

西部利得专精特新量化选股混合型证券投资
基金
2026 年中期报告

2026 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：广发证券股份有限公司

送出日期：2026 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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 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	8
§ 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	9
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	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
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54
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	54

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	54
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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	56
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	58
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	58
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	西部利得专精特新量化选股混合型证券投资基金	
基金简称	西部利得专精特新量化选股混合	
基金主代码	024900	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 11 月 18 日	
基金管理人	西部利得基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	884,514,589.12 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	西部利得专精特新量化选股混合 A	西部利得专精特新量化选股混合 C
下属分级基金的交易代码	024900	024901
报告期末下属分级基金的份额总额	473,888,500.11 份	410,626,089.01 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过构建有效的投资组合，充分利用研究投资优势，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	大类资产配置策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、融资交易策略。（详见《基金合同》）
业绩比较基准	华证专精特新 100 指数收益率*90%+中债综合全价指数收益率*10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，在通常情况下其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		西部利得基金管理有限公司	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵毅	罗琦
	联系电话	021-38572888	020-66338888
	电子邮箱	service@westleadfund.com	gzluoqi@gf.com.cn
客户服务电话		4007-007-818	95575
传真		021-50710261	020-87553363-6847
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区耀体路 276 号 901 室-908 室	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区耀体路 276 号 901 室-908 室	广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 34 楼

邮政编码	200126	510627
法定代表人	何方	林传辉

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.westleadfund.com
基金中期报告置备地点	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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	西部利得专精特新量化选股混合 A	西部利得专精特新量化选股混合 C
本期已实现收益	37,811,906.92	30,066,507.88
本期利润	-39,432,256.45	-45,144,066.51
加权平均基金份 额本期利润	-0.0690	-0.0863
本期加权平均净 值利润率	-6.76%	-8.47%
本期基金份额净 值增长率	-8.64%	-8.82%
3.1.2 期 末 数 据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	-49,695,170.87	-43,976,813.09
期末可供分配基 金份额利润	-0.1049	-0.1071
期末基金资产净 值	424,193,329.24	366,649,275.92
期末基金份额净 值	0.8951	0.8929

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-6.56%	-6.78%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

西部利得专精特新量化选股混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-9.34%	1.46%	42.88%	2.17%	-52.22%	-0.71%
过去六个月	-8.64%	1.52%	35.18%	2.06%	-43.82%	-0.54%
自基金合同生效起至今	-6.56%	1.42%	51.33%	1.91%	-57.89%	-0.49%

西部利得专精特新量化选股混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-9.43%	1.45%	42.88%	2.17%	-52.31%	-0.72%
过去六个月	-8.82%	1.52%	35.18%	2.06%	-44.00%	-0.54%
自基金合同生效起至今	-6.78%	1.42%	51.33%	1.91%	-58.11%	-0.49%

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

西部利得专精特新量化选股混合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



西部利得专精特新量化选股混合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



注：1. 本基金合同于 2025 年 11 月 18 日生效，截至本报告期末本基金合同生效未满一年。

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

3.3 其他指标

无

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

西部利得基金管理有限公司于 2010 年 7 月 20 日正式成立，公司总部设在上海，在北京、深圳设有分公司，是经中国证监会批准设立的第 60 家全国规范性基金管理公司。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、首席投资官（量化）、主动量化投资部总经理、基金经理	2025 年 11 月 18 日	—	13 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。

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。

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评估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。选股上主要围绕专精特新概念股和国企的小盘股；行业配置分散。本基金努力通过选股打造优质的小盘风格量化基金。

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 2026 年下半年，A 股市场的运行规律与结构性机会主要由三大核心主线驱动：国内产业能级持续跃升、全球安全诉求系统性抬升、科技板块估值与基本面深度分化。三大趋势相互交织，

将贯穿全年，主导权益市场运行格局与配置思路。

第一，我国全球产业链地位稳步抬升，核心产业技术突破提速。2026 年上半年，新质生产力落地提速，国内高端制造领域持续兑现标志性技术突破与产业化成果。新能源领域新一代电池体系、兆瓦级闪充系统实现全球突破，技术壁垒与高端产能优势持续夯实；国防军工、核能、高端通信、无人机、智能机器人等高端装备赛道迭代加速，国产化率与高附加值环节占比持续提升，硬核制造竞争力稳步增强。新兴科技赛道同步快速进阶：人工智能产业化落地提速，制造业智能化渗透率上行，国产大模型技术与商业化能力持续优化；商业航天实现可重复火箭稳定回收等关键突破，商业化发射与产业链自主可控水平大幅提升；创新药临床成果密集落地，研发实力加速接轨全球第一梯队；国产 3A 游戏、精品动画等数字文创工业化能力与内容品质持续升级。整体来看，国内高端制造与前沿科技和全球顶尖水平的差距持续收窄，产业成长动能充足。伴随产业实力稳步提升，全球资本对中国资产的认可度与配置意愿回暖，跨境资本与国际货币体系迎来渐进重构，市场对人民币汇率长期稳健运行的预期持续巩固，为 A 股提供稳定外部支撑。

第二，全球安全诉求系统性升温，成为政策与产业配置核心导向，持续孕育结构性投资机会。2025 年全球原有经贸与安全秩序已出现松动重构，2026 年该趋势将持续深化。各国普遍强化供应链、能源资源、国防等底层安全布局，“安全优先”成为全球主流政策导向。在此背景下，核心资源品、安全属性高端制造、贵金属及战略物资的战略价值与配置优先级系统性上行，相关赛道将持续受益于政策补短板与产业自主化需求。

