

# 西部利得中证同业存单 AAA 指数 7 天持有 期证券投资基金 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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通银行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

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| 3.3 其他指标                                | 7         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>7</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 7         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 8         |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 8         |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 9         |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 10        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 10        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 10        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 10        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>10</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 10        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 11        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 11        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>11</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 11        |
| 6.2 利润表                                 | 12        |
| 6.3 净资产变动表                              | 14        |
| 6.4 报表附注                                | 16        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>33</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 33        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 34        |
| 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       | 34        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 34        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 34        |
| 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      | 34        |
| 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   | 35        |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 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 ..... | 35        |
| 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 .....    | 35        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                   | 35        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 35        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                         | 35        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>36</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 36        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 36        |
| 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 .....      | 36        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>37</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>37</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 37        |
| 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 .....      | 37        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 37        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 37        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 37        |
| 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....          | 37        |
| 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 .....      | 38        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 39        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>39</b> |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....    | 39        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 39        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>39</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 39        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 39        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 39        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                                |
|------------|--------------------------------|
| 基金名称       | 西部利得中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 |
| 基金简称       | 西部利得同业存单指数 7 天持有               |
| 基金主代码      | 021748                         |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                         |
| 基金合同生效日    | 2024 年 9 月 3 日                 |
| 基金管理人      | 西部利得基金管理有限公司                   |
| 基金托管人      | 交通银行股份有限公司                     |
| 报告期末基金份额总额 | 44,957,390.84 份                |
| 基金合同存续期    | 不定期                            |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金采用指数化投资，密切跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 投资策略   | <p>本基金为指数型基金，采用抽样复制和动态最优化的方法为主，选取标的指数成份券和备选成份券中流动性较好的同业存单，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的有效跟踪。</p> <p>在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.20%，将年化跟踪误差控制在 2% 以内。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪误差进一步扩大。</p> <p>当标的指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。</p> <p>（详见《基金合同》）</p> |
| 业绩比较基准 | 中证同业存单 AAA 指数收益率 $\times$ 95%+银行人民币一年定期存款利率（税后） $\times$ 5%                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 风险收益特征 | <p>本基金风险与收益低于股票型基金、偏股混合型基金，高于货币市场基金。</p> <p>本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。</p>                                                                                                                                                                                                                                                    |

### 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             | 交通银行股份有限公司            |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 赵毅                       | 方圆                    |
|         | 联系电话 | 021-38572888             | 95559                 |
|         | 电子邮箱 | service@westleadfund.com | fangy_20@bankcomm.com |
| 客户服务电话  |      | 4007-007-818             | 95559                 |

|       |                                        |                             |
|-------|----------------------------------------|-----------------------------|
| 传真    | 021-50710261                           | 021-62701216                |
| 注册地址  | 中国（上海）自由贸易试验区耀<br>体路 276 号 901 室-908 室 | 中国（上海）自由贸易试验区<br>银城中路 188 号 |
| 办公地址  | 中国（上海）自由贸易试验区耀<br>体路 276 号 901 室-908 室 | 中国（上海）长宁区仙霞路 18<br>号        |
| 邮政编码  | 200126                                 | 200336                      |
| 法定代表人 | 何方                                     | 任德奇                         |

## 2.4 信息披露方式

|                   |                                             |
|-------------------|---------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称    | 《上海证券报》                                     |
| 登载基金中期报告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<br>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<br>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) |
|------------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益          | 226,658.22                          |
| 本期利润             | 238,855.83                          |
| 加权平均基金份额本期利<br>润 | 0.0052                              |
| 本期加权平均净值利润率      | 0.51%                               |
| 本期基金份额净值增长率      | 0.51%                               |
| 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         | 996,174.40                          |
| 期末可供分配基金份额利<br>润 | 0.0222                              |
| 期末基金资产净值         | 45,953,565.24                       |
| 期末基金份额净值         | 1.0222                              |
| 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      | 2.22%                               |

