

西部利得量化成长混合型发起式证券投资  
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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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

<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、基金净值表现及利润分配情况</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	9
3.3 其他指标	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况	11
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>12</b>
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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>16</b>
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真实、准确和完整发表意见	16
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>19</b>
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
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>63</b>
8.1 期末基金资产组合情况	63

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	63
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 .....	64
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	88
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	90
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 .....	90
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 .....	90
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 .....	90
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 .....	90
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	90
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	91
8.12 投资组合报告附注 .....	91
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>92</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	92
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	92
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 .....	92
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	93
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>93</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>94</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	94
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 .....	94
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	94
11.4 基金投资策略的改变 .....	94
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	94
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 .....	94
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	94
11.8 其他重大事件 .....	96
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>96</b>
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 .....	96
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	97
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>97</b>
13.1 备查文件目录 .....	97
13.2 存放地点 .....	97
13.3 查阅方式 .....	97

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金	
基金简称	西部利得量化成长混合	
基金主代码	000006	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 3 月 19 日	
基金管理人	西部利得基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,785,758,194.44 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	西部利得量化成长混合 A	西部利得量化成长混合 C
下属分级基金的交易代码	000006	011228
报告期末下属分级基金的份额总额	1,592,525,025.77 份	1,193,233,168.67 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过量化投资策略进行股票投资，在严格控制风险和保持资产高流动性的前提下，努力实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金主要通过多因子量化投资模型，选取并持有具有成长性的股票构成投资组合，打造成长风格，力争稳定的超越业绩基准的投资收益。（详见《基金合同》）
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*75%+同期银行活期存款利率（税后）*25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，在通常情况下其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		西部利得基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵毅	任航
	联系电话	021-38572888	010-66060069
	电子邮箱	service@westleadfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4007-007-818	95599
传真		021-50710261	010-68121816
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区耀体路 276 号 901 室-908 室	北京市东城区建国门内大街 69 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	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		200126	100031

法定代表人	何方	谷澍
-------	----	----

## 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	2021 年 1 月 13 日(基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日
	西部利得量化成长混合 A	西部利得量化成长混合 C	西部利得量化成长混合 A	西部利得量化成长混合 C	西部利得量化成长混合 A	西部利得量化成长混合 C
本期已实现收益	158,825,820.93	65,080,190.08	260,718,603.97	29,650,006.93	411,256,638.18	17,414,343.96
本期利润	191,050,572.27	42,784,841.44	366,756,044.85	36,015,665.99	371,385,025.99	11,125,135.05
加权平均	0.1687	0.0688	-0.4809	-0.3683	0.4826	0.3258

基金份额 本期利润						
本期加 权平 均净 值利 润率	8.32%	3.45%	-24.32%	-18.96%	21.33%	14.06%
本期基 金份 额净 值增 长率	10.17%	9.31%	-18.79%	-19.42%	28.11%	21.42%
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	1,219,667,4 09.35	855,201,740 .66	492,373,648 .94	64,935,061 .83	831,743,770 .74	44,642,743 .45

利润						
期末可供分配基金份额利润	0.7659	0.7167	0.6268	0.5958	0.9546	0.9362
期末基金资产净值	3,289,545,541.52	2,407,294,427.77	1,472,850,463.68	201,160,965.96	2,011,550,938.18	109,224,751.15
期末基金份额净值	2.0656	2.0175	1.8749	1.8456	2.3087	2.2905
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	138.68%	6.95%	116.64%	-2.17%	166.77%	21.42%



值 增 长 率						
------------------	--	--	--	--	--	--

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

西部利得量化成长混合 A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	1.49%	0.85%	-3.40%	0.65%	4.89%	0.20%
过去六个月	-0.54%	0.82%	-7.09%	0.64%	6.55%	0.18%
过去一年	10.17%	0.82%	-5.39%	0.62%	15.56%	0.20%
过去三年	14.62%	1.29%	-10.31%	0.81%	24.93%	0.48%
自基金合同生效 起至今	138.68%	1.32%	1.21%	0.95%	137.47 %	0.37%