第三，科技板块将告别整体性普涨，进入基本面主导的深度分化阶段，估值逐步回归产业基本面。2024 年至 2026 年上半年科技板块行情活跃，充分反映国内创新成果的同时，也推升了整体估值预期。2026 年下半年科技行业整体性 Beta 行情弱化，投资逻辑从赛道溢价转向个股甄别，技术壁垒、盈利质量与落地能力成为行情分化核心要素。我们长期看好国内科技自主化、高端化成长趋势，但需理性看待产业阶段变化：部分科技企业由研发属性向制造属性切换过程中，盈利结构与增长节奏将迎来重构，存在阶段性估值消化压力，投资端需精细化择标的、控节奏。

综合三大主线，我们对 A 股中长期配置价值保持乐观，市场具备扎实的产业与基本面支撑。结构层面，央企凭借稳健经营、估值修复空间及政策支撑，长期配置性价比与稳健增值属性突出；民营上市公司机制灵活、创新活跃，细分赛道热点频发，但受业绩弹性与资金博弈影响，整体波动相对更高。此外，鉴于人民币汇率具备长期升值潜力，内资配置重心应留在国内，因此我们对境外资产配置整体维持审慎态度。

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，本基金管理人根据企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证

券投资基金业协会相关指引等制订了证券投资基金估值政策和程序，以规范基金估值相关工作的流程与方法。本基金管理人设立估值委员会，估值委员会的成员由投资、研究、风险控制、基金核算等有关人员组成。估值委员会负责基金估值政策、程序、估值方法等基金估值相关工作的评估、决策、指导和监督，以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及解释；对本基金管理人旗下基金会计估计的调整及解释；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，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。本基金估值结果由本基金管理人完成估值并经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。

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及交易所交易债券品种的估值价格、流通受限股票流动性折扣等估值数据。

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，本基金托管人在对西部利得专精特新量化选股混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》等相关法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定勤勉履行基金托管人职责，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，西部利得基金管理有限公司在本基金各重要方面的运作符合基金合同、托管协议的约定，本基金托管人未发现本基金在投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支及利润分配等方面存在任何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

本基金托管人依法对西部利得基金管理有限公司编制和披露的西部利得专精特新量化选股混合型证券投资基金 2026 年中期报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投

资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：西部利得专精特新量化选股混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	43,949,221.18	35,823,784.20
结算备付金		6,558,161.83	10,243,178.44
存出保证金		69,978,093.16	122,952,620.88
交易性金融资产	6.4.7.2	680,682,915.12	1,032,110,981.87
其中：股票投资		680,682,915.12	1,032,110,981.87
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		864,490.47	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		802,032,881.76	1,201,130,565.39
负 债 和 净 资 产			
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付清算款		-	-
应付赎回款		9,929,908.24	-
应付管理人报酬		884,153.08	1,196,111.00
应付托管费		147,358.83	199,351.82
应付销售服务费		139,981.29	177,504.29
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	88,875.16	100,000.00
负债合计		11,190,276.60	1,672,967.11
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	884,514,589.12	1,172,967,506.52
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-93,671,983.96	26,490,091.76
净资产合计		790,842,605.16	1,199,457,598.28
负债和净资产总计		802,032,881.76	1,201,130,565.39

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 884,514,589.12 份，其中西部利得专精特新量化选股混合 A 份额总额 473,888,500.11 份，基金份额净值 0.8951 元；西部利得专精特新量化选股混合 C 份额总额 410,626,089.01 份，基金份额净值 0.8929 元。

6.2 利润表

会计主体：西部利得专精特新量化选股混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-75,615,414.64
1. 利息收入		509,565.45
其中：存款利息收入	6.4.7.13	509,565.45
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）		73,756,750.08
其中：股票投资收益	6.4.7.14	60,181,999.11
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
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	10,080,739.92

股利收益	6.4.7.19	3,494,011.05
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	-152,454,737.76
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	2,573,007.59
减：二、营业总支出		8,960,908.32
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,672,548.04
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,112,091.33
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,063,200.07
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		31,437.90
8. 其他费用	6.4.7.23	81,630.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-84,576,322.96
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-84,576,322.96
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-84,576,322.96

注：本基金合同生效日为 2025 年 11 月 18 日，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：西部利得专精特新量化选股混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	1,172,967,506.52	-	26,490,091.76	1,199,457,598.28
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,172,967,506.52	-	26,490,091.76	1,199,457,598.28
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	288,452,917.40	-	120,162,075.72	-408,614,993.12
(一)、综合收益总额	-	-	-84,576,322.96	-84,576,322.96
(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)	288,452,917.40	-	10,703,733.23	-277,749,184.17
其中：1. 基金申购款	908,508,694.33	-	43,735,704.55	952,244,398.88
2. 基金赎回款	-1,196,961,611.73	-	-33,031,971.32	-1,229,993,583.05
(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)	-	-	-46,289,485.99	-46,289,485.99
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	884,514,589.12	-	-93,671,983.96	790,842,605.16

注：本基金合同生效日为 2025 年 11 月 18 日，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王汗青

王汗青

许野

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

西部利得专精特新量化选股混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2025]1379 号《关于准予西部利得专精特新量化选股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《西部利得专精特新量化选股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基金,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 1,172,624,658.79 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 2500642 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《西部利得专精特新量化选股混合型证券投资基金基金合同》于 2025 年 11 月 18 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,172,967,506.52 份基金份额,其中认购资金利息折合 342,847.73 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,基金托管人为广发证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《西部利得专精特新量化选股混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板、科创板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、存托凭证、衍生工具(股指期货、国债期货、股票期权)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可分离交易可转换债券、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券等中国证监会允许投资的债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、现金等,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的相关规定。本基金还可根据法律法规和基金合同的约定参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