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）。

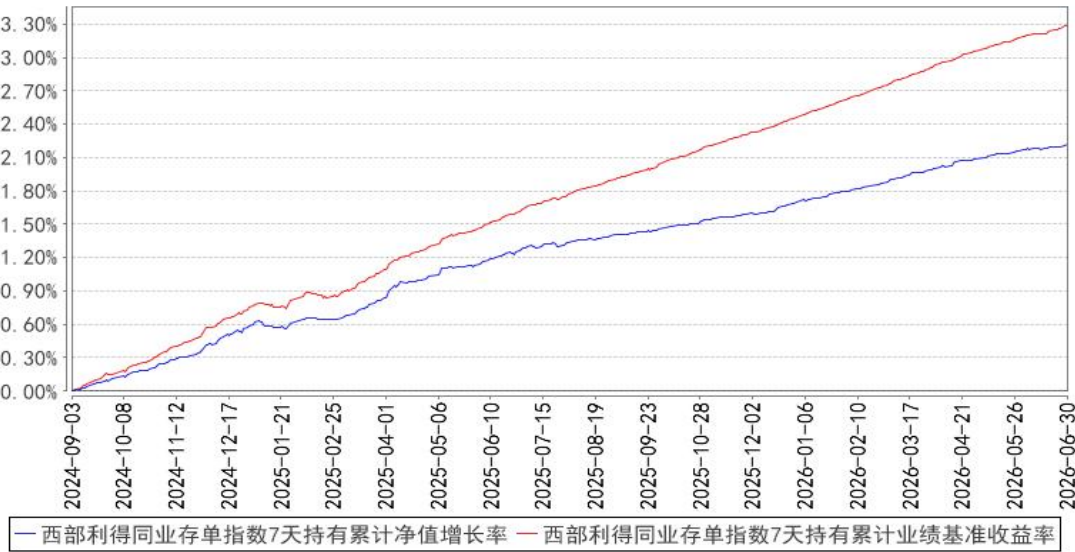
3.2 基金净值表现

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

| 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      | 0.23%    | 0.01%       | 0.37%      | 0.00%         | -0.14% | 0.01% |
| 过去六个月      | 0.51%    | 0.01%       | 0.80%      | 0.01%         | -0.29% | 0.00% |
| 过去一年       | 0.95%    | 0.01%       | 1.65%      | 0.01%         | -0.70% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.22%    | 0.01%       | 3.29%      | 0.01%         | -1.07% | 0.00% |

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

西部利得同业存单指数7天持有累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.3 其他指标

无

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

西部利得基金管理有限公司于 2010 年 7 月 20 日正式成立，公司总部设在上海，在北京、深圳设有分公司，是经中国证监会批准设立的第 60 家全国规范性基金管理公司。目前公司具有公募基金、特定客户资产管理、受托管理保险资金、合格境内机构投资者资格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 |        |                                                                                                                 |
| 刘心峰 | 利率投资部总经理、基金经理 | 2024 年 9 月 3 日   | —    | 14 年   | 英国曼彻斯特大学数量金融专业硕士。曾任中德安联人寿保险有限公司交易员、华泰柏瑞基金管理有限公司交易员。2016 年 11 月加入本公司，具有基金从业资格，中国国籍。                              |
| 李烨  | 基金经理          | 2024 年 10 月 30 日 | —    | 10 年   | 上海交通大学工商管理专业学士。曾任上海体验企业管理咨询有限公司课程顾问、法纳通电器(上海)有限公司投资部银行间固定收益交易员、上海锡科斯人力资源有限公司猎头顾问。2016 年 5 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

