。

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 (%)
东方证券	11,583,415.91	100.00	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国泰海 通	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于西部利得基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	基金管理人公司网站、中国证监会基金电子披露网站及本基金选定的信息披露报纸	2025 年 3 月 19 日
2	西部利得基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	同上	2025 年 3 月 28 日
3	西部利得基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司交易及佣金支付情况公告	同上	2025 年 3 月 31 日
4	关于西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金重大关联交易的公告	同上	2025 年 4 月 3 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) 本基金更新的《招募说明书》；

- (4) 本基金《托管协议》;
- (5) 基金管理人《基金管理资格证书》及《企业法人营业执照》;
- (6) 报告期内涉及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

2025 年 8 月 28 日