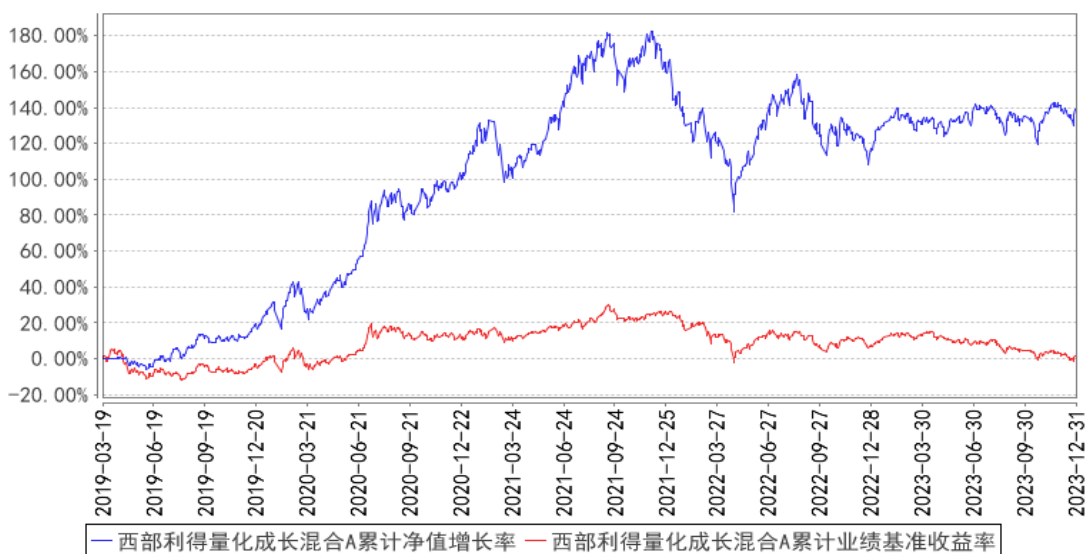
西部利得量化成长混合 C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	1.29%	0.85%	-3.40%	0.65%	4.69%	0.20%
过去六个月	-0.94%	0.82%	-7.09%	0.64%	6.15%	0.18%
过去一年	9.31%	0.82%	-5.39%	0.62%	14.70%	0.20%

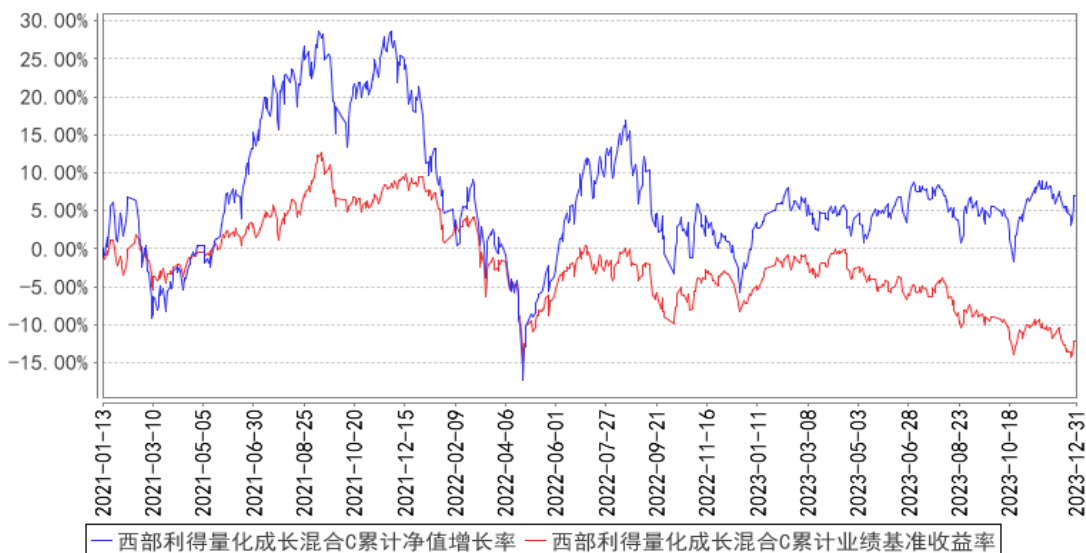
自基金合同生效 起至今	6.95%	1.29%	-12.13%	0.81%	19.08%	0.48%
----------------	-------	-------	---------	-------	--------	-------