2026 年上半年，我国经济在复杂严峻的内外部环境下顶压前行、向新向优发展，国民经济运行在合理区间。投资方面，结构持续优化，“两重”建设扎实推进，高技术服务业与制造业投资保持较快增长，新兴领域成为投资主要流向。消费方面，提振消费专项行动成效显著，市场规模稳步扩大，服务消费增势尤为突出，升级类商品消费较快增长。进出口方面，外贸增长强劲，货物贸易规模再创新高，出口结构向高技术、自主品牌方向升级，对共建“一带一路”国家和拉美、非洲等新兴市场进出口增长亮眼。政策方面，财政政策实施更加积极有力，货币政策保持适度宽松，央行灵活运用结构性工具维持流动性合理充裕。报告期内债券市场在地缘冲突升温、国内经济温和复苏、流动性超预期宽松等多方面影响下，整体走出震荡偏强行情，10 年期国债活跃券收益率在 1.70%-1.90% 区间内震荡下行。

本基金在报告期内采用稳健的投资策略，在对指数成分跟踪的策略的基础上，灵活调整组合的久期和杠杆水平，努力把握市场交易机会，在保持流动性安全的基础上，努力为投资者获得稳定的收益。衷心感谢持有人的支持，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

展望下半年，我国经济或有望延续稳中向好态势。投资端，重点工程落地与设备更新改造有望带动投资稳步扩量，高科技行业高景气度下制造业投资维持韧性。消费有望温和复苏，服务消费内生动力持续释放。出口或仍将保持一定韧性。积极的财政政策在实施上有望更加精准有效，专项债、超长期特别国债或将加速发行，货币政策或将继续保持适度宽松、灵活高效。债券市场预计将面临供给扰动、风险偏好波动、流动性环境变化等多重影响，或延续震荡格局。

#### 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及适用性的情况，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的情形。

本报告期内，本基金出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，时间段为 2026 年 1 月 6 日至 2026 年 3 月 27 日和 2026 年 4 月 29 日至 2026 年 6 月 12 日。

### § 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，基金托管人在西部利得中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

## 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西部利得中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由西部利得基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关西部利得中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、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：西部利得中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|-------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资 产：</b> |         |                        |                          |
| 货币资金        | 6.4.7.1 | 2,569,907.66           | 204,595.81               |
| 结算备付金       |         | —                      | —                        |
| 存出保证金       |         | —                      | 113.04                   |
| 交易性金融资产     | 6.4.7.2 | 43,375,523.51          | 51,721,383.96            |
| 其中：股票投资     |         | —                      | —                        |
| 基金投资        |         | —                      | —                        |
| 债券投资        |         | 43,375,523.51          | 51,721,383.96            |
| 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       |         | 50,015.00              | 219.70                   |

|               |            |                                |                                  |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 递延所得税资产       |            | -                              | -                                |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                              | -                                |
| 资产总计          |            | 45,995,446.17                  | 51,926,312.51                    |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2026 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2025 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>   |            |                                |                                  |
| 短期借款          |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债       |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债        | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款     |            | -                              | -                                |
| 应付清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款         |            | -                              | -                                |
| 应付管理人报酬       |            | 8,039.98                       | 8,758.18                         |
| 应付托管费         |            | 2,010.01                       | 2,189.57                         |
| 应付销售服务费       |            | 8,039.98                       | 8,758.18                         |
| 应付投资顾问费       |            | -                              | -                                |
| 应交税费          |            | -                              | 147.75                           |
| 应付利润          |            | -                              | -                                |
| 递延所得税负债       |            | -                              | -                                |
| 其他负债          | 6.4.7.9    | 23,790.96                      | 154,842.57                       |
| 负债合计          |            | 41,880.93                      | 174,696.25                       |
| <b>净资产：</b>   |            |                                |                                  |
| 实收基金          | 6.4.7.10   | 44,957,390.84                  | 50,885,373.69                    |
| 其他综合收益        | 6.4.7.11   | -                              | -                                |
| 未分配利润         | 6.4.7.12   | 996,174.40                     | 866,242.57                       |
| 净资产合计         |            | 45,953,565.24                  | 51,751,616.26                    |
| 负债和净资产总计      |            | 45,995,446.17                  | 51,926,312.51                    |

