

西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基
金
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：西部利得基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 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、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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 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。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	9
3.3 其他指标	12
3.4 过去三年基金的利润分配情况	12
§ 4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	60
8.1 期末基金资产组合情况	60

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	61
8.3 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	62
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	78
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	83
8.6 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	83
8.7 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	83
8.8 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	83
8.9 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	83
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	83
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	83
8.12 投资组合报告附注	83
§ 9 基金份额持有人信息	84
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	84
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	85
9.3 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	85
§ 10 开放式基金份额变动	85
§ 11 重大事件揭示	86
11.1 基金份额持有人大会决议	86
11.2 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	86
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	86
11.4 基金投资策略的改变	86
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	86
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	86
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	86
11.8 其他重大事件	88
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	88
12.1 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	88
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	88
§ 13 备查文件目录	88
13.1 备查文件目录	88
13.2 存放地点	89
13.3 查阅方式	89

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金	
基金简称	西部利得沪深 300 指数	
基金主代码	673100	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 12 月 27 日	
基金管理人	西部利得基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	631,080,424.22 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	西部利得沪深 300 指数 A	西部利得沪深 300 指数 C
下属分级基金的交易代码	673100	673101
报告期末下属分级基金的份额总额	409,957,590.46 份	221,122,833.76 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

客户服务电话	4007-007-818	95511-3
传真	021-50710261	0755-82080387
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区耀 体路 276 号 901 室-908 室	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区耀 体路 276 号 901 室-908 室	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座
邮政编码	200126	518001
法定代表人	何方	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.westleadfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人处——上海市浦东新区耀体路 276 号 晶耀商务广场 3 号楼 9 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所 （特殊普通合伙）	北京市长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2023 年		2022 年		2021 年	
	西部利得沪 深 300 指数 A	西部利得沪 深 300 指数 C	西部利得沪 深 300 指数 A	西部利得沪 深 300 指数 C	西部利得沪 深 300 指数 A	西部利得沪 深 300 指数 C
本期已实现收益	- 33,733,853 .91	- 27,930,127 .97	- 129,485,17 3.52	- 103,960,47 6.08	39,900,555 .07	86,831,634 .20
本期	- 30,432,337	- 30,964,414	- 145,213,78	- 118,619,62	- 22,650,941	- 3,528,590.

利润	. 48	. 87	0. 62	3. 50	. 96	86
加权平均基金份额本期利润	-0. 1092	-0. 1403	-0. 5088	-0. 5757	-0. 0771	-0. 0097
本期加权平均净值利润率	-6. 68%	-8. 69%	-29. 08%	-33. 08%	-3. 60%	-0. 45%
本期基金份额净值增长率	-5. 81%	-6. 18%	-22. 55%	-22. 87%	-0. 22%	-0. 62%
3. 1 . 2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	

期末可供分配利润	69,389,635 .49	24,629,840 .51	67,485,041 .05	39,768,260 .75	242,745,95 4.00	192,089,70 5.41
期末可供分配基金份额利润	0.1693	0.1114	0.2731	0.2199	0.7168	0.6659
期末基金资产净值	629,788,83 2.89	333,809,16 1.27	403,088,69 6.71	291,003,65 6.50	713,183,70 2.08	601,806,48 3.20
期末基金份额净值	1.5362	1.5096	1.6310	1.6091	2.1060	2.0862
3.1 .3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	

基金份额累计净值增长率	65.43%	59.44%	75.64%	69.95%	126.79%	120.34%
-------------	--------	--------	--------	--------	---------	---------

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

西部利得沪深 300 指数 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.56%	0.71%	-6.65%	0.75%	2.09%	-0.04%
过去六个月	-6.60%	0.79%	-10.17%	0.81%	3.57%	-0.02%
过去一年	-5.81%	0.79%	-10.79%	0.80%	4.98%	-0.01%
过去三年	-27.22%	1.12%	-32.59%	1.06%	5.37%	0.06%
过去五年	65.18%	1.20%	13.81%	1.15%	51.37%	0.05%
自基金合同生效起至今	65.43%	1.20%	14.12%	1.15%	51.31%	0.05%

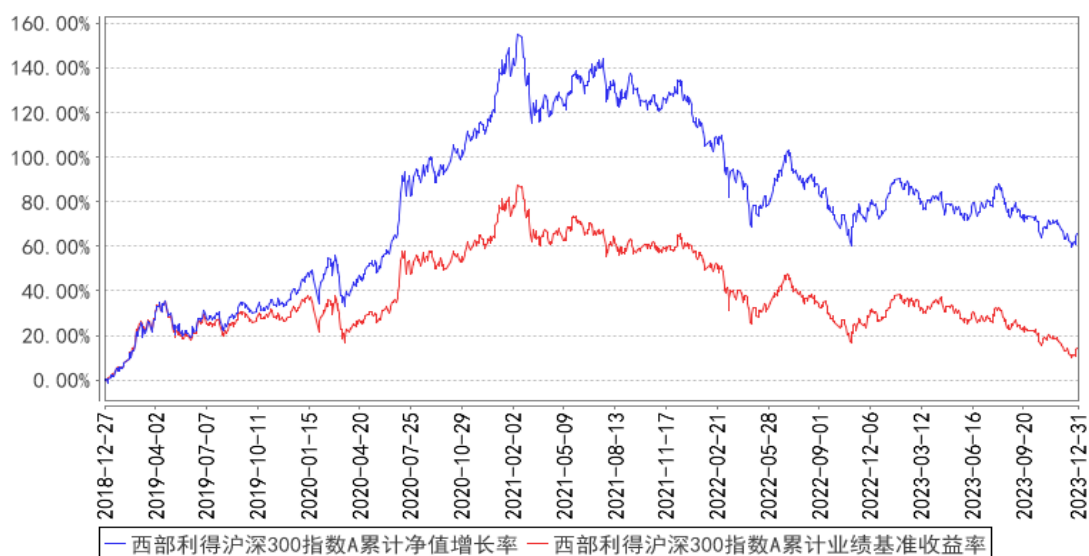
西部利得沪深 300 指数 C

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

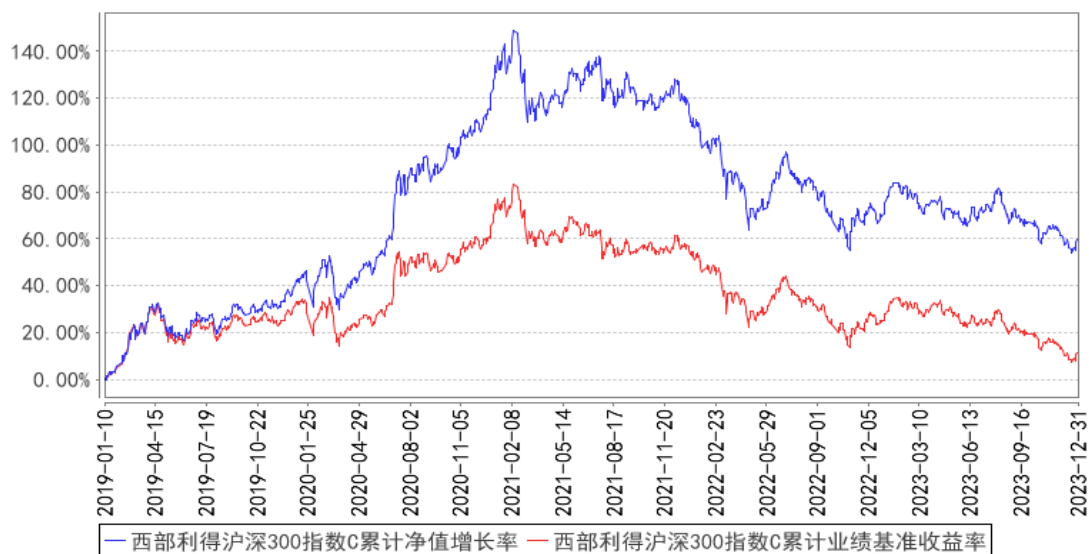
	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去三个月	-4.65%	0.71%	-6.65%	0.75%	2.00%	-0.04%
过去六个月	-6.79%	0.79%	-10.17%	0.81%	3.38%	-0.02%
过去一年	-6.18%	0.79%	-10.79%	0.80%	4.61%	-0.01%
过去三年	-28.09%	1.12%	-32.59%	1.06%	4.50%	0.06%
自基金合同生效起至今	59.44%	1.20%	11.42%	1.15%	48.02%	0.05%

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

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



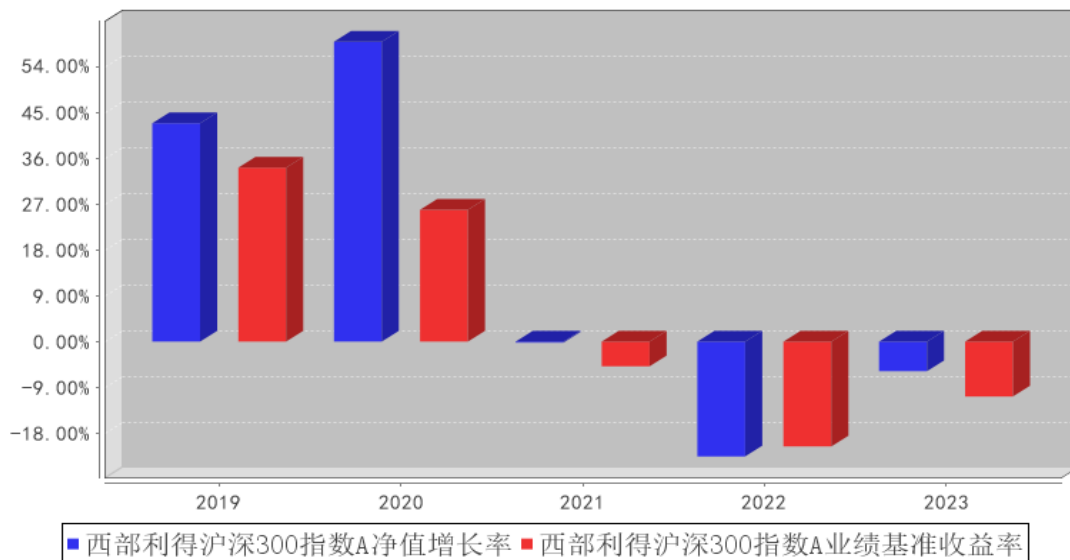
西部利得沪深300指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



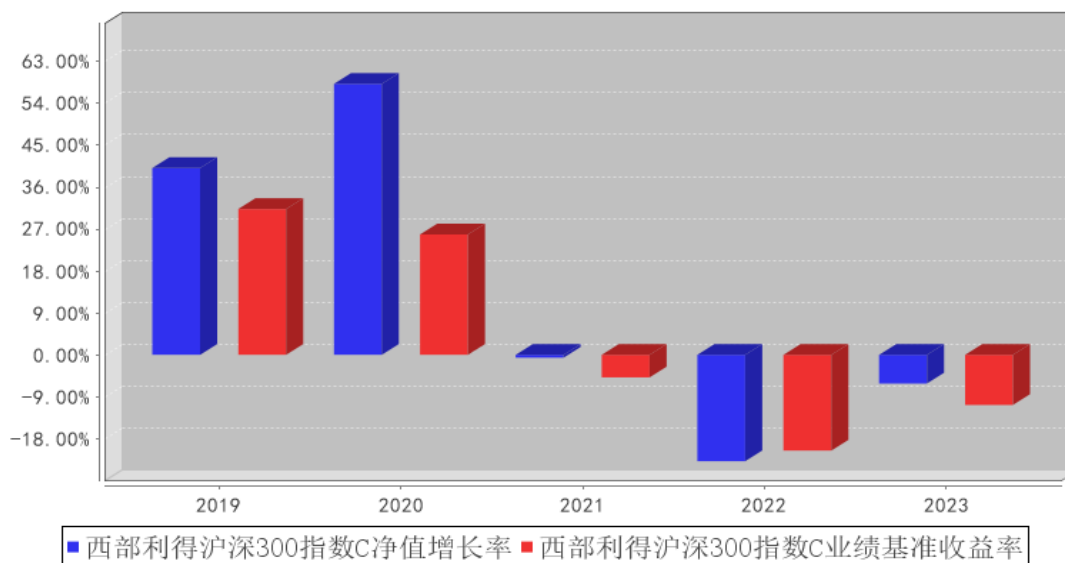
注：本基金由原西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金于 2018 年 12 月 27 日转型而来。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