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

西部利得量化成长混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

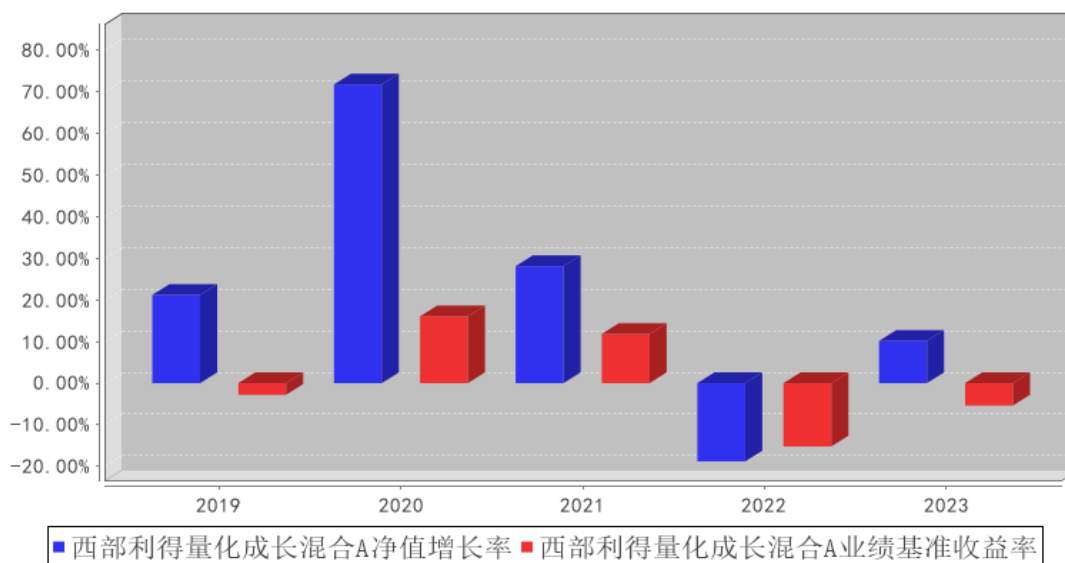


西部利得量化成长混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

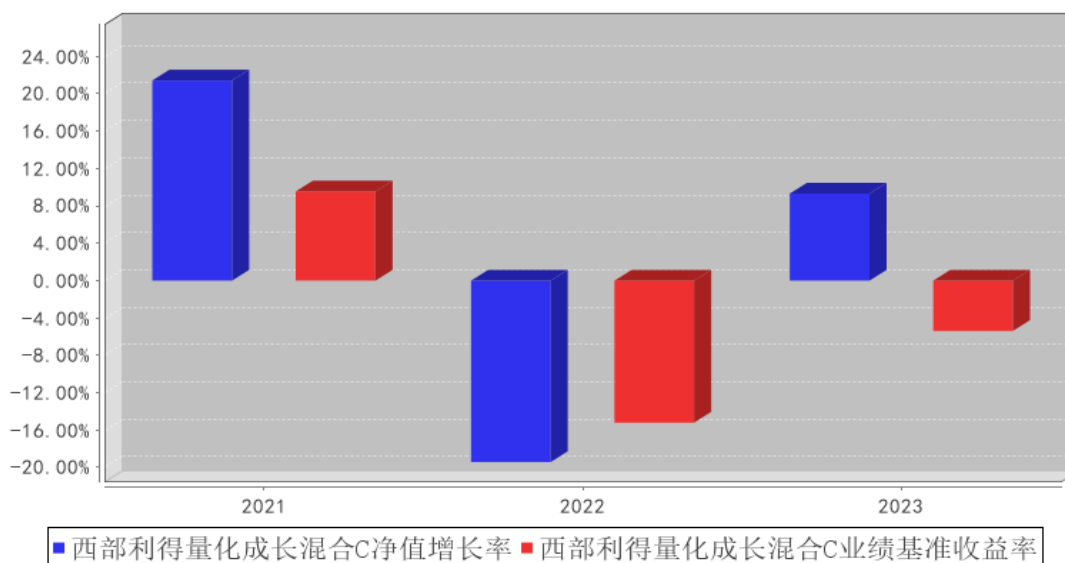


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

西部利得量化成长混合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



西部利得量化成长混合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

单位：人民币元

西部利得量化成长混合 A					
年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2023 年	-	-	-	-	-