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0222 元，基金份额总额 44,957,390.84 份。

6.2 利润表

会计主体：西部利得中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025<br>年 6 月 30 日 |
|----------------|----------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b> |          | 383,619.52                               | 1,969,123.11                                  |
| 1. 利息收入        |          | 3,728.87                                 | 149,192.13                                    |
| 其中：存款利息收入      | 6.4.7.13 | 3,728.87                                 | 5,092.17                                      |
| 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                 |            | -          | 144,099.96   |
| 其他利息收入                     |            | -          | -            |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |            | 367,693.04 | 2,147,777.26 |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.14   | -          | -            |
| 基金投资收益                     |            | -          | -            |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.15   | 367,693.04 | 2,147,777.26 |
| 资产支持证券投资                   | 6.4.7.16   | -          | -            |
| 收益                         |            |            |              |
| 贵金属投资收益                    | 6.4.7.17   | -          | -            |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.18   | -          | -            |
| 股利收益                       | 6.4.7.19   | -          | -            |
| 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   | 12,197.61  | -327,846.28  |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -          | -            |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 6.4.7.21   | -          | -            |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 144,763.69 | 696,669.56   |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 46,921.52  | 212,769.15   |
| 其中：暂估管理人报酬                 |            | -          | -            |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 11,730.30  | 53,192.29    |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 46,921.52  | 212,769.15   |
| 4. 投资顾问费                   |            | -          | -            |
| 5. 利息支出                    |            | 21,475.17  | 119,396.03   |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 21,475.17  | 119,396.03   |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.22   | -          | -            |
| 7. 税金及附加                   |            | -          | 1,591.66     |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.23   | 17,715.18  | 96,951.28    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 238,855.83 | 1,272,453.55 |
| 减：所得税费用                    |            | -          | -            |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 238,855.83 | 1,272,453.55 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -          | -            |

|          |  |            |              |
|----------|--|------------|--------------|
| 六、综合收益总额 |  | 238,855.83 | 1,272,453.55 |
|----------|--|------------|--------------|

### 6.3 净资产变动表

会计主体：西部利得中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

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<br>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                                | 50,885,373.69                         | -      | 866,242.57    | 51,751,616.26  |
| 加：会计政策变更                                 | -                                     | -      | -             | -              |
| 前期差错更正                                   | -                                     | -      | -             | -              |
| 其他                                       | -                                     | -      | -             | -              |
| 二、本期期初净资产                                | 50,885,373.69                         | -      | 866,242.57    | 51,751,616.26  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -5,927,982.85                         | -      | 129,931.83    | -5,798,051.02  |
| (一)、综合收益总额                               | -                                     | -      | 238,855.83    | 238,855.83     |
| (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)      | -5,927,982.85                         | -      | -108,924.00   | -6,036,906.85  |
| 其中：1. 基金申购款                              | 72,680,377.86                         | -      | 1,495,935.62  | 74,176,313.48  |
| 2. 基金赎回款                                 | -78,608,360.71                        | -      | -1,604,859.62 | -80,213,220.33 |
| (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                                | 44,957,390.84                         | -      | 996,174.40    | 45,953,565.24  |

| 项目                                       | 上年度可比期间<br>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                                | 317,193,929.07                             | -      | 1,885,583.96  | 319,079,513.03  |
| 加：会计政策变更                                 | -                                          | -      | -             | -               |
| 前期差错更正                                   | -                                          | -      | -             | -               |
| 其他                                       | -                                          | -      | -             | -               |
| 二、本期期初净资产                                | 317,193,929.07                             | -      | 1,885,583.96  | 319,079,513.03  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -<br>203,832,761.99                        | -      | -456,854.56   | -204,289,616.55 |
| (一)、综合收益总额                               | -                                          | -      | 1,272,453.55  | 1,272,453.55    |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数<br>(净资产减少以“-”号填列)  | -<br>203,832,761.99                        | -      | -1,729,308.11 | -205,562,070.10 |
| 其中：1. 基金申购款                              | 492,516,888.65                             | -      | 4,272,888.04  | 496,789,776.69  |
| 2. 基金赎回款                                 | -<br>696,349,650.64                        | -      | -6,002,196.15 | -702,351,846.79 |
| (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                                | 113,361,167.08                             | -      | 1,428,729.40  | 114,789,896.48  |