基金的投资组合比例为:本基金股票(含存托凭证)资产占基金资产的比例为 60%-95%,投资于“专精特新”主题相关股票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、股票期权和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,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。现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更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:华证专精特新 100 指数收益率*90%+中债综合全价指数收益率

*10%。

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，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、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 2026 年 06 月 30 日的财务状况、2026 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资、资产支持证券投资、衍生工具和买入返售金融资产等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

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

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

金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

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

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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

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

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

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

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

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《西部利得专精特新量化选股混合型证券投资基金基金合同》的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案详见届时基金管理人发布的公告，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为同一类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的该类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。证券交易所或基金登记机构对收益分

配另有规定的，从其规定；在不违反法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

6.4.4.12 分部报告

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

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。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

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

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

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》、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》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自2026年1月1日至2027年12月31日，免征增值税；对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。自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对本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，股票的股息、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。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对本基金从上市公司、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。对本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。

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

d) 本基金卖出股票按 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) 对本基金运营过程中缴纳的增值税,分别按照本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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	43,949,221.18
等于: 本金	43,930,806.00
加: 应计利息	18,415.18
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	43,949,221.18

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 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		838,197,930.98	-	680,682,915.12	-157,515,015.86
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		838,197,930.98	-	680,682,915.12	-157,515,015.86

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 2026 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	57,082,766.40	-	-	-
其中：股指期货投资	57,082,766.40	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	57,082,766.40	-	-	-

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
IM2607	IM2607	33.00	57,351,360.00	268,593.60
合计				268,593.60
减：可抵销期货暂收款				268,593.60
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 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	7,782.73
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	80,830.98
其他	261.45
合计	88,875.16

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

西部利得专精特新量化选股混合 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	650,672,244.40	650,672,244.40
本期申购	455,721,330.50	455,721,330.50
本期赎回（以“-”号填列）	-632,505,074.79	-632,505,074.79
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	473,888,500.11	473,888,500.11

西部利得专精特新量化选股混合 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	522,295,262.12	522,295,262.12
本期申购	452,787,363.83	452,787,363.83
本期赎回（以“-”号填列）	-564,456,536.94	-564,456,536.94
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	410,626,089.01	410,626,089.01

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

西部利得专精特新量化选股混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	17,491,245.54	-2,657,035.80	14,834,209.74
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	17,491,245.54	-2,657,035.80	14,834,209.74
本期利润	37,811,906.92	-77,244,163.37	-39,432,256.45
本期基金份额交易产生的变动数	-7,904,751.49	8,605,847.56	701,096.07
其中：基金申购款	23,453,251.48	-2,366,177.63	21,087,073.85
基金赎回款	-31,358,002.97	10,972,025.19	-20,385,977.78
本期已分配利润	-25,798,220.23	-	-25,798,220.23
本期末	21,600,180.74	-71,295,351.61	-49,695,170.87

西部利得专精特新量化选股混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,790,530.72	-2,134,648.70	11,655,882.02
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	13,790,530.72	-2,134,648.70	11,655,882.02
本期利润	30,066,507.88	-75,210,574.39	-45,144,066.51
本期基金份额交易产生的变动数	-5,685,373.63	15,688,010.79	10,002,637.16
其中：基金申购款	21,396,113.52	1,252,517.18	22,648,630.70
基金赎回款	-27,081,487.15	14,435,493.61	-12,645,993.54
本期已分配利润	-20,491,265.76	-	-20,491,265.76
本期末	17,680,399.21	-61,657,212.30	-43,976,813.09

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	482,774.68

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	12,918.84
其他	13,871.93
合计	509,565.45

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	60,181,999.11
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	60,181,999.11

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	3,708,452,762.35
减：卖出股票成本总额	3,642,777,927.17
减：交易费用	5,492,836.07
买卖股票差价收入	60,181,999.11

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
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	10,080,739.92

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,494,011.05

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	3,494,011.05

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-148,783,491.36
股票投资	-148,783,491.36
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	-3,671,246.40
权证投资	-
期货投资	-3,671,246.40
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	-152,454,737.76

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,560,133.52
基金转换费收入	12,874.07
合计	2,573,007.59

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	-
其他	800.00
合计	81,630.98

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、关联关系

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
广发证券股份有限公司	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

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。本基金合同生效日为 2025 年 11 月 18 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。本基金合同生效日为 2025 年 11 月 18 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。本基金合同生效日为 2025 年 11 月 18 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金合同生效日为 2025 年 11 月 18

日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。本基金合同生效日为 2025 年 11 月 18 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,672,548.04
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,232,475.38
应支付基金管理人的净管理费	3,440,072.66

注：1. 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%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

2. 本基金合同生效日为 2025 年 11 月 18 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,112,091.33

注：支付基金托管人广发证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

2. 本基金合同生效日为 2025 年 11 月 18 日，无上年度可比期间数据。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	西部利得专精特新量化选股混合 A	西部利得专精特新量化选股混合 C	合计
	广发证券股份有限公司	-	266,167.84

西部利得基金管理有限公司	-	415.19	415.19
西部证券股份有限公司	-	3,607.62	3,607.62
合计	-	270,190.65	270,190.65

注：1. 支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40% 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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日该类基金份额的资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