西部利得沪深300指数A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



西部利得沪深300指数C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



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

本基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

无

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行过利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从业年限	说明

		任职日期	离任日期		
盛丰衍	总经理助理、投资总监、主动量化投资部总经理、基金经理	2018 年 1 月 26 日	-	11 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。
翟梓舰	基金经理助理	2023 年 6 月 30 日	2023 年 10 月 20 日	6 年	美国哥伦比亚大学工业工程专业硕士。曾任华泰证券股份有限公司算法工程师。2022 年 6 月加入本公司，具有基金从业资格，中国国籍。

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》、本基金《基金合同》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，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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规制定了《西部利得基金管理有限公司公平交易管理办法》。针对股票、债券等投资标的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动进行公平交易管理。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

析报告，对本基金管理人管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）不同时间窗口同向（1 日、3 日、5 日）交易的交易价差以及 T 检验、银行间交易价格偏离度进行了分析。

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

投资策略上，本基金始终维持高股票仓位，相对基准指数正向暴露的风格因子主要为价值；负向暴露的风格因子主要为市值、流动性，行业配置参考沪深 300 指数，股票持仓分散以此弱化个股黑天鹅的影响。本基金量化策略的特点是多策略，利用主观决策中长期风格，量化决策个股。本基金努力通过选股获得相对于沪深 300 指数的超额收益，以期打造优质的沪深 300 指数增强基金。

感谢持有人的支持，我们将继续以诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金，努力为持有人带来优异回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内基金业绩表现参见本报告第三部分“主要财务指标和基金净值表现”。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，影响 A 股的主要有三股力量。

其一是资本市场投资端变化

公募、私募、外资、保险都是主要的资本市场资金来源，影响着市场的波动。外资的流入流出受中美利差影响较大。保险资金或是未来可以预期的边际增量，其方向以高股息资产为主。

其二是中央加杠杆节奏

随着地产驱动的经济模式告一段落，居民部门、企业部门、地方政府部门的杠杆率也阶段性

见顶，短期稳经济主要依赖于中央加杠杆。未来中国经济以及和经济紧密相关的股票资产表现可能取决于中央加杠杆的节奏。

其三是高质量发展的推进

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

整体来看，A 股权益市场估值处于历史低位区域，所以当下非常看好 2024 年权益市场表现结构上看好红利资产，其符合当下投资者的偏好，也是未来增量资金优选方向。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人始终坚持基金份额持有人利益优先原则，从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实。公司监察稽核部依据法律法规的规定及公司内部控制的整体要求，独立对公司经营、旗下投资组合及员工行为等的合规性进行了定期和不定期检查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，并定期向监管机构、公司董事会出具监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人的监察稽核主要工作如下：

- 一、结合公司业务开展的实际情况，进一步完善公司各项内部制度和细化各项业务流程；
- 二、落实内部监察稽核工作，对公司业务流程及管理的各项环节进行定期及不定期稽核；
- 三、根据法律法规及时、准确、完整的披露与本基金有关的各项法定信息披露文件，并在指定报刊和公司网站进行披露，确保基金投资人和公众及时、准确和完整地获取公司和本基金的各项公开信息；
- 四、继续加强反洗钱工作力度，进一步落实洗钱风险自评估工作和反洗钱异常报告筛选，并进一步完善工作流程。监察稽核部定期和不定期地向各监管机构按时提交报备各类反洗钱报告，并不断贯彻落实反洗钱法规及监管要求；
- 五、落实各项合规工作，确保公司各项业务及管理符合法律法规要求；
- 六、其他各类监察稽核工作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据相关法律法规的规定，本基金管理人制订了证券投资基金估值政策和程序，并经本基金管理人总经理办公会议审议通过成立了估值委员会。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评

估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。具体职责包括对本基金管理人估值政策和程序的制订和解释；在发生影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况，以及在采用新投资策略或投资新品种时，估值委员会负责对所采用的估值模型、假设及参数的适当性进行重新评估或修订，必要时聘请会计师事务所进行审核并出具意见。针对个别投资品种的估值方法调整，均须通过托管银行复核。

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

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

4.8 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“7.4.11 利润分配情况”。

4.9 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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2402314 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表、2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	<p>该基金管理人西部利得基金管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2023 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>

会计师事务所的地址	北京市长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
审计报告日期	2024 年 3 月 27 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	110,119,650.96	85,650,715.68
结算备付金		9,348,951.50	6,970,096.53
存出保证金		4,704,540.97	2,569,794.84
交易性金融资产	7.4.7.2	866,651,831.91	638,867,837.41
其中：股票投资		866,651,831.91	638,867,837.41
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	6,081,913.34
应收股利		-	-
应收申购款		1,648,946.91	1,417,346.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		992,473,922.25	741,557,704.67
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付清算款		23,799,152.36	25,067,467.89
应付赎回款		3,200,822.16	21,146,578.30
应付管理人报酬		572,488.61	483,812.55
应付托管费		107,341.62	90,714.83
应付销售服务费		111,968.58	97,869.93
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	7.4.7.9	1,084,154.76	578,907.96
负债合计		28,875,928.09	47,465,351.46
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	631,080,424.22	427,989,126.06
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	332,517,569.94	266,103,227.15
净资产合计		963,597,994.16	694,092,353.21
负债和净资产总计		992,473,922.25	741,557,704.67

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，西部利得沪深 300 指数 A 基金份额净值为 1.5362 元，基金份额总额为 409,957,590.46 份；西部利得沪深 300 指数 C 基金份额净值为 1.5096 元，基金份额总额为 221,122,833.76 份。西部利得沪深 300 指数基金总份额为 631,080,424.22 份。

7.2 利润表

会计主体：西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-51,865,568.71	-253,844,352.94
1. 利息收入		1,148,385.98	1,291,706.50
其中：存款利息收入	7.4.7.13	1,148,385.98	1,291,706.50
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-53,546,379.98	-225,350,206.70
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-61,989,097.72	-235,913,508.84
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-

资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-3,076,095.57	-3,676,358.80
股利收益	7.4.7.19	11,518,813.31	14,239,660.94
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	7.4.7.20	267,229.53	-30,387,754.52
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.21	265,195.76	601,901.78
减：二、营业总支出		9,531,183.64	9,989,051.18
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	6,485,547.17	6,913,749.15
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,216,040.14	1,296,327.90
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	1,422,948.51	1,450,699.15
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		1,846.26	-
8. 其他费用	7.4.7.23	404,801.56	328,274.98
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-61,396,752.35	-263,833,404.12
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-61,396,752.35	-263,833,404.12
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-61,396,752.35	-263,833,404.12

7.3 净资产变动表

会计主体：西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	427,989,126.06	-	266,103,227.15	694,092,353.21

二、本期期初净资产	427,989,126.06	-	266,103,227.15	694,092,353.21
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	203,091,298.16	-	66,414,342.79	269,505,640.95
(一)、综合收益总额	-	-	-61,396,752.35	-61,396,752.35
(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)	203,091,298.16	-	127,811,095.14	330,902,393.30
其中：1. 基金申购款	444,109,006.20	-	274,508,363.60	718,617,369.80
2. 基金赎回款	-	-	-	-387,714,976.50
	241,017,708.04		146,697,268.46	
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	631,080,424.22	-	332,517,569.94	963,597,994.16
项目	上年度可比期间			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	627,116,345.39	-	687,873,839.89	1,314,990,185.28
二、本期期初净资产	627,116,345.39	-	687,873,839.89	1,314,990,185.28
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	-	-620,897,832.07
	199,127,219.33		421,770,612.74	
(一)、综合收益总额	-	-	-	-263,833,404.12
			263,833,404.12	
(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)	-	-	-	-357,064,427.95
	199,127,219.33		157,937,208.62	

“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	258,835,459.82	-	186,468,150.62	445,303,610.44
2. 基金赎回款	-	-	-	-802,368,038.39
	457,962,679.15		344,405,359.24	
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	427,989,126.06	-	266,103,227.15	694,092,353.21

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）是由西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“原基金”）转型而来。原基金经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]2113 号《关于准予西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由西部利得基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。原基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 200,484,720.05 元，业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第 1700239 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 21 日正式生效，原基金合同生效日的基金份额总额为 200,520,789.91 份基金份额，其中认购资金利息折合 36,069.86 份基金份额。

根据原基金的基金管理人西部利得基金管理有限公司于 2018 年 12 月 28 日发布的《关于西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，自 2018 年 12 月 27 日起，原基金更名为西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金，《西部利得

久安回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效,《西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》于同日生效。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。本基金的基金管理人为西部利得基金管理有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司。

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

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

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

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

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

7.4.3 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 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求,真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况、2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 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、衍生金融资产等。

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。

7.4.4 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。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金合同》的规定。在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 10 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%，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；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位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，本基金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。在符合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，不需召开基金份额持有人大会。基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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，本基金根据中国证监会公告[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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

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

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

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入,暂不征收企业所得税。

(c)对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公司(“挂牌公司”)取得的股息红利所得,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

(d)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起,证券交易印花税实施减半征收。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位:人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	110,119,650.96	85,650,715.68
等于: 本金	110,085,994.19	85,607,223.52
加: 应计利息	33,656.77	43,492.16
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	110,119,650.96	85,650,715.68

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		911,996,490.56	-	866,651,831.91	-45,344,658.65
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		911,996,490.56	-	866,651,831.91	-45,344,658.65
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		683,324,968.26	-	638,867,837.41	-44,457,130.85
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		683,324,968.26	-	638,867,837.41	-44,457,130.85

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	33,250,802.67	-	-	-
其中： 股指期货投资	33,250,802.67	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	33,250,802.67	-	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 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	15,470,940.00	-	-	-
其中： 股指期货投资	15,470,940.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	15,470,940.00	-	-	-

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则（试行）》及《企业会计准则——金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具——股指期货投资”与“证券清算款——股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具——股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

7.4.7.3.2 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
IF2401	IF2401	13.00	13,415,220.00	281,337.33
IF2402	IF2402	20.00	20,674,800.00	557,880.00
合计				839,217.33
减：可抵销期货暂收款				839,217.33
净额				-

7.4.7.3.3 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本报告期及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末及上年度期末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末及上年度期末均未持有债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期内未发生债权投资减值准备。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末及上年度期末均未持有其他债权投资。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末及上年度期末均未持有其他权益工具投资。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末及上年度期末均未持有其他权益工具投资。

7.4.7.8 其他资产

本基金于本报告期末及上年度期末均未持有其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	6,499.89	223.32
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	784,578.33	250,409.66
其中：交易所市场	784,578.33	250,409.66
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	293,076.54	328,274.98
合计	1,084,154.76	578,907.96

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

西部利得沪深 300 指数 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	247,145,583.96	247,145,583.96
本期申购	233,608,009.95	233,608,009.95
本期赎回（以“-”号填列）	-70,796,003.45	-70,796,003.45
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	409,957,590.46	409,957,590.46