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

西部利得中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2024]907 号《关于准予西部利得中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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《西部利得中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,558,035,787.05 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 2400377 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《西部利得中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》于 2024 年 9 月 3 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,558,488,070.41 份基金份额,其中认购资金利息折合 452,283.36 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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《西部利得中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数的成份券及备选成份券。为更好地实现投资目标,本基金还可投资于非属成份券及备选成份券的其他同业存单、债券(包括国债、地方政府债券、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、政府支持债券、政府支持机构债券等)、短期融资券(含超短期融资券)、中期票据等非金融企业债务融资工具、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、现金等货币市场工具等,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)。本基金不投资于股票,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。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,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金投资于同业存单的比例不低于基金资产的 80%;本基金投资于标的指数成份券及其备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的 80%;本基金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、应收申购款等。如法律法规或监管机构变更上述投资品种的比例限制,在履行适当

程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

本基金的标的指数为中证同业存单 AAA 指数，由中证指数有限公司编制发布。

本基金的业绩比较基准为：中证同业存单 AAA 指数收益率 $\times$ 95%+银行人民币一年定期存款利率（税后） $\times$ 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 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 [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 号文《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[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，包括买卖债券的差价收入，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) 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<br>2026 年 6 月 30 日 |
|--------|------------------------|
| 活期存款   | 2,569,907.66           |
| 等于：本金  | 2,569,119.40           |
| 加：应计利息 | 788.26                 |
| 减：坏账准备 | -                      |
| 定期存款   | -                      |
| 等于：本金  | -                      |

|                |              |
|----------------|--------------|
| 加：应计利息         | -            |
| 减：坏账准备         | -            |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -            |
| 存款期限 1-3 个月    | -            |
| 存款期限 3 个月以上    | -            |
| 其他存款           | -            |
| 等于：本金          | -            |
| 加：应计利息         | -            |
| 减：坏账准备         | -            |
| 合计             | 2,569,907.66 |

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<br>2026 年 6 月 30 日 |            |               |          |
|---------------|-------|------------------------|------------|---------------|----------|
|               |       | 成本                     | 应计利息       | 公允价值          | 公允价值变动   |
| 股票            |       | -                      | -          | -             | -        |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                      | -          | -             | -        |
| 债券            | 交易所市场 | -                      | -          | -             | -        |
|               | 银行间市场 | 42,953,737.50          | 416,373.51 | 43,375,523.51 | 5,412.50 |
|               | 合计    | 42,953,737.50          | 416,373.51 | 43,375,523.51 | 5,412.50 |
| 资产支持证券        |       | -                      | -          | -             | -        |
| 基金            |       | -                      | -          | -             | -        |
| 其他            |       | -                      | -          | -             | -        |
| 合计            |       | 42,953,737.50          | 416,373.51 | 43,375,523.51 | 5,412.50 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明**

无。

**6.4.7.5 债权投资****6.4.7.5.1 债权投资情况**

本基金本报告期末未持有债权投资。

**6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

本基金本报告期末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<br>2026 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | —                      |
| 应付赎回费       | —                      |
| 应付证券出借违约金   | —                      |
| 应付交易费用      | 6,799.39               |
| 其中：交易所市场    | —                      |
| 银行间市场       | 6,799.39               |
| 应付利息        | —                      |
| 预提费用        | 16,991.57              |
| 合计          | 23,790.96              |

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>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          | 50,885,373.69                         | 50,885,373.69  |
| 本期申购          | 72,680,377.86                         | 72,680,377.86  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -78,608,360.71                        | -78,608,360.71 |
| 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           | 44,957,390.84                         | 44,957,390.84  |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