2. 本基金合同生效日为 2025 年 11 月 18 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。本基金合同生效日为 2025 年 11 月 18 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期末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。本基金合同生效日为 2025 年 11 月 18 日，无上年度可比期间数据。

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

本基金本报告期末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。本基金合同生效日为 2025 年 11 月 18 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

- 1. 本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。
- 2. 本基金合同生效日为 2025 年 11 月 18 日，无上年度可比区间数据。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末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	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
广发证券股份有限公司	43,949,221.18	482,774.68

注：1. 本基金的银行存款通过基金托管人广发证券股份有限公司转存于交通银行股份有限公司，按银行同业利率计息。

2. 本基金合同生效日为 2025 年 11 月 18 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

西部利得专精特新量化选股混合 A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2026 年 1 月 5 日	-	2026 年 1 月 5 日	0.1500	9,107,744.93	652,338.67	9,760,083.60	-
2	2026 年 1 月 19 日	-	2026 年 1 月 19 日	0.1500	6,401,251.22	1,512,277.15	7,913,528.37	-
3	2026 年 1 月 29 日	-	2026 年 1 月 29 日	0.1500	6,211,818.88	1,912,789.38	8,124,608.26	-
合计	-	-	-	0.4500	21,720,815.03	4,077,405.20	25,798,220.23	-
西部利得专精特新量化选股混合 C								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2026 年 1 月 5 日	-	2026 年 1 月 5 日	0.1500	7,475,273.19	359,154.28	7,834,427.47	-
2	2026 年 1 月 19 日	-	2026 年 1 月 19 日	0.1500	4,738,489.30	967,452.78	5,705,942.08	-
3	2026 年 1 月 29 日	-	2026 年 1 月 29 日	0.1500	5,277,071.71	1,673,824.50	6,950,896.21	-
合计	-	-	-	0.4500	17,490,834.20	3,000,431.56	20,491,265.76	-

6.4.12 期末（2026 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
001220	世盟股份	2026年1月27日	6个月	锁定期	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026年5月15日	6个月	锁定期	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001257	盛龙股份	2026年3月24日	6个月	锁定期	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026年4月14日	6个月	锁定期	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026年5月11日	6个月	锁定期	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维通利	2026年5月8日	6个月	锁定期	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026年6月16日	6个月	锁定期	10.12	27.73	5,579	56,459.48	154,705.67	-
301531	春光集团	2026年4月28日	6个月	锁定期	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026年4月22日	6个月	锁定期	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026年4月8日	6个月	锁定期	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-

301669	高特电子	2026年6月2日	6个月	锁定期	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026年2月27日	6个月	锁定期	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301683	慧谷新材	2026年3月24日	6个月	锁定期	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301696	三瑞智能	2026年3月31日	6个月	锁定期	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
603284	林平发展	2026年2月3日	6个月	锁定期	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026年4月9日	6个月	锁定期	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026年1月8日	6个月	锁定期	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603407	长裕集团	2026年4月29日	6个月	锁定期	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
688635	长进光子	2026年5月20日	6个月	锁定期	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026年1月28日	6个月	锁定期	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688781	视涯科技	2026年3月18日	6个月	锁定期	22.68	47.61	217	4,921.56	10,331.37	-

688785	恒运昌	2026年1月20日	6个月	锁定期	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688797	臻宝科技	2026年6月16日	6个月	锁定期	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688808	联讯仪器	2026年4月16日	6个月	锁定期	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688813	泰金新能	2026年3月24日	6个月	锁定期	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026年2月4日	6个月	锁定期	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026年2月3日	6个月	锁定期	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026年4月13日	6个月	锁定期	19.68	141.49	2,080	40,934.40	294,299.20	-

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。

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 2026 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	43,949,221.18	-	-	-	43,949,221.18
结算备付金	6,558,161.83	-	-	-	6,558,161.83
存出保证金	69,978,093.16	-	-	-	69,978,093.16
交易性金融资产	-	-	-	680,682,915.12	680,682,915.12
应收申购款	-	-	-	864,490.47	864,490.47
资产总计	120,485,476.17	-	-	681,547,405.59	802,032,881.76
负债					
应付赎回款	-	-	-	9,929,908.24	9,929,908.24
应付管理人报酬	-	-	-	884,153.08	884,153.08
应付托管费	-	-	-	147,358.83	147,358.83
应付销售服务费	-	-	-	139,981.29	139,981.29
其他负债	-	-	-	88,875.16	88,875.16
负债总计	-	-	-	11,190,276.60	11,190,276.60
利率敏感度缺口	120,485,476.17	-	-	670,357,128.99	790,842,605.16
上年度末 2025 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	35,823,784.20	-	-	-	35,823,784.20
结算备付金	10,243,178.44	-	-	-	10,243,178.44
存出保证金	122,952,620.88	-	-	-	122,952,620.88
交易性金融资产	-	-	-	1,032,110,981.87	1,032,110,981.87
资产总计	169,019,583.52	-	-	1,032,110,981.87	1,201,130,565.39
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,196,111.00	1,196,111.00
应付托管费	-	-	-	199,351.82	199,351.82
应付销售服务费	-	-	-	177,504.29	177,504.29
其他负债	-	-	-	100,000.00	100,000.00
负债总计	-	-	-	1,672,967.11	1,672,967.11
利率敏感度缺口	169,019,583.52	-	-	1,030,438,014.76	1,199,457,598.28

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 2026 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（2025 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 2026 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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	680,682,915.12	86.07	1,032,110,981.87	86.05
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	680,682,915.12	86.07	1,032,110,981.87	86.05