西部利得沪深 300 指数 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	180,843,542.10	180,843,542.10
本期申购	210,500,996.25	210,500,996.25
本期赎回（以“-”号填列）	-170,221,704.59	-170,221,704.59
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	221,122,833.76	221,122,833.76

注：申购含红利再投资、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

西部利得沪深 300 指数 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	67,485,041.05	88,458,071.70	155,943,112.75
本期期初	67,485,041.05	88,458,071.70	155,943,112.75
本期利润	-33,733,853.91	3,301,516.43	-30,432,337.48
本期基金份额交易产生的变动数	35,638,448.35	58,682,018.81	94,320,467.16
其中：基金申购款	54,234,381.76	86,162,588.99	140,396,970.75
基金赎回款	-18,595,933.41	-27,480,570.18	-46,076,503.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	69,389,635.49	150,441,606.94	219,831,242.43

西部利得沪深 300 指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	39,768,260.75	70,391,853.65	110,160,114.40
本期期初	39,768,260.75	70,391,853.65	110,160,114.40
本期利润	-27,930,127.97	-3,034,286.90	-30,964,414.87
本期基金份额交易产生的变动数	12,791,707.73	20,698,920.25	33,490,627.98
其中：基金申购款	43,843,530.28	90,267,862.57	134,111,392.85
基金赎回款	-31,051,822.55	-69,568,942.32	-100,620,764.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	24,629,840.51	88,056,487.00	112,686,327.51

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,092,855.92	1,222,434.43
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	39,208.06	52,012.26
其他	16,322.00	17,259.81
合计	1,148,385.98	1,291,706.50

注：其他为结算保证金利息收入以及销售款利息收入。

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	-61,989,097.72	-235,913,508.84
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	-61,989,097.72	-235,913,508.84

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
卖出股票成交总 额	3,497,602,693.80	4,610,300,374.39
减：卖出股票成本 总额	3,553,094,920.58	4,836,688,673.72
减：交易费用	6,496,870.94	9,525,209.51
买卖股票差价收 入	-61,989,097.72	-235,913,508.84

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无证券出借差价收入。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金于本报告期及上年度可比期间均无买卖债券差价收入。

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金于本报告期及上年度可比期间均无债券赎回差价收入。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金于本报告期及上年度可比期间均无债券申购差价收入。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益**7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金于本报告期内及上年度期内均未持有资产支持证券。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.17 贵金属投资收益**7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未持有贵金属。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未持有贵金属。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未持有贵金属。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未持有贵金属。

7.4.7.18 衍生工具收益**7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未持有衍生工具。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	-3,076,095.57	-3,676,358.80

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	11,518,813.31	14,239,660.94
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	11,518,813.31	14,239,660.94

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-887,527.80	-30,073,954.52
股票投资	-887,527.80	-30,073,954.52
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	1,154,757.33	-313,800.00
权证投资	-	-
期货投资	1,154,757.33	-313,800.00
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	267,229.53	-30,387,754.52

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	261,882.72	493,991.26
基金转换费收入	3,313.04	107,910.52
合计	265,195.76	601,901.78

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

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

7.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	43,000.00	70,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	241,801.56	138,274.98
合计	404,801.56	328,274.98

7.4.7.24 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。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
西部利得基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构
平安银行股份有限公司	基金托管人
西部证券股份有限公司	基金管理人的股东
利得科技有限公司	基金管理人的股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
-------	--	---

	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
西部证券	2,489,169,788.35	34.30	3,840,351,057.73	43.32

7.4.10.1.2 债券交易

本基金于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。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金于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回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金于本报告期内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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
西部证券	1,086,358.93	34.45	107,905.97	13.75
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
西部证券	1,656,351.47	40.76	250,409.66	100.00

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用西部证券证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从西部证券获得证券研究综合服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	6,485,547.17	6,913,749.15
其中：应支付销售机构的客户维	1,585,131.33	1,427,500.38

护费		
应支付基金管理人的净管理费	4,900,415.84	5,486,248.77

注：支付基金管理人西部利得基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.8% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.8\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,216,040.14	1,296,327.90

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

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

7.4.10.2.3 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		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	西部利得沪深 300 指数 A	西部利得沪深 300 指数 C	合计
平安银行	-	11,782.13	11,782.13
西部利得基金	-	757,315.07	757,315.07
西部证券	-	5,952.42	5,952.42
合计	-	775,049.62	775,049.62
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	西部利得沪深 300 指数 A	西部利得沪深 300 指数 C	合计
平安银行	-	11,345.90	11,345.90
西部利得基金	-	841,133.37	841,133.37
西部证券	-	6,317.63	6,317.63
合计	-	858,796.90	858,796.90

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.4% 的年费率计提，逐日累计至

每月月底，按月支付给西部利得基金，再由西部利得基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.4\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本报告期内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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行证券出借业务。

7.4.10.4.2 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

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度可比期间无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行股份有限公司	110,119,650.96	1,092,855.92	85,650,715.68	1,222,434.43

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业利率计息。

2. 本基金通过“平安银行股份有限公司基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2023年12月31日的相关余额为人民币2,209,738.75元。

(2022年12月31日：人民币2,065,853.66元)

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001239	永达股份	2023年12月4日	6个月	锁定期	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001306	夏厦精密	2023年11月9日	6个月	锁定期	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-
001326	联域股份	2023年11月1日	6个月	锁定期	41.18	48.64	99	4,076.82	4,815.36	-
001358	兴欣新材	2023年12月14日	6个月	锁定期	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
001378	德冠新材	2023年10月23日	6个月	锁定期	31.68	31.27	205	6,494.40	6,410.35	-
301172	君逸数码	2023年7月19日	6个月	锁定期	31.33	38.16	438	13,722.54	16,714.08	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	锁定期	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-

301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	锁定期	57.88	45.48	281	16,264.28	12,779.88	-
301251	威尔高	2023年8月30日	6个月	锁定期	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	锁定期	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
301272	英华特	2023年7月6日	6个月	锁定期	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	锁定期	19.99	19.35	583	11,654.17	11,281.05	-
301329	信音电子	2023年7月5日	6个月	锁定期	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301348	蓝箭电子	2023年8月1日	6个月	锁定期	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-
301362	民爆光电	2023年7月27日	6个月	锁定期	51.05	38.52	420	21,441.00	16,178.40	-
301370	国科恒泰	2023年7月3日	6个月	锁定期	13.39	16.01	1,240	16,603.60	19,852.40	-
301371	敷尔佳	2023年7月24日	6个月	锁定期	55.68	37.58	429	23,886.72	16,121.82	-
301372	科净源	2023年8月3日	6个月	锁定期	45.00	43.59	231	10,395.00	10,069.29	-

301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	锁定期	26.68	18.69	520	13,873.60	9,718.80	-
301413	安培龙	2023年12月11日	6个月	锁定期	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301418	协昌科技	2023年8月10日	6个月	锁定期	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-
301421	波长光电	2023年8月16日	6个月	锁定期	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84	-
301456	盘古智能	2023年7月6日	6个月	锁定期	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-
301459	丰茂股份	2023年12月6日	6个月	锁定期	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
301469	恒达新材	2023年8月10日	6个月	锁定期	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	锁定期	57.66	47.25	482	27,792.12	22,774.50	-
301487	盟固利	2023年8月1日	6个月	锁定期	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-
301488	豪恩汽车	2023年6月26日	6个月	锁定期	39.78	69.09	262	10,422.36	18,101.58	-
301489	思泉新材	2023年10月16日	6个月	锁定期	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-

301498	乖宝宠物	2023年8月9日	6个月	锁定期	39.99	38.81	554	22,154.46	21,500.74	-
301499	维科精密	2023年7月13日	6个月	锁定期	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-
301500	飞南资源	2023年9月13日	6个月	锁定期	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-
301507	民生健康	2023年8月24日	6个月	锁定期	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-
301508	中机认检	2023年11月23日	6个月	锁定期	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
301510	固高科技	2023年8月4日	6个月	锁定期	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301511	德福科技	2023年8月8日	6个月	锁定期	28.00	22.67	982	27,496.00	22,261.94	-
301515	港通医疗	2023年7月13日	6个月	锁定期	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-
301516	中远通	2023年12月1日	6个月	锁定期	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301517	陕西华达	2023年10月9日	6个月	锁定期	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301519	舜禹股份	2023年7月19日	6个月	锁定期	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-

301525	儒竞科技	2023年8月23日	6个月	锁定期	99.57	81.46	246	24,494.22	20,039.16	-
301526	国际复材	2023年12月19日	6个月	锁定期	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-
301528	多浦乐	2023年8月17日	6个月	锁定期	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-
301529	福赛科技	2023年8月31日	6个月	锁定期	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
301533	威马农机	2023年8月7日	6个月	锁定期	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-
301548	崇德科技	2023年9月11日	6个月	锁定期	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-
301550	斯菱股份	2023年9月6日	6个月	锁定期	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-
301555	惠柏新材	2023年10月24日	6个月	锁定期	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301558	三态股份	2023年9月21日	6个月	锁定期	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-
301559	中集环科	2023年9月26日	6个月	锁定期	24.22	18.24	1,243	30,105.46	22,672.32	-
301566	C 达利凯	2023年12月22日	6个月	锁定期	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-

	普									
301568	思泰克	2023年11月21日	6个月	锁定期	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
301578	C辰奕智能	2023年12月21日	6个月	锁定期	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月	锁定期	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-
603004	C鼎龙	2023年12月20日	6个月	锁定期	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603062	麦加芯彩	2023年10月31日	6个月	锁定期	58.08	57.81	126	7,318.08	7,284.06	-
603075	热威股份	2023年9月1日	6个月	锁定期	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
603107	上海汽配	2023年10月25日	6个月	锁定期	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-
603119	浙江荣泰	2023年7月21日	6个月	锁定期	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-
603193	润本股份	2023年10月9日	6个月	锁定期	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-
603231	索宝蛋白	2023年12月6日	6个月	锁定期	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-
603270	金帝	2023年8月	6个月	锁定期	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-

	股份	月 25 日		期						
603273	天元智能	2023 年 10 月 16 日	6 个月	锁定期	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603275	众辰科技	2023 年 8 月 16 日	6 个月	锁定期	49.97	39.70	193	9,644.21	7,662.10	-
603276	恒兴新材	2023 年 9 月 18 日	6 个月	锁定期	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603373	安邦护卫	2023 年 12 月 13 日	6 个月	锁定期	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
688347	华虹公司	2023 年 7 月 27 日	6 个月	锁定期	52.00	42.06	21,478	1,116,856.00	903,364.68	-
688450	光格科技	2023 年 7 月 17 日	6 个月	锁定期	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-
688548	广钢气体	2023 年 8 月 8 日	6 个月	锁定期	9.87	12.75	2,816	27,793.92	35,904.00	-
688549	中巨芯	2023 年 8 月 30 日	6 个月	锁定期	5.18	8.09	4,294	22,242.92	34,738.46	-
688563	航材股份	2023 年 7 月 12 日	6 个月	锁定期	78.99	60.49	555	43,839.45	33,571.95	-
688573	信宇人	2023 年 8 月 9 日	6 个月	锁定期	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-
688582	芯动	2023 年 6 月	6 个月	锁定期	26.74	38.67	648	17,327.52	25,058.16	-