2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	2.4000	108,699,015.99	94,833,954.23	203,532,970.22	-
合计	2.4000	108,699,015.99	94,833,954.23	203,532,970.22	-

## 西部利得量化成长混合 C

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2023 年	-	-	-	-	-
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	2.4000	9,497,751.52	3,328,222.15	12,825,973.67	-
合计	2.4000	9,497,751.52	3,328,222.15	12,825,973.67	-

## § 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	2019 年 3 月 19 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

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，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现 1 次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 5%的情况。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 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不明显；负向暴露的风格因子主要为市值、异质波动率。行业配置略参考中证 500 指数，股票持仓极为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中证 500 指数的超额收益，以期打造优质量化基金。

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

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内基金业绩表现参见本报告第三部分“主要财务指标和基金净值表现”。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 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及其适用性的情况，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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——西部利得基金管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，西部利得基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认为，西部利得基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。



## § 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 2402319 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	西部利得量化成长混合型发起式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量化成长混合型发起式证券投资基金（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>

<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 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编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3)评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4)对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。</p> <p>(5)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>张楠 郝斌斌</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03月27日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	490,829,658.84	229,203,823.40
结算备付金		64,870,723.74	6,726,376.83
存出保证金		11,943,943.22	8,396,516.77
交易性金融资产	7.4.7.2	5,131,121,279.23	1,401,526,220.79
其中：股票投资		5,131,121,279.23	1,401,526,220.79
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		65,674,951.81	35,564,263.95
应收股利		-	-
应收申购款		41,608,454.85	1,159,261.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		5,806,049,011.69	1,682,576,462.92
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31日</b>	<b>上年度末 2022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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付清算款		70,367,746.59	-
应付赎回款		23,472,785.16	2,933,064.21
应付管理人报酬		5,709,967.59	2,162,975.92
应付托管费		475,830.63	144,198.38
应付销售服务费		1,661,911.40	139,367.14
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	7,520,801.03	3,185,427.63
负债合计		109,209,042.40	8,565,033.28
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	2,785,758,194.44	894,551,836.89
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	2,911,081,774.85	779,459,592.75
净资产合计		5,696,839,969.29	1,674,011,429.64
负债和净资产总计		5,806,049,011.69	1,682,576,462.92

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，西部利得量化成长混合 A 基金份额净值为 2.0656 元，基金份额总额为 1,592,525,025.77 份；西部利得量化成长混合 C 基金份额净值为 2.0175 元，基金份额总额为 1,193,233,168.67 份。西部利得量化成长混合基金总份额为 2,785,758,194.44 份。

## 7.2 利润表

会计主体：西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金

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
<b>一、营业总收入</b>		293,902,291.32	-373,905,819.80
1. 利息收入		3,048,275.50	1,453,494.14
其中：存款利息收入	7.4.7.13	3,048,275.50	1,453,494.14
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）		278,931,615.22	-264,990,991.98
其中：股票投资收益	7.4.7.14	257,919,425.08	-276,382,844.32
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	-10,596,267.87	-237,167.72
股利收益	7.4.7.19	31,608,458.01	11,629,020.06
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	9,929,402.70	-112,403,099.94
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	1,992,997.90	2,034,777.98
<b>减：二、营业总支出</b>		60,066,877.61	28,865,891.04
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	46,613,707.38	25,421,355.14
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	3,494,246.52	1,694,756.95
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	9,717,896.27	1,506,512.40
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		5,539.57	5,933.93
8. 其他费用	7.4.7.23	235,487.87	237,332.62
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		233,835,413.71	-402,771,710.84
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		233,835,413.71	-402,771,710.84
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		233,835,413.71	-402,771,710.84

### 7.3 净资产变动表

会计主体：西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金

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	894,551,836.89	-	779,459,592.75	1,674,011,429.64
二、本期期初净资产	894,551,836.89	-	779,459,592.75	1,674,011,429.64
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,891,206,357.55	-	2,131,622,182.10	4,022,828,539.65
(一)、综合收益总额	-	-	233,835,413.71	233,835,413.71
(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)	1,891,206,357.55	-	1,897,786,768.39	3,788,993,125.94
其中：1. 基金申购款	2,737,948,264.70	-	2,753,447,229.38	5,491,395,494.08
2. 基金赎回款	-	-	-	-
	846,741,907.15	-	855,660,460.99	1,702,402,368.14
(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	2,785,758,194.44	-	2,911,081,774.85	5,696,839,969.29
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	918,971,587.91	-	1,201,804,101.42	2,120,775,689.33
二、本期期初净资产	918,971,587.91	-	1,201,804,101.42	2,120,775,689.33
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-24,419,751.02	-	-	-446,764,259.69
			422,344,508.67	