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）

	业绩比较基准上升 5%的影响金额	18,091,000.00	27,845,000.00
	业绩比较基准下降 5%的影响金额	-18,091,000.00	-27,845,000.00

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	678,785,823.23	1,032,110,981.87
第二层次	-	-
第三层次	1,897,091.89	-
合计	680,682,915.12	1,032,110,981.87

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 2026 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（2025 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 2026 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	680,682,915.12	84.87
	其中：股票	680,682,915.12	84.87
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	50,507,383.01	6.30
8	其他各项资产	70,842,583.63	8.83
9	合计	802,032,881.76	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	—	—
B	采矿业	36,149.82	0.00
C	制造业	573,136,171.06	72.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,636,440.00	1.47
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	4,033,731.30	0.51
G	交通运输、仓储和邮政业	14,546,846.26	1.84
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,673,463.92	3.63
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	24,336,639.96	3.08
N	水利、环境和公共设施管理业	8,079,183.80	1.02
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	16,204,289.00	2.05
	合计	680,682,915.12	86.07

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

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	688648	中邮科技	355,411	12,990,272.05	1.64
2	300183	东软载波	1,163,500	12,158,575.00	1.54
3	300479	神思电子	878,800	11,898,952.00	1.50
4	300711	广哈通信	722,820	11,854,248.00	1.50
5	002383	合众思壮	1,743,900	11,841,081.00	1.50
6	002682	龙洲股份	2,769,845	11,744,142.80	1.49
7	300470	中密控股	404,700	11,740,347.00	1.48
8	603701	德宏股份	531,500	11,682,370.00	1.48
9	300004	南风股份	1,155,600	11,671,560.00	1.48
10	002339	积成电子	1,682,800	11,661,804.00	1.47
11	002765	蓝黛科技	1,673,100	11,644,776.00	1.47
12	002479	富春环保	2,764,000	11,636,440.00	1.47
13	603088	宁波精达	1,156,600	11,635,396.00	1.47
14	002449	国星光电	1,496,352	11,596,728.00	1.47
15	000532	华金资本	1,078,800	11,586,312.00	1.47
16	002692	远程股份	3,069,944	11,573,688.88	1.46
17	600135	乐凯胶片	1,445,800	11,551,942.00	1.46
18	300510	金冠股份	3,684,700	11,496,264.00	1.45
19	002066	瑞泰科技	549,884	11,454,083.72	1.45
20	600513	联环药业	786,600	11,437,164.00	1.45
21	002523	天桥起重	3,837,300	11,435,154.00	1.45
22	002112	三变科技	697,600	11,433,664.00	1.45
23	002278	神开股份	1,512,300	11,402,742.00	1.44
24	300402	宝色股份	768,900	11,387,409.00	1.44
25	600980	北矿科技	606,800	11,377,500.00	1.44
26	600262	北方股份	571,500	11,309,985.00	1.43

27	000852	石化机械	2,276,600	11,291,936.00	1.43
28	601177	杭齿前进	900,600	11,176,446.00	1.41
29	300927	江天化学	519,000	11,174,070.00	1.41
30	300278	华昌达	2,871,100	11,139,868.00	1.41
31	002136	安纳达	837,000	10,947,960.00	1.38
32	002783	凯龙股份	1,533,100	10,900,341.00	1.38
33	688722	同益中	688,583	10,445,804.11	1.32
34	603028	赛福天	1,438,200	9,305,154.00	1.18
35	300011	鼎汉技术	1,525,100	9,272,608.00	1.17
36	600784	鲁银投资	1,422,300	9,244,950.00	1.17
37	300600	国瑞科技	844,900	7,933,611.00	1.00
38	600714	金瑞矿业	386,200	7,928,686.00	1.00
39	600860	京城股份	943,500	7,774,440.00	0.98
40	603188	亚邦股份	1,758,500	6,963,660.00	0.88
41	688589	力合微	300,926	6,915,279.48	0.87
42	600992	贵绳股份	729,400	6,287,428.00	0.80
43	688269	凯立新材	182,937	5,800,932.27	0.73
44	600071	凤凰光学	338,600	5,800,218.00	0.73
45	600523	贵航股份	546,900	5,769,795.00	0.73
46	300797	钢研纳克	396,400	5,256,264.00	0.66
47	002933	新兴装备	198,526	5,131,897.10	0.65
48	002483	润邦股份	1,011,800	4,998,292.00	0.63
49	301058	中粮科工	630,000	4,901,400.00	0.62
50	688119	中钢洛耐	998,409	4,742,442.75	0.60
51	600668	尖峰集团	643,600	4,691,844.00	0.59
52	600805	悦达投资	1,145,900	4,617,977.00	0.58
53	600202	哈空调	1,024,300	4,588,864.00	0.58
54	600731	湖南海利	782,900	4,008,448.00	0.51
55	600495	晋西车轴	1,136,300	3,988,413.00	0.50
56	301020	密封科技	181,700	3,968,328.00	0.50
57	688571	杭华股份	452,600	3,960,250.00	0.50
58	000619	海螺新材	834,400	3,671,360.00	0.46
59	301289	国缆检测	77,696	3,652,488.96	0.46
60	301311	昆船智能	277,800	3,608,622.00	0.46
61	003008	开普检测	208,000	3,550,560.00	0.45
62	600099	林海股份	439,000	3,503,220.00	0.44
63	300958	建工修复	313,500	3,335,640.00	0.42
64	600468	百利电气	549,500	3,335,465.00	0.42
65	002722	物产金轮	272,740	3,215,604.60	0.41
66	688203	海正生材	310,100	3,094,798.00	0.39
67	301508	中机认检	131,700	3,047,538.00	0.39
68	600148	长春一东	205,600	2,983,256.00	0.38
69	002282	博深股份	498,000	2,803,740.00	0.35