	联科	月 21 日		期						
688591	泰凌微	2023 年 8 月 18 日	6 个月	锁定期	24.98	28.02	681	17,011.38	19,081.62	-
688592	司南导航	2023 年 8 月 7 日	6 个月	锁定期	50.50	50.53	216	10,908.00	10,914.48	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	锁定期	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-
688610	埃科光电	2023 年 7 月 10 日	6 个月	锁定期	73.33	51.00	275	20,165.75	14,025.00	-
688612	威迈斯	2023 年 7 月 19 日	6 个月	锁定期	47.29	37.97	422	19,956.38	16,023.34	-
688627	精智达	2023 年 7 月 11 日	6 个月	锁定期	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-
688638	誉辰智能	2023 年 7 月 4 日	6 个月	锁定期	83.90	59.68	141	11,829.90	8,414.88	-
688646	逸飞激光	2023 年 7 月 21 日	6 个月	锁定期	46.80	36.07	219	10,249.20	7,899.33	-
688648	中邮科技	2023 年 11 月 6 日	6 个月	锁定期	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
688651	盛邦安全	2023 年 7 月 19 日	6 个月	锁定期	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-
688652	京仪	2023 年 11 月	6 个月	锁定期	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-

	装备	月 22 日		期						
688653	康希通信	2023 年 11 月 10 日	6 个月	锁定期	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-
688657	浩辰软件	2023 年 9 月 25 日	6 个月	锁定期	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688671	碧兴物联	2023 年 8 月 2 日	6 个月	锁定期	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	-
688693	锆威特	2023 年 8 月 10 日	6 个月	锁定期	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
688702	盛科通信	2023 年 9 月 6 日	6 个月	锁定期	42.66	48.18	549	23,420.34	26,450.82	-
688716	中研股份	2023 年 9 月 13 日	6 个月	锁定期	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-
688719	爱科赛博	2023 年 9 月 20 日	6 个月	锁定期	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-
688720	艾森股份	2023 年 11 月 29 日	6 个月	锁定期	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持暂时停牌股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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，将风险控制可在承受的范围之内。

7.4.13.2 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。

7.4.13.3 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、组合在短期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。

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金等。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合

的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	110,119,650.96	-	-	-	110,119,650.96
结算备付金	9,348,951.50	-	-	-	9,348,951.50
存出保证金	4,704,540.97	-	-	-	4,704,540.97
交易性金融资产	-	-	-	866,651,831.91	866,651,831.91
应收申购款	-	-	-	1,648,946.91	1,648,946.91
资产总计	124,173,143.43	-	-	868,300,778.82	992,473,922.25
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,200,822.16	3,200,822.16
应付管理人报酬	-	-	-	572,488.61	572,488.61
应付托管费	-	-	-	107,341.62	107,341.62
应付清算款	-	-	-	23,799,152.36	23,799,152.36
应付销售服务费	-	-	-	111,968.58	111,968.58
其他负债	-	-	-	1,084,154.76	1,084,154.76
负债总计	-	-	-	28,875,928.09	28,875,928.09
利率敏感度缺口	124,173,143.43	-	-	839,424,850.73	963,597,994.16
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	85,650,715.68	-	-	-	85,650,715.68
结算备付金	6,970,096.53	-	-	-	6,970,096.53
存出保证金	2,569,794.84	-	-	-	2,569,794.84
交易性金融资产	-	-	-	638,867,837.41	638,867,837.41
应收申购款	-	-	-	1,417,346.87	1,417,346.87
应收清算款	-	-	-	6,081,913.34	6,081,913.34
资产总计	95,190,607.05	-	-	646,367,097.62	741,557,704.67
负债					
应付赎回款	-	-	-	21,146,578.30	21,146,578.30
应付管理人报酬	-	-	-	483,812.55	483,812.55
应付托管费	-	-	-	90,714.83	90,714.83
应付清算款	-	-	-	25,067,467.89	25,067,467.89
应付销售服务费	-	-	-	97,869.93	97,869.93
其他负债	-	-	-	578,907.96	578,907.96
负债总计	-	-	-	47,465,351.46	47,465,351.46
利率敏感度缺口	95,190,607.05	-	-	598,901,746.16	694,092,353.21

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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 12 月 31 日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	866,651,831.91	89.94	638,867,837.41	92.04
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	866,651,831.91	89.94	638,867,837.41	92.04

7.4.13.4.3.2 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	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末 (2023 年 12 月 31 日)	上年度末 (2022 年 12 月 31 日)
		业绩比较基准上升 5%的影响金额	50,951,000.00
	业绩比较基准下降 5%的影响金额	-50,951,000.00	-37,119,000.00

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	864,607,765.38	636,236,505.42
第二层次	-	-
第三层次	2,044,066.53	2,631,331.99
合计	866,651,831.91	638,867,837.41

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

	本期

项目	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	2,631,331.99	2,631,331.99
当期购买	-	2,980,839.63	2,980,839.63
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	3,583,480.80	3,583,480.80
当期利得或损失总额	-	15,375.71	15,375.71
其中：计入损益的利得或损失	-	15,375.71	15,375.71
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	2,044,066.53	2,044,066.53
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-49,882.67	-49,882.67
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	6,303,024.98	6,303,024.98
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	4,188,089.26	4,188,089.26
当期利得或损失总额	-	516,396.27	516,396.27
其中：计入损益的利得或损失	-	516,396.27	516,396.27
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	2,631,331.99	2,631,331.99
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-78,719.86	-78,719.86

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票	2,044,066.53	亚式期权模型	预期波动率	18.55%-219.88%	与公允价值反向变动
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票	2,631,331.99	亚式期权模型	预期波动率	18.91%-247.56%	与公允价值反向变动

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2023 年 12 月 31 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	866,651,831.91	87.32
	其中：股票	866,651,831.91	87.32
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	119,468,602.46	12.04

8	其他各项资产	6,353,487.88	0.64
9	合计	992,473,922.25	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	4,840,744.00	0.50
B	采矿业	23,932,545.50	2.48
C	制造业	414,143,356.64	42.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,589,389.00	1.10
E	建筑业	32,828,753.00	3.41
F	批发和零售业	18,410,438.00	1.91
G	交通运输、仓储和邮政业	19,276,580.00	2.00
H	住宿和餐饮业	3,133,520.00	0.33
I	信息传输、软件和信息技术服务业	47,639,962.65	4.94
J	金融业	203,116,433.53	21.08
K	房地产业	8,580,621.71	0.89
L	租赁和商务服务业	6,063,211.00	0.63
M	科学研究和技术服务业	1,094,401.00	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	416,066.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	2,126,880.00	0.22
S	综合	-	-
	合计	796,192,902.03	82.63

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	464,845.00	0.05
B	采矿业	-	-
C	制造业	53,063,888.22	5.51

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,048,882.00	0.11
E	建筑业	2,919,166.40	0.30
F	批发和零售业	2,309,845.60	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	951,718.00	0.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,758,640.03	0.18
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,907,464.00	0.20
L	租赁和商务服务业	241,102.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	2,892,283.92	0.30
N	水利、环境和公共设施管理业	2,656,774.71	0.28
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	244,320.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	70,458,929.88	7.31

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金于本报告期末未持有港股通股票。

8.3 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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	31,775	54,843,650.00	5.69
2	601318	中国平安	645,419	26,010,385.70	2.70
3	000768	中航西飞	595,530	13,322,006.10	1.38
4	002841	视源股份	278,500	12,744,160.00	1.32
5	600741	华域汽车	730,016	11,884,660.48	1.23
6	601398	工商银行	2,470,000	11,806,600.00	1.23
7	601728	中国电信	2,118,900	11,463,249.00	1.19
8	000858	五粮液	80,600	11,308,986.00	1.17

9	000333	美的集团	203,400	11,111,742.00	1.15
10	601766	中国中车	2,102,300	11,058,098.00	1.15
11	002001	新和成	615,120	10,432,435.20	1.08
12	688126	沪硅产业	598,100	10,359,092.00	1.08
13	002938	鹏鼎控股	456,100	10,180,152.00	1.06
14	601319	中国人保	2,077,500	10,055,100.00	1.04
15	600958	东方证券	1,155,140	10,049,718.00	1.04
16	600406	国电南瑞	449,000	10,021,680.00	1.04
17	601877	正泰电器	455,700	9,802,107.00	1.02
18	601607	上海医药	583,000	9,753,590.00	1.01
19	600875	东方电气	663,300	9,697,446.00	1.01
20	300433	蓝思科技	733,800	9,686,160.00	1.01
21	601800	中国交建	1,268,200	9,638,320.00	1.00
22	300408	三环集团	324,500	9,556,525.00	0.99
23	000538	云南白药	194,300	9,549,845.00	0.99
24	600233	圆通速递	768,700	9,447,323.00	0.98
25	600332	白云山	328,395	9,392,097.00	0.97
26	300454	深信服	129,600	9,368,784.00	0.97
27	600061	国投资本	1,386,300	9,343,662.00	0.97
28	601328	交通银行	1,583,400	9,088,716.00	0.94
29	000617	中油资本	1,614,200	8,716,680.00	0.90
30	000963	华东医药	208,800	8,656,848.00	0.90
31	601186	中国铁建	1,121,600	8,535,376.00	0.89
32	600362	江西铜业	476,100	8,503,146.00	0.88
33	002916	深南电路	117,900	8,369,721.00	0.87
34	000938	紫光股份	392,300	7,591,005.00	0.79
35	601601	中国太保	317,500	7,550,150.00	0.78
36	600918	中泰证券	1,073,300	7,362,838.00	0.76
37	601138	工业富联	480,200	7,260,624.00	0.75
38	600919	江苏银行	1,057,600	7,075,344.00	0.73
39	601988	中国银行	1,695,100	6,763,449.00	0.70
40	600036	招商银行	238,422	6,632,900.04	0.69
41	601166	兴业银行	389,900	6,320,279.00	0.66
42	688396	华润微	137,492	6,144,517.48	0.64
43	601088	中国神华	190,300	5,965,905.00	0.62
44	601668	中国建筑	1,207,900	5,809,999.00	0.60
45	601169	北京银行	1,264,900	5,729,997.00	0.59
46	600104	上汽集团	395,200	5,347,056.00	0.55
47	002007	华兰生物	238,800	5,284,644.00	0.55
48	300750	宁德时代	31,140	5,083,916.40	0.53
49	603486	科沃斯	121,700	5,043,248.00	0.52
50	688561	奇安信	125,245	5,021,072.05	0.52
51	601818	光大银行	1,701,800	4,935,220.00	0.51