(一)、综合收益总额	-	-	- 402,771,710.84	-402,771,710.84
(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)	-24,419,751.02	-	-19,572,797.83	-43,992,548.85
其中：1. 基金申购款	793,040,274.23	-	799,849,700.70	1,592,889,974.93
2. 基金赎回款	- 817,460,025.25	-	- 819,422,498.53	- 1,636,882,523.78
(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	894,551,836.89	-	779,459,592.75	1,674,011,429.64

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：

贺燕萍

基金管理人负责人

贺燕萍

主管会计工作负责人

张皞骏

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

西部利得量化成长混合型发起式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[2018]第 189 号《关于准予西部利得量化阿尔法混合型证券投资基金变更注册的批复》核准,由西部利得基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《西部利得量化成长混合型发起式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 177,836,375.57 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 1900164 号验资报告予以验证。经向中国证监会

备案,《西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2019 年 3 月 19 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 177,856,344.09 份基金份额,其中认购资金利息折合 19,968.52 份基金份额。本基金的基金管理人为西部利得基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《西部利得量化成长混合型发起式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、企业债、公司债、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债券、短期融资券(含超短期融资券)、中期票据、资产支持证券、次级债券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、权证、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)。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 60%-95%。基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%;本基金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。

本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率\*75%+同期银行活期存款利率(税后)\*25%。

#### 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《西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金基金合同》的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 10 次，每次收益分配比例不得低于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相应类别的基金份额进行再投资；投资者可对 A 类基金份额和 C 类基金份额分别选择不同的收益分配方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后各类基金份额的基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，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，基金管理人可在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后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，但应于变更实施日前在指定媒介公告。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众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

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

## 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	490,829,658.84	229,203,823.40
等于：本金	490,732,794.76	229,149,730.77
加：应计利息	96,864.08	54,092.63
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	490,829,658.84	229,203,823.40

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	5,193,309,867.51	-	5,131,121,279.23	-62,188,588.28
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	5,193,309,867.51	-	5,131,121,279.23	-62,188,588.28
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	1,472,956,591.77	-	1,401,526,220.79	-71,430,370.98
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	1,472,956,591.77	-	1,401,526,220.79	-71,430,370.98

## 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	85,543,380.00	-	-	-
其中： 股指期货投资	85,543,380.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	85,543,380.00	-	-	-
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	55,463,240.00	-	-	-
其中： 股指期货投资	55,463,240.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	55,463,240.00	-	-	-

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
IC2401	IC2401	78.00	84,814,080.00	-729,300.00
合计				-729,300.00
减：可抵销期货暂收款				-729,300.00
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**

本基金本报告期末及上年度期末均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**

本基金本报告期末及上年度期末均无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**

本基金本报告期及上年度可比期间均未持有债权投资。

**7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

本基金本报告期末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**

本基金本报告期及上年度可比期间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**

本基金本报告期末发生其他债权投资减值准备。

**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**

本基金本报告期及上年度可比期间均未持有其他权益工具投资。

## 7.4.7.8 其他资产

本基金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	518.21	464.14
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	7,218,282.82	2,994,963.49
其中：交易所市场	7,218,282.82	2,994,963.49
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	302,000.00	190,000.00
合计	7,520,801.03	3,185,427.63

## 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 西部利得量化成长混合 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	785,555,877.51	785,555,877.51
本期申购	1,264,559,138.04	1,264,559,138.04
本期赎回（以“-”号填列）	-457,589,989.78	-457,589,989.78
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	1,592,525,025.77	1,592,525,025.77

## 西部利得量化成长混合 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	108,995,959.38	108,995,959.38
本期申购	1,473,389,126.66	1,473,389,126.66
本期赎回（以“-”号填列）	-389,151,917.37	-389,151,917.37
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	1,193,233,168.67	1,193,233,168.67