70	603066	音飞储存	287,000	2,801,120.00	0.35
71	603860	中公高科	114,900	2,779,431.00	0.35
72	600223	福瑞达	541,700	2,724,751.00	0.34
73	600560	金自天正	240,300	2,662,524.00	0.34
74	600287	苏豪时尚	600,100	2,646,441.00	0.33
75	688015	交控科技	168,051	2,584,624.38	0.33
76	300425	中建环能	623,454	2,331,717.96	0.29
77	001278	一彬科技	122,000	1,876,360.00	0.24
78	300642	透景生命	146,100	1,723,980.00	0.22
79	300405	科隆股份	332,600	1,722,868.00	0.22
80	688613	奥精医疗	121,700	1,717,187.00	0.22
81	301036	双乐股份	76,000	1,666,680.00	0.21
82	300074	华平股份	486,600	1,654,440.00	0.21
83	002857	三晖电气	93,700	1,646,309.00	0.21
84	300610	晨化股份	167,700	1,635,075.00	0.21
85	688288	鸿泉技术	91,787	1,631,054.99	0.21
86	300150	世纪瑞尔	409,900	1,627,303.00	0.21
87	600768	宁波富邦	107,183	1,605,601.34	0.20
88	300112	万讯自控	259,100	1,603,829.00	0.20
89	301300	远翔新材	50,700	1,590,459.00	0.20
90	300823	建科智能	108,900	1,587,762.00	0.20
91	688118	普元信息	77,645	1,562,217.40	0.20
92	688013	天臣医疗	63,100	1,556,677.00	0.20
93	300615	欣天科技	155,000	1,554,650.00	0.20
94	300960	通业科技	99,900	1,553,445.00	0.20
95	002671	龙泉股份	416,600	1,545,586.00	0.20
96	300906	日月明	61,400	1,530,702.00	0.19
97	002817	黄山胶囊	260,700	1,527,702.00	0.19
98	300838	浙江力诺	114,400	1,527,240.00	0.19
99	301515	港通医疗	87,100	1,526,863.00	0.19
100	688393	安必平	85,800	1,525,524.00	0.19
101	301372	科净源	48,400	1,525,084.00	0.19
102	301131	聚赛龙	47,100	1,513,323.00	0.19
103	001336	楚环科技	68,400	1,506,168.00	0.19
104	301010	晶雪节能	91,500	1,490,535.00	0.19
105	300417	南华仪器	145,200	1,489,752.00	0.19
106	301539	宏鑫科技	113,091	1,481,492.10	0.19
107	002760	凤形股份	89,500	1,469,590.00	0.19
108	688021	奥福科技	75,300	1,457,808.00	0.18
109	002591	恒大高新	233,100	1,426,572.00	0.18
110	300971	博亚精工	76,300	1,423,758.00	0.18
111	688089	嘉必优	132,063	1,401,188.43	0.18
112	688244	永信至诚	97,300	1,387,498.00	0.18

113	000757	浩物股份	406,830	1,387,290.30	0.18
114	301063	海锅股份	80,600	1,350,856.00	0.17
115	301229	纽泰格	106,900	1,295,628.00	0.16
116	688113	联测科技	35,400	1,242,540.00	0.16
117	688459	哈铁科技	142,500	1,187,025.00	0.15
118	300929	华骐环保	103,800	1,094,052.00	0.14
119	688659	元琛科技	102,700	1,072,188.00	0.14
120	688355	明志科技	53,916	1,037,883.00	0.13
121	300549	优德精密	78,700	1,024,674.00	0.13
122	603029	天鹅股份	72,500	1,019,350.00	0.13
123	688058	宝兰德	47,212	987,675.04	0.12
124	688132	邦彦技术	75,000	986,250.00	0.12
125	300923	研奥股份	44,200	984,776.00	0.12
126	603282	亚光股份	68,800	981,776.00	0.12
127	301192	泰祥股份	50,500	954,450.00	0.12
128	300535	达威股份	69,700	950,011.00	0.12
129	300514	友讯达	101,500	949,025.00	0.12
130	688681	科汇股份	67,500	943,650.00	0.12
131	301065	本立科技	50,800	896,620.00	0.11
132	301298	东利机械	76,900	889,733.00	0.11
133	301519	舜禹股份	81,700	886,445.00	0.11
134	688329	艾隆科技	43,596	881,075.16	0.11
135	002890	弘宇股份	61,400	877,406.00	0.11
136	688565	力源科技	91,200	861,840.00	0.11
137	688067	爱威科技	41,496	836,144.40	0.11
138	300800	力合科技	88,700	820,475.00	0.10
139	300371	汇中股份	81,800	800,004.00	0.10
140	688695	中创股份	41,800	781,660.00	0.10
141	688296	和达科技	67,600	773,344.00	0.10
142	301006	迈拓股份	61,500	771,825.00	0.10
143	603041	美思德	73,200	759,084.00	0.10
144	301170	锡南科技	34,500	742,095.00	0.09
145	301601	惠通科技	45,900	716,958.00	0.09
146	301359	东南电子	44,000	698,720.00	0.09
147	688026	洁特生物	43,479	683,055.09	0.09
148	301353	普莱得	40,430	671,542.30	0.08
149	688395	正弦电气	29,800	658,580.00	0.08
150	688528	秦川物联	71,463	653,171.82	0.08
151	688369	致远互联	30,200	634,502.00	0.08
152	688701	卓锦股份	82,960	624,688.80	0.08
153	688466	金科环境	47,800	613,274.00	0.08
154	003017	大洋生物	25,200	579,600.00	0.07
155	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.07