52	601225	陕西煤业	227,700	4,756,653.00	0.49
53	601658	邮储银行	1,052,600	4,578,810.00	0.48
54	600030	中信证券	214,100	4,361,217.00	0.45
55	000002	万科 A	392,300	4,103,458.00	0.43
56	600048	保利发展	414,000	4,098,600.00	0.43
57	601989	中国重工	990,100	4,089,113.00	0.42
58	300059	东方财富	284,700	3,997,188.00	0.41
59	601009	南京银行	528,300	3,898,854.00	0.40
60	601211	国泰君安	259,800	3,865,824.00	0.40
61	603260	合盛硅业	75,500	3,850,500.00	0.40
62	601288	农业银行	1,029,500	3,747,380.00	0.39
63	601012	隆基绿能	158,300	3,625,070.00	0.38
64	601699	潞安环能	164,100	3,595,431.00	0.37
65	600000	浦发银行	516,200	3,417,244.00	0.35
66	601816	京沪高铁	688,200	3,385,944.00	0.35
67	300274	阳光电源	37,400	3,275,866.00	0.34
68	300498	温氏股份	163,100	3,271,786.00	0.34
69	601888	中国中免	38,700	3,238,803.00	0.34
70	601336	新华保险	103,900	3,234,407.00	0.34
71	601688	华泰证券	231,100	3,223,845.00	0.33
72	688981	中芯国际	59,600	3,159,992.00	0.33
73	600754	锦江酒店	104,800	3,133,520.00	0.33
74	600585	海螺水泥	138,300	3,120,048.00	0.32
75	300014	亿纬锂能	73,800	3,114,360.00	0.32
76	600893	航发动力	82,100	3,068,898.00	0.32
77	002129	TCL 中环	195,300	3,054,492.00	0.32
78	601995	中金公司	79,500	3,024,975.00	0.31
79	600019	宝钢股份	510,000	3,024,300.00	0.31
80	002459	晶澳科技	145,700	3,018,904.00	0.31
81	601788	光大证券	194,100	2,993,022.00	0.31
82	600732	爱旭股份	169,600	2,991,744.00	0.31
83	002179	中航光电	76,700	2,991,300.00	0.31
84	600016	民生银行	795,100	2,973,674.00	0.31
85	601881	中国银河	245,503	2,958,311.15	0.31
86	688599	天合光能	102,980	2,938,019.40	0.30
87	605117	德业股份	34,500	2,894,550.00	0.30
88	603806	福斯特	119,100	2,890,557.00	0.30
89	600760	中航沈飞	68,360	2,883,424.80	0.30
90	600050	中国联通	658,200	2,882,916.00	0.30
91	600031	三一重工	208,800	2,875,176.00	0.30
92	002027	分众传媒	446,900	2,824,408.00	0.29
93	600372	中航机载	212,600	2,802,068.00	0.29
94	300763	锦浪科技	40,000	2,796,000.00	0.29

95	601059	信达证券	154,300	2,775,857.00	0.29
96	600438	通威股份	107,500	2,690,725.00	0.28
97	601998	中信银行	496,900	2,628,601.00	0.27
98	002202	金风科技	324,700	2,597,600.00	0.27
99	601390	中国中铁	445,600	2,531,008.00	0.26
100	601939	建设银行	387,100	2,520,021.00	0.26
101	000733	振华科技	42,700	2,512,468.00	0.26
102	601919	中远海控	259,500	2,486,010.00	0.26
103	000792	盐湖股份	149,700	2,387,715.00	0.25
104	000157	中联重科	364,600	2,380,838.00	0.25
105	601698	中国卫通	136,800	2,368,008.00	0.25
106	600999	招商证券	170,200	2,321,528.00	0.24
107	300142	沃森生物	98,400	2,313,384.00	0.24
108	600795	国电电力	552,400	2,297,984.00	0.24
109	601628	中国人寿	79,800	2,262,330.00	0.23
110	601006	大秦铁路	305,900	2,205,539.00	0.23
111	000425	徐工机械	399,600	2,181,816.00	0.23
112	000301	东方盛虹	226,000	2,169,600.00	0.23
113	601898	中煤能源	221,900	2,150,211.00	0.22
114	600588	用友网络	120,400	2,141,916.00	0.22
115	300413	芒果超媒	84,400	2,126,880.00	0.22
116	003816	中国广核	665,300	2,069,083.00	0.21
117	002493	荣盛石化	199,500	2,064,825.00	0.21
118	600015	华夏银行	366,900	2,061,978.00	0.21
119	002074	国轩高科	95,900	2,061,850.00	0.21
120	002812	恩捷股份	36,200	2,056,884.00	0.21
121	002555	三七互娱	108,700	2,044,647.00	0.21
122	601868	中国能建	972,400	2,042,040.00	0.21
123	603833	欧派家居	29,014	2,019,664.54	0.21
124	600219	南山铝业	681,700	2,004,198.00	0.21
125	300919	中伟股份	40,700	1,999,591.00	0.21
126	300999	金龙鱼	59,400	1,982,772.00	0.21
127	600803	新奥股份	117,600	1,978,032.00	0.21
128	600196	复星医药	78,800	1,972,364.00	0.20
129	600346	恒力石化	149,700	1,971,549.00	0.20
130	601618	中国中冶	642,300	1,965,438.00	0.20
131	000876	新希望	208,600	1,944,152.00	0.20
132	000708	中信特钢	138,200	1,940,328.00	0.20
133	300957	贝泰妮	28,262	1,926,620.54	0.20
134	600039	四川路桥	254,200	1,903,958.00	0.20
135	601615	明阳智能	147,000	1,843,380.00	0.19
136	002180	纳思达	81,200	1,837,556.00	0.19
137	000877	天山股份	265,700	1,774,876.00	0.18

138	601808	中海油服	120,500	1,761,710.00	0.18
139	601238	广汽集团	200,500	1,754,375.00	0.18
140	600900	长江电力	69,600	1,624,464.00	0.17
141	600188	兖矿能源	81,350	1,611,543.50	0.17
142	002714	牧原股份	38,100	1,568,958.00	0.16
143	600011	华能国际	180,200	1,387,540.00	0.14
144	000983	山西焦煤	139,000	1,373,320.00	0.14
145	600276	恒瑞医药	30,300	1,370,469.00	0.14
146	601899	紫金矿业	103,100	1,284,626.00	0.13
147	601838	成都银行	108,900	1,226,214.00	0.13
148	002594	比亚迪	5,400	1,069,200.00	0.11
149	601229	上海银行	173,100	1,033,407.00	0.11
150	300760	迈瑞医疗	3,400	988,040.00	0.10
151	002475	立讯精密	27,900	961,155.00	0.10
152	600887	伊利股份	35,500	949,625.00	0.10
153	603259	药明康德	11,400	829,464.00	0.09
154	000725	京东方 A	208,900	814,710.00	0.08
155	000651	格力电器	25,100	807,467.00	0.08
156	600309	万华化学	10,500	806,610.00	0.08
157	002415	海康威视	22,700	788,144.00	0.08
158	300124	汇川技术	11,900	751,366.00	0.08
159	000568	泸州老窖	4,100	735,622.00	0.08
160	600176	中国巨石	73,600	723,488.00	0.08
161	600809	山西汾酒	2,700	622,971.00	0.06
162	600028	中国石化	100,700	561,906.00	0.06
163	002352	顺丰控股	13,600	549,440.00	0.06
164	600837	海通证券	53,800	504,106.00	0.05
165	600941	中国移动	5,000	497,400.00	0.05
166	002230	科大讯飞	10,300	477,714.00	0.05
167	000063	中兴通讯	17,800	471,344.00	0.05
168	000625	长安汽车	27,700	466,191.00	0.05
169	601857	中国石油	65,100	459,606.00	0.05
170	000100	TCL 科技	104,700	450,210.00	0.05
171	002142	宁波银行	22,100	444,431.00	0.05
172	600690	海尔智家	21,100	443,100.00	0.05
173	603501	韦尔股份	4,100	437,511.00	0.05
174	300015	爱尔眼科	26,300	416,066.00	0.04
175	300122	智飞生物	6,800	415,548.00	0.04
176	000338	潍柴动力	30,298	413,567.70	0.04
177	600436	片仔癀	1,700	411,383.00	0.04
178	688111	金山办公	1,300	411,060.00	0.04
179	601985	中国核电	53,100	398,250.00	0.04
180	600089	特变电工	28,200	389,160.00	0.04

181	002304	洋河股份	3,400	373,660.00	0.04
182	600150	中国船舶	12,600	370,944.00	0.04
183	002050	三花智控	12,600	370,440.00	0.04
184	688012	中微公司	2,400	368,640.00	0.04
185	002371	北方华创	1,500	368,565.00	0.04
186	603288	海天味业	9,300	352,935.00	0.04
187	600905	三峡能源	80,500	351,785.00	0.04
188	603986	兆易创新	3,800	351,082.00	0.04
189	600660	福耀玻璃	9,000	336,510.00	0.03
190	002466	天齐锂业	5,800	323,582.00	0.03
191	688008	澜起科技	5,100	299,676.00	0.03
192	300782	卓胜微	2,100	296,100.00	0.03
193	002241	歌尔股份	13,500	283,635.00	0.03
194	600111	北方稀土	14,100	272,694.00	0.03
195	000166	申万宏源	60,506	268,646.64	0.03
196	603019	中科曙光	6,500	256,685.00	0.03
197	002049	紫光国微	3,800	256,310.00	0.03
198	601600	中国铝业	44,600	251,544.00	0.03
199	688036	传音控股	1,800	249,120.00	0.03
200	001979	招商蛇口	25,807	245,940.71	0.03
201	600570	恒生电子	8,500	244,460.00	0.03
202	601377	兴业证券	41,400	243,018.00	0.03
203	600584	长电科技	8,100	241,866.00	0.03
204	002252	上海莱士	29,900	239,200.00	0.02
205	000776	广发证券	16,700	238,643.00	0.02
206	600029	南方航空	41,200	237,312.00	0.02
207	600115	中国东航	60,700	235,516.00	0.02
208	002460	赣锋锂业	5,500	235,400.00	0.02
209	601669	中国电建	48,000	234,720.00	0.02
210	000661	长春高新	1,600	233,280.00	0.02
211	600547	山东黄金	10,200	233,274.00	0.02
212	300496	中科创达	2,900	232,174.00	0.02
213	600009	上海机场	7,000	229,460.00	0.02
214	600426	华鲁恒升	8,300	228,997.00	0.02
215	600886	国投电力	16,600	218,788.00	0.02
216	603799	华友钴业	6,600	217,338.00	0.02
217	000596	古井贡酒	900	209,520.00	0.02
218	600085	同仁堂	3,900	209,430.00	0.02
219	600745	闻泰科技	4,900	207,319.00	0.02
220	002236	大华股份	11,000	202,950.00	0.02
221	600926	杭州银行	19,800	198,198.00	0.02
222	600845	宝信软件	4,000	195,200.00	0.02
223	601111	中国国航	26,000	190,840.00	0.02

224	002271	东方雨虹	9,900	190,080.00	0.02
225	002311	海大集团	4,100	184,131.00	0.02
226	601689	拓普集团	2,500	183,750.00	0.02
227	600989	宝丰能源	12,300	181,671.00	0.02
228	002920	德赛西威	1,400	181,314.00	0.02
229	603993	洛阳钼业	34,300	178,360.00	0.02
230	300896	爱美客	600	176,598.00	0.02
231	601633	长城汽车	6,900	174,018.00	0.02
232	300033	同花顺	1,100	172,557.00	0.02
233	603369	今世缘	3,500	170,625.00	0.02
234	601066	中信建投	7,200	170,352.00	0.02
235	000977	浪潮信息	5,000	166,000.00	0.02
236	601100	恒立液压	3,000	164,040.00	0.02
237	600674	川投能源	10,800	163,296.00	0.02
238	601360	三六零	17,300	155,873.00	0.02
239	000895	双汇发展	5,800	154,918.00	0.02
240	601878	浙商证券	14,500	151,235.00	0.02
241	600600	青岛啤酒	2,000	149,500.00	0.02
242	002709	天赐材料	5,700	142,956.00	0.01
243	300661	圣邦股份	1,600	142,416.00	0.01
244	300316	晶盛机电	3,200	141,088.00	0.01
245	002601	龙佰集团	8,200	140,466.00	0.01
246	002821	凯莱英	1,200	139,320.00	0.01
247	300450	先导智能	5,400	138,240.00	0.01
248	300347	泰格医药	2,500	137,425.00	0.01
249	601021	春秋航空	2,700	135,540.00	0.01
250	300759	康龙化成	4,400	127,512.00	0.01
251	002648	卫星化学	8,300	122,425.00	0.01
252	002736	国信证券	14,000	119,560.00	0.01
253	000786	北新建材	5,000	116,800.00	0.01
254	601117	中国化学	17,900	113,844.00	0.01
255	002410	广联达	6,640	113,809.60	0.01
256	601872	招商轮船	18,200	107,016.00	0.01
257	688303	大全能源	3,600	106,452.00	0.01
258	601799	星宇股份	800	104,888.00	0.01
259	600183	生益科技	5,700	104,367.00	0.01
260	603659	璞泰来	4,800	100,464.00	0.01
261	000408	藏格矿业	3,900	98,826.00	0.01
262	688223	晶科能源	11,100	98,346.00	0.01
263	600460	士兰微	4,100	93,603.00	0.01
264	300751	迈为股份	700	90,657.00	0.01
265	300223	北京君正	1,400	90,510.00	0.01
266	603290	斯达半导	500	90,500.00	0.01