## 6.4.7.11 其他综合收益

无。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分      | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|------------|---------------|
| 上年度末           | 914,313.03    | -48,070.46 | 866,242.57    |
| 加：会计政策变更       | -             | -          | -             |
| 前期差错更正         | -             | -          | -             |
| 其他             | -             | -          | -             |
| 本期期初           | 914,313.03    | -48,070.46 | 866,242.57    |
| 本期利润           | 226,658.22    | 12,197.61  | 238,855.83    |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -110,314.36   | 1,390.36   | -108,924.00   |
| 其中：基金申购款       | 1,560,522.93  | -64,587.31 | 1,495,935.62  |
| 基金赎回款          | -1,670,837.29 | 65,977.67  | -1,604,859.62 |
| 本期已分配利润        | -             | -          | -             |
| 本期末            | 1,030,656.89  | -34,482.49 | 996,174.40    |

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
|           |                                       |
| 活期存款利息收入  | 3,728.75                              |
| 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 | -                                     |
| 其他        | 0.12                                  |

|    |          |
|----|----------|
| 合计 | 3,728.87 |
|----|----------|

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

本基金本报告期无股票投资收益。

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无买卖股票差价收入。

##### 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<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 410,113.55                 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -42,420.51                 |
| 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                           | 367,693.04                 |

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 64,975,371.15              |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 64,088,399.11              |
| 减：应计利息总额               | 923,163.55                 |
| 减：交易费用                 | 6,229.00                   |
| 买卖债券差价收入               | -42,420.51                 |

##### 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**

本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

**6.4.7.19 股利收益**

本基金本报告期无股利收益。

**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 | 12,197.61                       |
| 股票投资       | -                               |
| 债券投资       | 12,197.61                       |

|                        |           |
|------------------------|-----------|
| 资产支持证券投资               | -         |
| 基金投资                   | -         |
| 贵金属投资                  | -         |
| 其他                     | -         |
| 2. 衍生工具                | -         |
| 权证投资                   | -         |
| 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                     | 12,197.61 |

#### 6.4.7.21 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用    | 3,887.63                              |
| 信息披露费   | 9,424.74                              |
| 证券出借违约金 | -                                     |
| 账户维护费   | 4,402.81                              |
| 合计      | 17,715.18                             |

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

**6.4.10.1.2 债券交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

**6.4.10.1.4 权证交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 46,921.52                             | 212,769.15                                 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 17,722.63                             | 86,798.10                                  |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 29,198.89                             | 125,971.05                                 |

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 0.20% 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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

|                | 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 11,730.30                       | 53,192.29                       |

注：支付基金托管人交通银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

#### 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                                   |
|----------------|--------------------------------------|
|                | 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<br>西部利得同业存单指数 7 天持有 |
| 交通银行股份有限公司     | 14,860.31                            |
| 西部利得基金管理有限公司   | 0.34                                 |
| 西部证券股份有限公司     | -                                    |
| 合计             | 14,860.65                            |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间                              |
|                | 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<br>西部利得同业存单指数 7 天持有 |
| 交通银行股份有限公司     | 88,451.74                            |
| 西部利得基金管理有限公司   | 1.11                                 |
| 西部证券股份有限公司     | 46.85                                |
| 合计             | 88,499.70                            |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日-基金资产净值 0.2% 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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日该类基金份额的资产净值} \times 0.2\% / \text{当年天数}。$$

#### 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

本报告期及上年度可比区间内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月<br>30 日 |          | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 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   |
| 交通银行股份有限公司 | 2,569,907.66                             | 3,728.75 | 844,487.38                                 | 5,090.38 |

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人交通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“交通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 2026 年 06 月 30 日的相关余额为人民币 0.00 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