156	688420	美腾科技	24,800	522,536.00	0.07
157	688060	云涌科技	13,700	450,593.00	0.06
158	300876	蒙泰高新	30,200	432,766.00	0.05
159	688137	近岸蛋白	12,000	432,000.00	0.05
160	301083	百胜智能	24,900	327,933.00	0.04
161	001255	博菲电气	12,900	323,661.00	0.04
162	688820	盛合晶微	2,080	294,299.20	0.04
163	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.03
164	001399	惠科股份	5,579	154,705.67	0.02
165	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.02
166	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
167	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.01
168	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01
169	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
170	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
171	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
172	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
173	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
174	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
175	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
176	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
177	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
178	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
179	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
180	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
181	688781	视涯科技	217	10,331.37	0.00
182	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
183	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
184	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
185	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
186	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
187	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
188	001220	世盟股份	57	1,583.46	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	300927	江天化学	89,832,057.56	7.49
2	600513	联环药业	79,319,987.57	6.61
3	600792	云煤能源	74,921,247.00	6.25
4	688323	瑞华泰	74,218,203.19	6.19
5	300981	中红医疗	71,833,183.70	5.99

6	300711	广哈通信	70,507,603.80	5.88
7	300004	南风股份	62,926,797.00	5.25
8	603088	宁波精达	57,038,601.00	4.76
9	002708	光洋股份	56,311,027.00	4.69
10	300540	蜀道装备	52,867,778.00	4.41
11	688456	有研粉材	52,640,615.60	4.39
12	002682	龙洲股份	51,894,646.85	4.33
13	002765	蓝黛科技	49,640,715.22	4.14
14	300697	电工合金	49,545,934.00	4.13
15	600860	京城股份	49,516,319.51	4.13
16	002297	博云新材	49,346,112.98	4.11
17	002449	国星光电	49,047,997.10	4.09
18	300278	华昌达	48,214,650.00	4.02
19	002339	积成电子	46,469,567.44	3.87
20	002692	远程股份	41,802,196.04	3.49
21	002160	常铝股份	41,436,108.00	3.45
22	600135	乐凯胶片	39,369,621.51	3.28
23	300479	神思电子	37,677,521.50	3.14
24	603028	赛福天	37,434,839.40	3.12
25	300219	鸿利智汇	36,075,153.00	3.01
26	002314	南山控股	35,881,922.00	2.99
27	002136	安纳达	35,782,886.00	2.98
28	300557	理工光科	34,881,436.08	2.91
29	688663	新风光	34,269,585.60	2.86
30	688722	同益中	34,159,196.28	2.85
31	002893	京能热力	34,116,515.00	2.84
32	300402	宝色股份	33,936,656.00	2.83
33	002278	神开股份	31,124,155.00	2.59
34	002933	新兴装备	30,955,695.54	2.58
35	603188	亚邦股份	30,291,150.00	2.53
36	300183	东软载波	29,432,559.00	2.45
37	688119	中钢洛耐	29,109,891.01	2.43
38	002066	瑞泰科技	28,952,514.96	2.41
39	002349	精华制药	28,739,250.00	2.40
40	002112	三变科技	28,542,384.67	2.38
41	000920	沃顿科技	28,327,918.00	2.36
42	000521	长虹美菱	28,050,892.72	2.34
43	000852	石化机械	27,897,437.89	2.33
44	600784	鲁银投资	27,033,547.00	2.25
45	300470	中密控股	25,360,713.12	2.11
46	002059	云南旅游	25,114,492.99	2.09
47	600262	北方股份	24,719,669.00	2.06

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	300927	江天化学	93,897,539.28	7.83
2	688323	瑞华泰	93,643,457.32	7.81
3	600513	联环药业	86,363,729.08	7.20
4	600792	云煤能源	75,607,270.50	6.30
5	300711	广哈通信	74,343,745.60	6.20
6	300981	中红医疗	73,379,073.53	6.12
7	300540	蜀道装备	69,725,228.01	5.81
8	300004	南风股份	67,240,654.00	5.61
9	603088	宁波精达	65,947,405.68	5.50
10	688456	有研粉材	64,013,346.71	5.34
11	600860	京城股份	58,375,530.24	4.87
12	300219	鸿利智汇	57,268,652.18	4.77
13	688663	新风光	56,467,073.05	4.71
14	002449	国星光电	56,320,571.47	4.70
15	002708	光洋股份	54,663,557.00	4.56
16	300697	电工合金	51,162,619.81	4.27
17	002297	博云新材	48,083,335.00	4.01
18	000920	沃顿科技	48,080,102.30	4.01
19	002669	康达新材	47,058,407.00	3.92
20	002349	精华制药	44,767,578.97	3.73
21	600367	红星发展	41,829,366.00	3.49
22	002059	云南旅游	40,987,693.04	3.42
23	002314	南山控股	40,884,526.60	3.41
24	002692	远程股份	40,816,577.00	3.40
25	002933	新兴装备	39,890,793.88	3.33
26	002068	黑猫股份	39,689,499.00	3.31
27	300479	神思电子	39,274,372.00	3.27
28	300557	理工光科	38,744,441.70	3.23
29	002160	常铝股份	37,998,162.00	3.17
30	300370	安控科技	37,962,181.40	3.16
31	600495	晋西车轴	37,135,323.30	3.10
32	000026	飞亚达	36,834,174.61	3.07
33	300278	华昌达	35,827,118.00	2.99
34	300402	宝色股份	35,427,548.00	2.95
35	000521	长虹美菱	35,091,251.75	2.93
36	600135	乐凯胶片	34,927,233.28	2.91
37	000852	石化机械	34,764,346.69	2.90
38	002682	龙洲股份	34,212,535.00	2.85