267	600132	重庆啤酒	1,300	86,385.00	0.01
268	600025	华能水电	10,000	86,300.00	0.01
269	601865	福莱特	3,200	85,440.00	0.01
270	000069	华侨城 A	24,300	75,573.00	0.01
271	300628	亿联网络	2,500	73,875.00	0.01
272	688363	华熙生物	1,100	73,623.00	0.01
273	605499	东鹏饮料	400	73,004.00	0.01
274	603899	晨光股份	1,800	67,590.00	0.01
275	603195	公牛集团	700	66,955.00	0.01
276	600018	上港集团	13,600	66,640.00	0.01
277	601236	红塔证券	7,900	59,961.00	0.01
278	601155	新城控股	5,000	57,050.00	0.01
279	600606	绿地控股	23,500	54,050.00	0.01
280	688065	凯赛生物	900	49,482.00	0.01
281	688187	时代电气	1,300	47,229.00	0.00
282	000800	一汽解放	4,600	39,100.00	0.00
283	300979	华利集团	700	36,848.00	0.00
284	001289	龙源电力	700	13,867.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	688347	华虹公司	21,478	903,364.68	0.09
2	300385	雪浪环境	86,700	582,624.00	0.06
3	301002	崧盛股份	27,400	568,276.00	0.06
4	301006	迈拓股份	30,000	543,300.00	0.06
5	300371	汇中股份	43,000	524,170.00	0.05
6	300839	博汇股份	48,900	500,247.00	0.05
7	000668	荣丰控股	38,500	488,950.00	0.05
8	300243	瑞丰高材	43,200	422,064.00	0.04
9	603214	爱婴室	24,500	400,820.00	0.04
10	600854	春兰股份	73,900	389,453.00	0.04
11	002811	郑中设计	39,100	385,135.00	0.04
12	603389	亚振家居	53,900	357,357.00	0.04
13	002871	伟隆股份	30,600	342,108.00	0.04
14	600969	郴电国际	51,100	332,150.00	0.03
15	600883	博闻科技	38,700	328,950.00	0.03
16	301055	张小泉	20,200	291,284.00	0.03
17	301326	捷邦科技	6,300	252,693.00	0.03
18	002591	恒大高新	35,500	252,405.00	0.03
19	002571	德力股份	37,800	252,126.00	0.03
20	002209	达意隆	22,900	251,900.00	0.03
21	300652	雷迪克	9,100	251,615.00	0.03

22	301024	霍普股份	8,300	251,490.00	0.03
23	002199	东晶电子	26,700	250,446.00	0.03
24	002112	三变科技	23,800	249,424.00	0.03
25	301068	大地海洋	8,200	249,280.00	0.03
26	003010	若羽臣	12,300	249,198.00	0.03
27	300484	蓝海华腾	19,700	248,811.00	0.03
28	301233	盛帮股份	5,600	248,752.00	0.03
29	301040	中环海陆	13,100	248,507.00	0.03
30	600099	林海股份	24,300	248,346.00	0.03
31	301135	瑞德智能	10,000	248,200.00	0.03
32	300283	温州宏丰	39,000	248,040.00	0.03
33	300162	雷曼光电	30,600	247,860.00	0.03
34	603895	天永智能	9,600	247,488.00	0.03
35	301359	东南电子	9,300	247,473.00	0.03
36	603928	兴业股份	18,500	247,345.00	0.03
37	605258	协和电子	8,900	247,153.00	0.03
38	301107	瑜欣电子	7,700	247,093.00	0.03
39	300549	优德精密	12,900	247,035.00	0.03
40	300486	东杰智能	35,700	246,687.00	0.03
41	301161	唯万密封	12,200	246,684.00	0.03
42	301163	宏德股份	9,100	246,610.00	0.03
43	301226	祥明智能	10,800	246,564.00	0.03
44	300756	金马游乐	15,200	246,240.00	0.03
45	301125	腾亚精工	13,000	245,960.00	0.03
46	603963	大理药业	20,700	245,916.00	0.03
47	300329	海伦钢琴	33,000	245,850.00	0.03
48	002012	凯恩股份	43,900	245,840.00	0.03
49	300153	科泰电源	30,800	245,784.00	0.03
50	300651	金陵体育	12,300	245,754.00	0.03
51	603580	艾艾精工	16,500	245,685.00	0.03
52	301361	众智科技	10,300	245,552.00	0.03
53	603978	深圳新星	14,800	245,384.00	0.03
54	003042	中农联合	13,200	245,256.00	0.03
55	002715	登云股份	15,100	245,073.00	0.03
56	603331	百达精工	18,700	244,970.00	0.03
57	300720	海川智能	17,600	244,816.00	0.03
58	605298	必得科技	15,700	244,763.00	0.03
59	003027	同兴环保	13,400	244,684.00	0.03
60	002134	天津普林	22,300	244,631.00	0.03
61	301003	江苏博云	9,800	244,608.00	0.03
62	301008	宏昌科技	8,100	244,539.00	0.03
63	603937	丽岛新材	19,300	244,531.00	0.03
64	300836	佰奥智能	8,600	244,412.00	0.03

65	001256	炜冈科技	13,200	244,332.00	0.03
66	301231	荣信文化	9,600	244,320.00	0.03
67	300141	和顺电气	23,400	244,296.00	0.03
67	300594	朗进科技	11,700	244,296.00	0.03
68	301197	工大科雅	13,000	244,270.00	0.03
69	300816	艾可蓝	9,900	244,233.00	0.03
70	003011	海象新材	11,500	244,145.00	0.03
71	301063	海锅股份	10,700	243,960.00	0.03
72	301388	欣灵电气	10,000	243,900.00	0.03
73	603813	原尚股份	15,100	243,865.00	0.03
74	301237	和顺科技	8,000	243,760.00	0.03
75	603725	天安新材	21,900	243,747.00	0.03
76	002853	皮阿诺	18,900	243,621.00	0.03
77	300611	美力科技	21,200	243,588.00	0.03
78	300515	三德科技	21,100	243,494.00	0.03
79	300771	智莱科技	22,400	243,488.00	0.03
80	600749	西藏旅游	20,700	243,432.00	0.03
81	605100	华丰股份	15,300	243,423.00	0.03
82	301192	泰祥股份	10,600	243,376.00	0.03
83	603988	中电电机	21,400	243,318.00	0.03
84	301283	聚胶股份	7,400	243,312.00	0.03
85	300539	横河精密	19,600	243,236.00	0.03
86	301037	保立佳	12,200	243,146.00	0.03
87	300731	科创新源	11,600	243,136.00	0.03
88	300851	交大思诺	7,800	243,126.00	0.03
89	002105	信隆健康	37,500	243,000.00	0.03
89	002999	天禾股份	32,400	243,000.00	0.03
90	001210	金房能源	12,300	242,925.00	0.03
91	600714	金瑞矿业	25,300	242,880.00	0.03
92	003018	金富科技	22,800	242,820.00	0.03
93	003008	开普检测	8,700	242,817.00	0.03
94	300644	南京聚隆	11,700	242,775.00	0.03
95	300813	泰林生物	9,900	242,748.00	0.03
96	002817	黄山胶囊	27,700	242,652.00	0.03
97	002857	三晖电气	14,700	242,550.00	0.03
98	300641	正丹股份	43,000	242,520.00	0.03
99	300605	恒锋信息	16,200	242,514.00	0.03
100	300828	锐新科技	15,500	242,420.00	0.03
101	301072	中捷精工	9,600	242,400.00	0.03
102	300126	锐奇股份	33,900	242,385.00	0.03
103	001296	长江材料	10,300	242,359.00	0.03
104	603041	美思德	18,000	242,280.00	0.03
105	301043	绿岛风	7,400	242,202.00	0.03

106	002066	瑞泰科技	21,800	242,198.00	0.03
107	002743	富煌钢构	40,500	242,190.00	0.03
108	300838	浙江力诺	14,800	242,128.00	0.03
109	301209	联合化学	9,700	242,112.00	0.03
110	301113	雅艺科技	7,500	242,025.00	0.03
111	301167	建研设计	14,300	241,956.00	0.03
112	300321	同大股份	12,500	241,875.00	0.03
113	603679	华体科技	16,200	241,866.00	0.03
114	603798	康普顿	25,000	241,750.00	0.03
115	603192	汇得科技	12,300	241,695.00	0.03
116	605303	园林股份	19,800	241,560.00	0.03
117	002718	友邦吊顶	14,200	241,542.00	0.03
118	300743	天地数码	17,400	241,512.00	0.03
119	600202	哈空调	38,700	241,488.00	0.03
120	603048	浙江黎明	13,000	241,410.00	0.03
121	605287	德才股份	14,220	241,313.40	0.03
122	301110	青木股份	6,000	241,260.00	0.03
123	603320	迪贝电气	15,161	241,211.51	0.03
124	300649	杭州园林	14,400	241,200.00	0.03
125	002760	凤形股份	11,000	241,120.00	0.03
126	301010	晶雪节能	12,900	241,101.00	0.03
127	000565	渝三峡 A	38,200	241,042.00	0.03
128	603790	雅运股份	17,200	240,972.00	0.03
129	300564	筑博设计	17,900	240,934.00	0.03
130	301235	华康医疗	9,400	240,922.00	0.03
131	300823	建科机械	11,200	240,912.00	0.03
132	301066	万事利	18,700	240,856.00	0.02
133	300810	中科海讯	11,800	240,720.00	0.02
134	603810	丰山集团	18,000	240,660.00	0.02
135	301234	五洲医疗	7,100	240,548.00	0.02
136	002136	安纳达	20,700	240,534.00	0.02
137	301079	邵阳液压	13,900	240,470.00	0.02
138	301279	金道科技	9,700	240,463.00	0.02
139	603102	百合股份	6,200	240,436.00	0.02
140	605255	天普股份	13,700	240,435.00	0.02
141	301365	矩阵股份	15,900	240,408.00	0.02
142	300753	爱朋医疗	14,000	240,380.00	0.02
143	301198	喜悦智行	19,800	240,372.00	0.02
144	300658	延江股份	35,500	240,335.00	0.02
145	002949	华阳国际	17,200	240,284.00	0.02
146	002420	毅昌科技	38,500	240,240.00	0.02
147	301056	森赫股份	23,500	240,170.00	0.02
148	301007	德迈仕	14,200	240,122.00	0.02