本报告期内，本基金在迷你期间如涉及信息披露费、审计费等固定费用的，上述费用由基金管理人承担，不再从基金资产中列支。除前述事项外，本基金本报告期内及上年度可比期间均无需作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

#### 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

本基金本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

##### 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同责任，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同业存单投资**

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | —                      | —                        |
| A-1 以下 | —                      | —                        |
| 未评级    | 40,328,079.95          | 46,642,173.00            |
| 合计     | 40,328,079.95          | 46,642,173.00            |

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

**6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | —                      | 2,055,104.11             |
| AAA 以下 | —                      | —                        |
| 未评级    | 3,047,443.56           | 3,024,106.85             |
| 合计     | 3,047,443.56           | 5,079,210.96             |

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。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<br>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                   | 2,569,907.66  | -     | -     | -         | 2,569,907.66  |
| 交易性金融资产                | 43,375,523.51 | -     | -     | -         | 43,375,523.51 |
| 应收申购款                  | -             | -     | -     | 50,015.00 | 50,015.00     |
| 资产总计                   | 45,945,431.17 | -     | -     | 50,015.00 | 45,995,446.17 |
| 负债                     |               |       |       |           |               |
| 应付管理人报酬                | -             | -     | -     | 8,039.98  | 8,039.98      |
| 应付托管费                  | -             | -     | -     | 2,010.01  | 2,010.01      |
| 应付销售服务费                | -             | -     | -     | 8,039.98  | 8,039.98      |
| 其他负债                   | -             | -     | -     | 23,790.96 | 23,790.96     |

|                          |               |       |       |             |               |
|--------------------------|---------------|-------|-------|-------------|---------------|
| 负债总计                     | -             | -     | -     | 41,880.93   | 41,880.93     |
| 利率敏感度缺口                  | 45,945,431.17 | -     | -     | 8,134.07    | 45,953,565.24 |
| 上年度末<br>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                     | 204,595.81    | -     | -     | -           | 204,595.81    |
| 存出保证金                    | 113.04        | -     | -     | -           | 113.04        |
| 交易性金融资产                  | 51,721,383.96 | -     | -     | -           | 51,721,383.96 |
| 应收申购款                    | -             | -     | -     | 219.70      | 219.70        |
| 资产总计                     | 51,926,092.81 | -     | -     | 219.70      | 51,926,312.51 |
| 负债                       |               |       |       |             |               |
| 应付管理人报酬                  | -             | -     | -     | 8,758.18    | 8,758.18      |
| 应付托管费                    | -             | -     | -     | 2,189.57    | 2,189.57      |
| 应付销售服务费                  | -             | -     | -     | 8,758.18    | 8,758.18      |
| 应交税费                     | -             | -     | -     | 147.75      | 147.75        |
| 其他负债                     | -             | -     | -     | 154,842.57  | 154,842.57    |
| 负债总计                     | -             | -     | -     | 174,696.25  | 174,696.25    |
| 利率敏感度缺口                  | 51,926,092.81 | -     | -     | -174,476.55 | 51,751,616.26 |

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

|    |                     |                             |                        |
|----|---------------------|-----------------------------|------------------------|
| 假设 | 除市场利率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） |
|    | 市场利率上升 25 基点        | -31,000.00                  | -61,000.00             |
|    | 市场利率下降 25 基点        | 31,000.00                   | 61,000.00              |

#### 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。本基金主要投资于固定收益类金融工具，主要风险为

利率风险和信用风险，其他的市场因素对本基金资产净值无重大影响，因此无重大其他价格风险。

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<br>2026 年 6 月 30 日 |                  | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |                  |
|---------------|------------------------|------------------|--------------------------|------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产净值<br>比例（%） | 公允价值                     | 占基金资产净值<br>比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资  | —                      | —                | —                        | —                |
| 交易性金融资产—基金投资  | —                      | —                | —                        | —                |
| 交易性金融资产—债券投资  | 43,375,523.51          | 94.39            | 51,721,383.96            | 99.94            |
| 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            | 43,375,523.51          | 94.39            | 51,721,383.96            | 99.94            |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金主要投资于固定收益类金融工具，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2025 年 12 月 31 日：同）。