39	002339	积成电子	32,362,466.16	2.70
40	002765	蓝黛科技	32,319,708.16	2.69
41	002893	京能热力	31,243,980.76	2.60
42	300183	东软载波	30,399,855.64	2.53
43	688119	中钢洛耐	29,114,750.78	2.43
44	600262	北方股份	28,858,330.86	2.41
45	002445	中南文化	28,769,242.80	2.40
46	002066	瑞泰科技	28,651,859.00	2.39
47	600980	北矿科技	28,086,483.00	2.34
48	603188	亚邦股份	27,114,278.00	2.26
49	600379	宝光股份	26,678,349.42	2.22
50	002136	安纳达	26,406,009.00	2.20
51	600819	耀皮玻璃	26,024,131.99	2.17
52	601177	杭齿前进	24,523,261.30	2.04
53	600668	尖峰集团	24,517,667.41	2.04
54	601789	宁波建工	24,459,914.78	2.04

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	3,440,133,351.78
卖出股票收入（成交）总额	3,708,452,762.35

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

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约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	69,978,093.16
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	864,490.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	70,842,583.63

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 专精特新 量化选股 混合 A	4,729	100,209.03	24,265,339.88	5.12	449,623,160.23	94.88
西部利得 专精特新 量化选股 混合 C	6,043	67,950.70	8,207,835.88	2.00	402,418,253.13	98.00
合计	10,596	83,476.27	32,473,175.76	3.67	852,041,413.36	96.33

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	西部利得专精特新量化选股 混合 A	332,387.38	0.0701
	西部利得专精特新量化选股 混合 C	251,012.03	0.0611
	合计	583,399.41	0.0660

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	西部利得专精特新量化选 股混合 A	0~10
	西部利得专精特新量化选	10~50

放式基金	股混合 C	
	合计	10~50
本基金基金经理持有 本开放式基金	西部利得专精特新量化选 股混合 A	10~50
	西部利得专精特新量化选 股混合 C	-
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	西部利得专精特新量化选股混合 A	西部利得专精特新量化选股混合 C
基金合同生效日 (2025 年 11 月 18 日) 基金份额总额	650,672,244.40	522,295,262.12
本报告期期初基金 份额总额	650,672,244.40	522,295,262.12
本报告期基金总申 购份额	455,721,330.50	452,787,363.83
减：本报告期基金 总赎回份额	632,505,074.79	564,456,536.94
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	473,888,500.11	410,626,089.01

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五十一次会议决议，自 2026 年 4 月 23 日起聘任王汗青担任公司总经理，董事长何方不再代为履行公司总经理职务。

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、基金财产的诉讼事项；本报告期内，本基金托管人

不涉及公募基金托管业务的诉讼。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	3	6,308,307,764.96	88.27	2,812,915.96	88.45	-
东方证券	3	838,110,890.24	11.73	367,418.17	11.55	-

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) 研究服务指标，包括证券公司的研究资源评估、研究能力评估、研究合规性持续评估等。选择程序主要如下：基于上述评估指标，公司定期开展券商准入评估，结合负面剔除情形，形成研究服务准入白名单，公司对进入研究服务准入白名单的券商进行券结业务准入评估，通过评估的券商可开展基金产品券商交易模式下的业务合作，签订经纪服务相关协议。

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 2026 年 1 月 1 日-

2026 年 6 月 30 日。

3. 本基金采用券商交易结算模式。本基金选择的证券经纪商为东方证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司，以上证券经纪商与本基金均不存在关联方关系。

4. 证券经营机构的佣金费率如下：

东方证券股份有限公司：沪深交易所股票交易佣金费率为 0.05%（含费），北交所股票交易佣金费率为 0.042%，港股通股票交易佣金费率为 0.042%，基金交易佣金费率为 0.05%，债券交易佣金费率为 0.001%，可转换债交易佣金费率为 0.005%，债券回购交易佣金费率按品种列示如下：1 天期 0.001%，2 天期 0.002%，3 天期 0.003%，4 天期 0.004%，7 天期 0.005%，14 天期 0.01%，28 天期 0.02%，91 天期 0.03%，182 天期 0.03%。

浙商证券股份有限公司：沪深交易所股票佣金费率为 0.05%（含费），北交所股票交易佣金费率为 0.0365%，港股通股票交易佣金费率为 0.042%，基金交易佣金费率为 0.05%，债券交易佣金费率为 0.001%，可转换债交易佣金费率为 0.005%，国债回购交易佣金费率按品种列示如下：1 天期 0.001%，2 天期 0.002%，3 天期 0.003%，4 天期 0.004%，7 天期 0.005%，14 天期 0.01%，28 天期 0.02%，91 天期 0.03%，182 天期 0.03%。

10.7.2 基金租用或者通过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	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	西部利得基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	基金管理人公司网站、中国证监会基金电子披露网站及本基金选定的信息披露报纸	2026 年 4 月 23 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

2026 年 8 月 28 日