149	300717	华信新材	14,300	240,097.00	0.02
150	603045	福达合金	15,200	240,008.00	0.02
151	002084	海鸥住工	60,300	239,994.00	0.02
152	603086	先达股份	40,800	239,904.00	0.02
153	300854	中兰环保	13,748	239,902.60	0.02
154	301077	星华新材	11,800	239,894.00	0.02
155	603616	韩建河山	42,900	239,811.00	0.02
156	300694	蠡湖股份	19,000	239,590.00	0.02
157	002887	绿茵生态	27,600	239,568.00	0.02
158	603221	爱丽家居	24,100	239,554.00	0.02
159	603955	大千生态	16,300	239,447.00	0.02
160	301229	纽泰格	7,200	239,400.00	0.02
161	600193	创兴资源	46,300	239,371.00	0.02
162	300675	建科院	15,800	239,370.00	0.02
163	300746	汉嘉设计	23,800	239,190.00	0.02
164	300749	顶固集创	25,800	239,166.00	0.02
165	000586	汇源通信	19,000	239,020.00	0.02
166	300610	晨化股份	21,200	238,924.00	0.02
167	001288	运机集团	14,200	238,844.00	0.02
168	300640	德艺文创	37,200	238,824.00	0.02
169	603177	德创环保	20,200	238,764.00	0.02
170	600692	亚通股份	38,300	238,609.00	0.02
171	603316	诚邦股份	35,400	238,596.00	0.02
172	300335	迪森股份	42,600	238,560.00	0.02
172	301057	汇隆新材	14,200	238,560.00	0.02
173	003001	中岩大地	13,200	238,524.00	0.02
174	002998	优彩资源	30,000	238,500.00	0.02
175	301182	凯旺科技	10,200	238,476.00	0.02
176	300562	乐心医疗	20,900	238,469.00	0.02
177	300645	正元智慧	13,100	238,289.00	0.02
178	300703	创源股份	21,200	238,288.00	0.02
179	002802	洪汇新材	18,600	238,266.00	0.02
180	300689	澄天伟业	12,300	238,251.00	0.02
181	002830	名雕股份	16,000	238,240.00	0.02
182	603908	牧高笛	6,400	238,144.00	0.02
183	301148	嘉戎技术	10,800	238,140.00	0.02
184	301119	正强股份	9,200	238,096.00	0.02
185	300692	中环环保	38,400	238,080.00	0.02
186	600539	狮头股份	33,200	238,044.00	0.02
187	603272	联翔股份	14,100	238,008.00	0.02
188	001259	利仁科技	8,400	237,888.00	0.02
189	603238	诺邦股份	17,300	237,875.00	0.02
190	603311	金海高科	23,000	237,820.00	0.02

191	603499	翔港科技	22,100	237,796.00	0.02
192	600791	京能置业	48,900	237,654.00	0.02
193	605069	正和生态	24,200	237,644.00	0.02
194	600857	宁波中百	25,200	237,636.00	0.02
194	603089	正裕工业	20,700	237,636.00	0.02
195	603637	镇海股份	26,400	237,600.00	0.02
196	001268	联合精密	9,500	237,500.00	0.02
197	001231	农心科技	11,400	237,462.00	0.02
198	603321	梅轮电梯	27,800	237,412.00	0.02
199	002357	富临运业	31,400	237,070.00	0.02
200	300234	开尔新材	45,500	237,055.00	0.02
201	003023	彩虹集团	11,700	237,042.00	0.02
202	600356	恒丰纸业	29,700	237,006.00	0.02
203	600235	民丰特纸	38,600	237,004.00	0.02
204	301130	西点药业	8,500	236,980.00	0.02
205	001230	劲旅环境	10,100	236,946.00	0.02
206	605003	众望布艺	12,000	236,880.00	0.02
207	600137	浪莎股份	13,000	236,860.00	0.02
208	002394	联发股份	28,500	236,835.00	0.02
209	000014	沙河股份	21,500	236,715.00	0.02
210	300621	维业股份	20,600	236,694.00	0.02
211	603029	天鹅股份	11,600	236,640.00	0.02
212	600448	华纺股份	71,700	236,610.00	0.02
213	000573	粤宏远 A	70,000	236,600.00	0.02
213	605180	华生科技	16,900	236,600.00	0.02
214	300240	飞力达	35,100	236,574.00	0.02
215	301158	德石股份	14,700	236,523.00	0.02
216	002486	嘉麟杰	81,000	236,520.00	0.02
217	003041	真爱美家	14,200	236,430.00	0.02
217	301081	严牌股份	21,300	236,430.00	0.02
218	301259	艾布鲁	14,300	236,379.00	0.02
219	000985	大庆华科	14,600	236,228.00	0.02
220	002826	易明医药	19,900	236,213.00	0.02
221	603585	苏利股份	16,500	236,115.00	0.02
222	603860	中公高科	7,600	235,980.00	0.02
223	603709	中源家居	13,100	235,800.00	0.02
224	603269	海鸥股份	17,500	235,725.00	0.02
225	600833	第一医药	19,600	235,592.00	0.02
226	301227	森鹰窗业	8,700	235,509.00	0.02
227	603150	万朗磁塑	8,100	235,305.00	0.02
228	300519	新光药业	14,200	235,294.00	0.02
229	603226	菲林格尔	33,800	235,248.00	0.02
230	000605	渤海股份	36,700	235,247.00	0.02

231	600836	上海易连	61,400	235,162.00	0.02
232	002696	百洋股份	35,500	235,010.00	0.02
233	605189	富春染织	14,500	234,900.00	0.02
234	603182	嘉华股份	15,900	234,843.00	0.02
235	300819	聚杰微纤	15,100	234,805.00	0.02
236	603506	南都物业	21,600	234,792.00	0.02
237	002144	宏达高科	20,200	234,724.00	0.02
238	600802	福建水泥	45,300	234,654.00	0.02
239	600051	宁波联合	32,500	234,650.00	0.02
240	603059	倍加洁	10,400	234,624.00	0.02
241	600493	凤竹纺织	34,900	234,528.00	0.02
242	603183	建研院	50,200	234,434.00	0.02
243	001211	双枪科技	9,700	234,352.00	0.02
244	002778	中晟高科	15,600	234,312.00	0.02
245	002492	恒基达鑫	39,100	234,209.00	0.02
246	000608	阳光股份	81,300	234,144.00	0.02
247	301276	嘉曼服饰	9,600	234,048.00	0.02
248	301156	美农生物	12,400	233,864.00	0.02
249	000590	启迪药业	26,100	233,856.00	0.02
250	600689	上海三毛	20,200	233,714.00	0.02
251	002899	英派斯	14,100	233,355.00	0.02
252	605033	美邦股份	13,000	233,350.00	0.02
253	002883	中设股份	19,000	233,320.00	0.02
254	002910	庄园牧场	21,300	233,022.00	0.02
255	001336	楚环科技	8,100	232,632.00	0.02
256	300030	阳普医疗	30,000	232,500.00	0.02
257	603151	邦基科技	15,400	232,386.00	0.02
258	600082	海泰发展	67,300	232,185.00	0.02
259	300405	科隆股份	35,900	231,914.00	0.02
260	002691	冀凯股份	30,900	231,441.00	0.02
261	600232	金鹰股份	38,100	230,886.00	0.02
262	000632	三木集团	50,500	230,785.00	0.02
263	600538	国发股份	49,700	230,608.00	0.02
264	600097	开创国际	21,500	229,835.00	0.02
265	600573	惠泉啤酒	22,000	228,360.00	0.02
266	002780	三夫户外	18,000	225,180.00	0.02
267	605336	帅丰电器	12,200	181,536.00	0.02
268	605155	西大门	5,700	88,236.00	0.01
269	002620	瑞和股份	14,700	79,086.00	0.01
270	002775	文科股份	15,600	62,400.00	0.01
271	301526	国际复材	9,723	43,267.35	0.00
272	688548	广钢气体	2,816	35,904.00	0.00
273	301487	盟固利	867	35,512.32	0.00

274	688549	中巨芯	4,294	34,738.46	0.00
275	688563	航材股份	555	33,571.95	0.00
276	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.00
277	688702	盛科通信	549	26,450.82	0.00
278	688582	芯动联科	648	25,058.16	0.00
279	301486	致尚科技	482	22,774.50	0.00
280	301559	中集环科	1,243	22,672.32	0.00
281	301511	德福科技	982	22,261.94	0.00
282	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
283	301498	乖宝宠物	554	21,500.74	0.00
284	301525	儒竞科技	246	20,039.16	0.00
285	301370	国科恒泰	1,240	19,852.40	0.00
286	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
287	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
288	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
289	688591	泰凌微	681	19,081.62	0.00
290	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
291	301172	君逸数码	438	16,714.08	0.00
292	301362	民爆光电	420	16,178.40	0.00
293	301371	敷尔佳	429	16,121.82	0.00
294	688612	威迈斯	422	16,023.34	0.00
295	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
296	688610	埃科光电	275	14,025.00	0.00
297	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
298	301332	德尔玛	1,122	13,710.84	0.00
299	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
300	301210	金杨股份	281	12,779.88	0.00
301	301566	C 达利凯普	576	12,752.64	0.00
302	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
303	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
304	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
305	301292	海科新源	583	11,281.05	0.00
306	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
307	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
308	688592	司南导航	216	10,914.48	0.00
309	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
310	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
311	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
312	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
313	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
314	301372	科净源	231	10,069.29	0.00
315	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
316	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00

317	301395	仁信新材	520	9,718.80	0.00
318	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
319	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
320	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
321	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
322	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
323	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
324	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
325	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
326	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
327	688638	誉辰智能	141	8,414.88	0.00
328	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
329	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
330	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
331	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
332	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
333	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
334	301578	C 辰奕智能	118	8,061.76	0.00
335	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
336	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
337	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
338	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
339	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
340	603275	众辰科技	193	7,662.10	0.00
341	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
342	603062	麦加芯彩	126	7,284.06	0.00
343	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
344	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
345	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
346	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
347	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
348	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
349	603004	C 鼎龙	195	6,082.05	0.00
350	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
351	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
352	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
353	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
354	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
355	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00
356	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
357	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
358	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
359	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00

360	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
361	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
362	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600519	贵州茅台	40,219,860.30	5.79
2	300763	锦浪科技	39,614,899.15	5.71
3	000069	华侨城 A	36,649,779.00	5.28
4	688561	奇安信	35,780,638.98	5.16
5	300769	德方纳米	34,398,096.02	4.96
6	002027	分众传媒	34,337,017.00	4.95
7	002555	三七互娱	34,082,698.00	4.91
8	601155	新城控股	32,345,932.00	4.66
9	002230	科大讯飞	32,048,744.14	4.62
10	600039	四川路桥	30,085,043.60	4.33
11	600741	华域汽车	28,926,691.76	4.17
12	000963	华东医药	28,631,531.00	4.13
13	688599	天合光能	27,658,123.97	3.98
14	601989	中国重工	27,155,577.00	3.91
15	000938	紫光股份	26,894,526.77	3.87
16	300433	蓝思科技	26,555,408.00	3.83
17	002074	国轩高科	26,425,007.00	3.81
18	601117	中国化学	25,866,548.00	3.73
19	603986	兆易创新	25,603,554.00	3.69
20	000768	中航西飞	25,283,139.58	3.64
21	600061	国投资本	25,118,934.14	3.62
22	000661	长春高新	24,396,198.00	3.51
23	603501	韦尔股份	22,705,284.85	3.27
24	601728	中国电信	22,577,523.00	3.25
25	601888	中国中免	22,556,440.00	3.25
26	600999	招商证券	22,237,513.40	3.20
27	601615	明阳智能	21,794,644.44	3.14
28	688126	沪硅产业	21,741,621.59	3.13
29	000425	徐工机械	21,640,051.00	3.12
30	000800	一汽解放	21,615,244.67	3.11
31	300454	深信服	21,472,815.00	3.09
32	601319	中国人保	21,190,677.00	3.05
33	000977	浪潮信息	20,850,529.58	3.00
34	000858	五粮液	20,512,283.00	2.96
35	300014	亿纬锂能	20,448,060.00	2.95