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：<br><br>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；<br><br>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；<br><br>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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
|---------------|------------------------|--------------------------|

|      |               |               |
|------|---------------|---------------|
| 第一层次 | -             | -             |
| 第二层次 | 43,375,523.51 | 51,721,383.96 |
| 第三层次 | -             | -             |
| 合计   | 43,375,523.51 | 51,721,383.96 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 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<br>(%) |
|----|-------------------|---------------|------------------|
| 1  | 权益投资              | -             | -                |
|    | 其中：股票             | -             | -                |
| 2  | 基金投资              | -             | -                |
| 3  | 固定收益投资            | 43,375,523.51 | 94.30            |
|    | 其中：债券             | 43,375,523.51 | 94.30            |
|    | 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      | 2,569,907.66  | 5.59             |
| 8  | 其他各项资产            | 50,015.00     | 0.11             |
| 9  | 合计                | 45,995,446.17 | 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

本基金本报告期末未持有境内股票。

### 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

## 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

本基金本报告期末投资股票。

### 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

本基金本报告期末投资股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末投资股票。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -             | -            |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 3,047,443.56  | 6.63         |
|    | 其中：政策性金融债 | 3,047,443.56  | 6.63         |
| 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      | 40,328,079.95 | 87.76        |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 43,375,523.51 | 94.39        |

## 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<br>(张) | 公允价值         | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|-----------|------------------|-----------|--------------|------------------|
| 1  | 112506228 | 25 交通银行<br>CD228 | 40,000    | 3,998,099.69 | 8.70             |
| 2  | 112602114 | 26 工商银行<br>CD114 | 40,000    | 3,973,019.74 | 8.65             |

|   |           |                  |        |              |      |
|---|-----------|------------------|--------|--------------|------|
| 3 | 09240422  | 24 农发清发<br>22    | 30,000 | 3,047,443.56 | 6.63 |
| 4 | 112511058 | 25 平安银行<br>CD058 | 30,000 | 2,999,252.53 | 6.53 |
| 5 | 112504042 | 25 中国银行<br>CD042 | 30,000 | 2,998,418.63 | 6.52 |

## 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

股指期货不在本基金投资范围内。

## 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中，交通银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、中国农业发展银行、平安银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、中信银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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 | -         |
| 2  | 应收清算款 | -         |
| 3  | 应收股利  | -         |
| 4  | 应收利息  | -         |
| 5  | 应收申购款 | 50,015.00 |
| 6  | 其他应收款 | -         |
| 7  | 待摊费用  | -         |
| 8  | 其他    | -         |
| 9  | 合计    | 50,015.00 |

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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 (%) |
| 703          | 63,950.77     | 7,200,041.66 | 16.02      | 37,757,349.18 | 83.98      |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数<br>(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 | 1,079.89      | 0.0024       |

### 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

本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金基金经理未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                   |                  |
|-----------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2024 年 9 月 3 日）<br>基金份额总额 | 2,558,488,070.41 |
| 本报告期期初基金份额总额                      | 50,885,373.69    |
| 本报告期基金总申购份额                       | 72,680,377.86    |
| 减：本报告期基金总赎回份额                     | 78,608,360.71    |
| 本报告期基金拆分变动份额                      | —                |
| 本报告期末基金份额总额                       | 44,957,390.84    |

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、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

本报告期内托管人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

本报告期内托管人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 (%) |    |
| 长江证券  | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 国联民生  | 1      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 太平洋证券 | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 天风证券  | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |

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，对于进入研究服务准入白名单且综合研究服务能力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 2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日。

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 (%) |
| 长江证券 | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 国联民生 | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |

|           |   |   |   |   |   |   |
|-----------|---|---|---|---|---|---|
| 太平洋<br>证券 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证<br>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