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

西部利得量化成长混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	492,373,648.94	194,920,937.23	687,294,586.17
本期期初	492,373,648.94	194,920,937.23	687,294,586.17
本期利润	158,825,820.93	32,224,751.34	191,050,572.27
本期基金份额交易产生的变动数	568,467,939.48	250,207,417.83	818,675,357.31
其中：基金申购款	898,271,606.17	393,162,413.89	1,291,434,020.06
基金赎回款	-329,803,666.69	-142,954,996.06	-472,758,662.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,219,667,409.35	477,353,106.40	1,697,020,515.75

西部利得量化成长混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	64,935,061.83	27,229,944.75	92,165,006.58
本期期初	64,935,061.83	27,229,944.75	92,165,006.58
本期利润	65,080,190.08	-22,295,348.64	42,784,841.44
本期基金份额交易产生的变动数	725,186,488.75	353,924,922.33	1,079,111,411.08
其中：基金申购款	994,169,963.09	467,843,246.23	1,462,013,209.32
基金赎回款	-268,983,474.34	-113,918,323.90	-382,901,798.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	855,201,740.66	358,859,518.44	1,214,061,259.10

## 7.4.7.13 存款利息收入

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
活期存款利息收入	2,685,861.83	1,261,260.68
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	253,700.03	143,558.94
其他	108,713.64	48,674.52
合计	3,048,275.50	1,453,494.14

注：其他为结算保证金利息收入和直销申购款利息收入。

## 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	257,919,425.08	-276,382,844.32
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	257,919,425.08	-276,382,844.32

#### 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	18,352,014,048.92	12,029,808,810.46
减：卖出股票成本 总额	18,056,215,273.58	12,278,963,989.43
减：交易费用	37,879,350.26	27,227,665.35
买卖股票差价收 入	257,919,425.08	-276,382,844.32

#### 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股票出借差价收入。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

##### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

##### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

#### 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。

##### 7.4.7.16.3 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

本基金本报告期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

本基金本报告期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

本基金本报告期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

本基金本报告期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

本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖权证差价收入。

##### 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	-10,596,267.87	-237,167.72

#### 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	31,608,458.01	11,629,020.06

收益		
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	31,608,458.01	11,629,020.06

#### 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	9,241,782.70	-110,933,012.81
股票投资	9,241,782.70	-110,933,012.81
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	687,620.00	-1,471,880.00
权证投资	-	-
期货投资	687,620.00	-1,471,880.00
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价 值变动产生的预估增值税	-	-1,792.87
合计	9,929,402.70	-112,403,099.94

#### 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	1,984,965.13	1,968,244.09
基金转换费收入	8,032.77	64,603.17
其他	-	1,930.72
合计	1,992,997.90	2,034,777.98

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	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
审计费用	62,000.00	70,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	53,487.87	47,332.62
合计	235,487.87	237,332.62

#### 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
中国农业银行股份有限公司	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

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。

###### 7.4.10.1.2 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。

###### 7.4.10.1.3 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。

#### 7.4.10.1.4 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。

#### 7.4.10.1.5 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。

#### 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	46,613,707.38	25,421,355.14
其中：应支付销售机构的客户维护费	7,826,430.73	5,560,016.89
应支付基金管理人的净管理费	38,787,276.65	19,861,338.25

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一定比例的年费率计提，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 × 1.5% / 当年天数（2022年1月1日至2023年7月30日）

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.2% / 当年天数（自2023年7月31日起）

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

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托管费	3,494,246.52	1,694,756.95

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值一定比例的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 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		
	西部利得量化成长混 合 A	西部利得量化成长混 合 C	合计

农业银行	-	-	-
西部利得基金	-	5,755,046.66	5,755,046.66
西部证券	-	7,400.46	7,400.46
合计	-	5,762,447.12	5,762,447.12
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		
	西部利得量化成长混合 A	西部利得量化成长混合 C	合计
农业银行	-	-	-
西部利得基金	-	722,150.67	722,150.67
西部证券	-	6,373.60	6,373.60
合计	-	728,524.27	728,524.27

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 0.8% 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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.8\% / \text{当年天数}。$$

#### 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。

#### 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

本基金本报告期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

本基金本报告期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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	西部利得量化成长混合 A	西部利得量化成长混合 C
基金合同生效日（2019年3	10,000,600.00	-