36	300750	宁德时代	20,443,067.85	2.95
37	002475	立讯精密	20,428,215.00	2.94
38	600115	中国东航	20,406,057.00	2.94
39	600176	中国巨石	20,306,171.70	2.93
40	601138	工业富联	20,268,145.00	2.92
41	002180	纳思达	20,031,272.23	2.89
42	600332	白云山	20,025,418.00	2.89
43	000063	中兴通讯	19,808,682.00	2.85
44	601607	上海医药	19,747,822.00	2.85
45	000333	美的集团	19,677,743.00	2.84
46	002736	国信证券	19,612,305.00	2.83
47	000002	万科 A	19,532,117.00	2.81
48	002938	鹏鼎控股	19,331,330.00	2.79
49	002001	新和成	19,180,709.50	2.76
50	601169	北京银行	18,820,659.00	2.71
51	600104	上汽集团	18,642,370.09	2.69
52	600584	长电科技	18,523,901.99	2.67
53	300751	迈为股份	18,431,894.60	2.66
54	601878	浙商证券	18,367,984.00	2.65
55	601088	中国神华	18,294,910.00	2.64
56	300274	阳光电源	18,234,640.00	2.63
57	601877	正泰电器	18,201,895.00	2.62
58	000723	美锦能源	18,160,803.64	2.62
59	600362	江西铜业	18,130,247.39	2.61
60	601398	工商银行	17,849,832.00	2.57
61	300498	温氏股份	17,839,231.74	2.57
62	600795	国电电力	17,627,134.00	2.54
63	300033	同花顺	17,468,830.00	2.52
64	600015	华夏银行	17,398,010.60	2.51
65	600893	航发动力	17,352,465.14	2.50
66	600048	保利发展	17,030,119.00	2.45
67	600875	东方电气	16,963,988.00	2.44
68	300919	中伟股份	16,941,192.62	2.44
69	300759	康龙化成	16,794,132.00	2.42
70	601360	三六零	16,719,160.00	2.41
71	000166	申万宏源	16,681,371.42	2.40
72	603185	弘元绿能	16,461,089.15	2.37
73	600383	金地集团	16,420,975.00	2.37
74	002241	歌尔股份	16,260,946.58	2.34
75	600233	圆通速递	16,169,256.00	2.33
76	600754	锦江酒店	16,150,350.00	2.33
77	688111	金山办公	15,975,792.74	2.30
78	600588	用友网络	15,956,475.77	2.30

79	601377	兴业证券	15,944,789.00	2.30
80	601766	中国中车	15,888,895.00	2.29
81	600426	华鲁恒升	15,845,917.00	2.28
82	601166	兴业银行	15,769,122.00	2.27
83	001979	招商蛇口	15,660,892.80	2.26
84	603369	今世缘	15,637,505.00	2.25
85	000725	京东方 A	15,626,772.00	2.25
86	688012	中微公司	15,614,559.90	2.25
87	000100	TCL 科技	15,486,248.71	2.23
88	601689	拓普集团	15,428,130.00	2.22
89	601216	君正集团	15,248,415.00	2.20
90	002841	视源股份	15,087,765.00	2.17
91	600958	东方证券	15,008,635.68	2.16
92	000625	长安汽车	14,993,654.00	2.16
93	601838	成都银行	14,892,704.29	2.15
94	601669	中国电建	14,855,275.00	2.14
95	002821	凯莱英	14,851,210.88	2.14
96	601808	中海油服	14,810,142.00	2.13
97	002648	卫星化学	14,615,777.84	2.11
98	300496	中科创达	14,435,304.07	2.08
99	002602	世纪华通	14,389,161.97	2.07
100	300595	欧普康视	14,218,396.86	2.05
101	002007	华兰生物	14,100,773.70	2.03
102	002120	韵达股份	14,086,570.58	2.03
103	600884	杉杉股份	14,034,202.98	2.02
104	002916	深南电路	13,923,586.00	2.01

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。

8.4.2 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	002027	分众传媒	42,020,494.74	6.05
2	300763	锦浪科技	41,780,916.62	6.02
3	601155	新城控股	41,468,651.00	5.97
4	603986	兆易创新	39,040,697.00	5.62
5	002230	科大讯飞	36,248,136.43	5.22
6	000069	华侨城 A	33,621,725.00	4.84
7	300769	德方纳米	32,994,683.68	4.75
8	002555	三七互娱	31,633,633.00	4.56
9	600795	国电电力	30,978,421.00	4.46
10	600039	四川路桥	30,136,031.98	4.34

11	688561	奇安信	29,876,581.60	4.30
12	601166	兴业银行	29,096,143.08	4.19
13	002241	歌尔股份	28,962,847.56	4.17
14	601689	拓普集团	28,961,831.13	4.17
15	002050	三花智控	27,308,268.00	3.93
16	688012	中微公司	27,250,648.83	3.93
17	600383	金地集团	26,853,811.00	3.87
18	000063	中兴通讯	25,041,708.42	3.61
19	603185	弘元绿能	25,020,580.49	3.60
20	601117	中国化学	24,828,855.00	3.58
21	300595	欧普康视	24,653,914.52	3.55
22	600036	招商银行	23,944,577.32	3.45
23	000800	一汽解放	23,088,862.91	3.33
24	603501	韦尔股份	22,723,150.84	3.27
25	601989	中国重工	22,490,161.00	3.24
26	000977	浪潮信息	22,278,198.53	3.21
27	002074	国轩高科	21,477,171.01	3.09
28	002271	东方雨虹	21,464,483.50	3.09
29	000661	长春高新	20,925,163.84	3.01
30	600519	贵州茅台	20,708,635.68	2.98
31	000963	华东医药	20,471,569.00	2.95
32	002736	国信证券	20,098,295.00	2.90
33	601225	陕西煤业	20,039,128.00	2.89
34	600009	上海机场	19,843,523.00	2.86
35	600999	招商证券	19,806,555.00	2.85
36	688599	天合光能	19,804,476.88	2.85
37	000425	徐工机械	19,762,070.00	2.85
38	000938	紫光股份	19,660,557.44	2.83
39	601658	邮储银行	19,623,771.00	2.83
40	603259	药明康德	19,534,696.00	2.81
41	600115	中国东航	19,165,759.00	2.76
42	601888	中国中免	19,159,706.00	2.76
43	601878	浙商证券	19,101,198.00	2.75
44	600584	长电科技	18,928,616.00	2.73
45	600176	中国巨石	18,696,613.31	2.69
46	002475	立讯精密	18,515,697.00	2.67
47	300750	宁德时代	18,378,803.20	2.65
48	600188	兖矿能源	18,300,301.00	2.64
49	000723	美锦能源	18,041,790.17	2.60
50	600919	江苏银行	18,001,141.00	2.59
51	002602	世纪华通	17,765,488.01	2.56
52	300454	深信服	17,625,940.00	2.54
53	002821	凯莱英	17,568,403.58	2.53

54	300033	同花顺	17,378,350.00	2.50
55	688111	金山办公	16,918,409.87	2.44
56	601899	紫金矿业	16,863,902.00	2.43
57	300433	蓝思科技	16,331,825.00	2.35
58	300496	中科创达	16,184,953.24	2.33
59	688008	澜起科技	16,115,890.77	2.32
60	600741	华域汽车	15,994,933.00	2.30
61	600015	华夏银行	15,909,266.51	2.29
62	002920	德赛西威	15,805,687.92	2.28
63	000166	申万宏源	15,764,887.00	2.27
64	688005	容百科技	15,669,744.88	2.26
65	300751	迈为股份	15,611,058.13	2.25
66	300014	亿纬锂能	15,545,600.00	2.24
67	601615	明阳智能	15,513,340.00	2.24
68	605117	德业股份	15,498,594.60	2.23
69	603369	今世缘	15,426,474.96	2.22
70	002180	纳思达	15,162,217.00	2.18
71	601216	君正集团	15,151,228.00	2.18
72	002129	TCL 中环	15,111,579.24	2.18
73	001979	招商蛇口	15,078,294.29	2.17
74	000625	长安汽车	15,052,832.00	2.17
75	300498	温氏股份	14,771,363.00	2.13
76	601377	兴业证券	14,743,957.00	2.12
77	600690	海尔智家	14,738,437.89	2.12
78	300919	中伟股份	14,650,476.00	2.11
79	600061	国投资本	14,409,826.24	2.08
80	601360	三六零	14,302,186.00	2.06
81	000100	TCL 科技	14,228,113.76	2.05
82	000568	泸州老窖	14,179,696.80	2.04
83	600893	航发动力	14,085,629.00	2.03
84	000651	格力电器	13,988,395.40	2.02
85	601808	中海油服	13,950,290.72	2.01

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。

8.4.3 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	3,781,766,442.88
卖出股票收入（成交）总额	3,497,602,693.80

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金于本报告期末未持有债券。

8.6 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

本基金于本报告期末未持有债券。

8.7 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

本基金于本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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

本基金于本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金于本报告期末未持有权证。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金于本报告期内未持有国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金于本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 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	4,704,540.97
2	应收清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,648,946.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,353,487.88

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金于本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688347	华虹公司	903,364.68	0.09	锁定期

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
西部利得沪深 300 指数 A	34,321	11,944.80	205,960,415.54	50.24	203,997,174.92	49.76
西部利得沪深 300 指数 C	55,709	3,969.25	96,412,878.52	43.60	124,709,955.24	56.40
合计	87,410	7,219.77	302,373,294.06	47.91	328,707,130.16	52.09

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

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）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	西部利得沪深 300 指数 A	765,668.64	0.1868
	西部利得沪深 300 指数 C	60,045.44	0.0272
	合计	825,714.08	0.1308

9.3 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	西部利得沪深 300 指数 A	10~50
	西部利得沪深 300 指数 C	-
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	西部利得沪深 300 指数 A	-
	西部利得沪深 300 指数 C	-
	合计	-

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	西部利得沪深 300 指数 A	西部利得沪深 300 指数 C
基金合同生效日（2018 年 12 月 27 日）基金份额总额	18,506,196.98	-
本报告期期初基金份额总额	247,145,583.96	180,843,542.10
本报告期基金总申购份额	233,608,009.95	210,500,996.25
减：本报告期基金总赎回份额	70,796,003.45	170,221,704.59
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	409,957,590.46	221,122,833.76
-------------	----------------	----------------

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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重大人事变动如下：

基金管理人于 2023 年 11 月完成独立董事变更的工商变更备案，由吴弘变更为尚淑莉。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期为本基金审计的会计师事务所改聘为毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)。

本报告期应支付毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审计费人民币 43,000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受到稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	

西部证券	2	2,489,169,788.35	34.30	1,086,358.93	34.45	-
国盛证券	2	1,615,696,288.00	22.26	557,107.92	17.66	-
信达证券	2	1,388,778,661.28	19.14	601,777.38	19.08	-
中信证券	2	878,795,474.92	12.11	387,686.79	12.29	-
中信建投	2	657,459,967.00	9.06	487,686.88	15.46	-
国泰君安	2	157,263,009.14	2.17	22,945.54	0.73	-
广发证券	1	69,958,151.36	0.96	10,205.44	0.32	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
西部证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

中信建投	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

11.8 其他重大事件

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

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准设立的相关文件；
- (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) 报告期内本基金公告的各项原稿。

13.2 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

13.3 查阅方式

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

(2) 网站查询: 基金管理人网址: <http://www.westleadfund.com> 投资人对本报告如有疑问, 可咨询本基金管理人西部利得基金管理有限公司, 咨询电话 4007-007-818 (免长途话费) 或发电子邮件, E-mail: service@westleadfund.com。

西部利得基金管理有限公司

2024 年 3 月 28 日