月 19 日) 持有的基金份额		
报告期初持有的基金份额	5,050,605.20	-
报告期间申购/买入总份额	2,579,330.27	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	7,629,935.47	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.2739%	-
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	西部利得量化成长混合 A	西部利得量化成长混合 C
基金合同生效日 (2019 年 3 月 19 日) 持有的基金份额	10,000,600.00	-
报告期初持有的基金份额	10,000,605.20	-
报告期间申购/买入总份额	0.00	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	4,950,000.00	-
报告期末持有的基金份额	5,050,605.20	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.5646%	-

注: 本基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资西部利得量化成长混合 C。

#### 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
中国农业银行股份有限公司	490,829,658.84	2,685,861.83	229,203,823.40	1,261,260.68

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

2. 本基金通过“中国农业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 18,316,273。

37 元（2022 年 12 月 31 日：人民币 5,757,986.80 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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末进行利润分配。

#### 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	2023 年	6 个月	锁定	31.68	31.27	205	6,494.40	6,410.35	-

	新材	10月23日		期						
002735	王子新材	2023年12月27日	6个月	新股未上市	10.39	12.19	2,887,391	29,999,992.49	35,197,296.29	-
300162	雷曼光电	2023年12月29日	6个月	新股未上市	6.59	7.65	4,552,352	29,999,999.68	34,825,492.80	-
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	-

		日								
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	564	31,403.52	21,195.12	-
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	2023	6个月	锁	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-

	昌科技	年8月10日	月	定期							
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	2023	6个	锁	39.99	38.81	554	22,154.46	21,500.74	-	



	宝宠物	年8月9日	月	定期							
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	2023年	6个月	锁定	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-	

	华达	10月9日		期						
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	266	26,485.62	21,668.36	-
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	2023年	6个月	锁定	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-

	新材	10月24日		期							
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	1,315	31,849.30	23,985.60	-	
301566	C 达利凯普	2023年12月22日	6个月	锁定期	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-	
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	金帝股份	2023年8月25日	6个月	锁定期	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-
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	2023年8月	6个月	锁定期	49.97	39.70	193	9,644.21	7,662.10	-

	科技	月 16 日		期						
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	56,173	2,920,996.00	2,362,636.38	-
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	4,048	39,953.76	51,612.00	-
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	1,436	113,429.64	86,863.64	-
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	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	2023 年 11	6个 月	锁 定 期	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-

	技	月6日								
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	京仪装备	2023年11月22日	6个月	锁定期	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-
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	2023年9月	6个月	锁定	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-

	赛博	月 20 日		期						
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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

##### 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。而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。

#### 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。

##### 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。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：

##### 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	490,829,658.84	-	-	-	490,829,658.84
结算备付金	64,870,723.74	-	-	-	64,870,723.74
存出保证金	11,943,943.22	-	-	-	11,943,943.22
交易性金融资产	-	-	-5,131,121,279.23	5,131,121,279.23	5,131,121,279.23
应收申购款	-	-	-	41,608,454.85	41,608,454.85
应收清算款	-	-	-	65,674,951.81	65,674,951.81
资产总计	567,644,325.80	-	-5,238,404,685.89	5,806,049,011.69	5,806,049,011.69
负债					
应付赎回款	-	-	-	23,472,785.16	23,472,785.16
应付管理人报酬	-	-	-	5,709,967.59	5,709,967.59
应付托管费	-	-	-	475,830.63	475,830.63
应付清算款	-	-	-	70,367,746.59	70,367,746.59
应付销售服务费	-	-	-	1,661,911.40	1,661,911.40
其他负债	-	-	-	7,520,801.03	7,520,801.03
负债总计	-	-	-	109,209,042.40	109,209,042.40

利率敏感度缺口	567,644,325.80	-	-	-5,129,195,643.49	5,696,839,969.29
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	229,203,823.40	-	-	-	229,203,823.40
结算备付金	6,726,376.83	-	-	-	6,726,376.83
存出保证金	8,396,516.77	-	-	-	8,396,516.77
交易性金融资产	-	-	-	-1,401,526,220.79	1,401,526,220.79
应收申购款	-	-	-	1,159,261.18	1,159,261.18
应收清算款	-	-	-	35,564,263.95	35,564,263.95
资产总计	244,326,717.00	-	-	-1,438,249,745.92	1,682,576,462.92
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,933,064.21	2,933,064.21
应付管理人报酬	-	-	-	2,162,975.92	2,162,975.92
应付托管费	-	-	-	144,198.38	144,198.38
应付销售服务费	-	-	-	139,367.14	139,367.14
其他负债	-	-	-	3,185,427.63	3,185,427.63
负债总计	-	-	-	8,565,033.28	8,565,033.28
利率敏感度缺口	244,326,717.00	-	-	-1,429,684,712.64	1,674,011,429.64

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	5,131,121,279.23	90.07	1,401,526,220.79	83.72
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	5,131,121,279.23	90.07	1,401,526,220.79	83.72

#### 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（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	342,953,000.00	101,031,000.00
	业绩比较基准下降5%的影响金额	-342,953,000.00	-101,031,000.00

#### 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	5,057,518,136.44	1,399,636,659.64
第二层次	-	-
第三层次	73,603,142.79	1,889,561.15
合计	5,131,121,279.23	1,401,526,220.79

#### 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

项目	本期 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	-	1,889,561.15	1,889,561.15
当期购买	-	65,003,353.06	65,003,353.06
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	3,201,927.14	3,201,927.14
当期利得或损失总额	-	9,912,155.72	9,912,155.72
其中：计入损益的利得或损失	-	9,912,155.72	9,912,155.72
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	73,603,142.79	73,603,142.79
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	-	9,612,059.35	9,612,059.35
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	-	3,489,750.35	3,489,750.35
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,526,063.62	1,526,063.62
当期利得或损失总额	-	-74,125.58	-74,125.58
其中：计入损益的利得或损失	-	-74,125.58	-74,125.58
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,889,561.15	1,889,561.15
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	-	-46,833.16	-46,833.16

#### 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	73,603,142.79	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	1,889,561.15	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	5,131,121,279.23	88.38
	其中：股票	5,131,121,279.23	88.38
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	555,700,382.58	9.57
8	其他各项资产	119,227,349.88	2.05
9	合计	5,806,049,011.69	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	29,310,551.74	0.51
B	采矿业	28,773,242.30	0.51
C	制造业	3,446,131,680.64	60.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	48,001,892.50	0.84
E	建筑业	143,617,397.00	2.52
F	批发和零售业	112,518,764.10	1.98
G	交通运输、仓储和邮政业	85,705,723.50	1.50
H	住宿和餐饮业	15,165,280.00	0.27
I	信息传输、软件和信息技术服务业	411,681,097.68	7.23
J	金融业	441,312,966.76	7.75
K	房地产业	53,040,534.10	0.93
L	租赁和商务服务业	58,645,032.00	1.03
M	科学研究和技术服务业	92,361,012.16	1.62
N	水利、环境和公共设施管理业	73,095,190.03	1.28

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	819,687.00	0.01
Q	卫生和社会工作	1,972,093.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	88,969,134.72	1.56
S	综合	-	-
	合计	5,131,121,279.23	90.07

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 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

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	300162	雷曼光电	5,134,952	39,544,552.80	0.69
2	601615	明阳智能	2,875,400	36,057,516.00	0.63
3	600741	华域汽车	2,197,200	35,770,416.00	0.63
4	002735	王子新材	2,887,391	35,197,296.29	0.62
5	601607	上海医药	2,081,850	34,829,350.50	0.61
6	300014	亿纬锂能	798,000	33,675,600.00	0.59
7	601319	中国人保	6,664,900	32,258,116.00	0.57
8	601728	中国电信	5,690,900	30,787,769.00	0.54
9	601166	兴业银行	1,755,100	28,450,171.00	0.50
10	000333	美的集团	510,500	27,888,615.00	0.49
11	601398	工商银行	5,742,600	27,449,628.00	0.48
12	002938	鹏鼎控股	1,054,700	23,540,904.00	0.41
13	601877	正泰电器	1,089,600	23,437,296.00	0.41
14	300433	蓝思科技	1,772,990	23,403,468.00	0.41
15	002841	视源股份	509,400	23,310,144.00	0.41
16	000768	中航西飞	1,039,300	23,249,141.00	0.41
17	601988	中国银行	5,794,300	23,119,257.00	0.41
18	000617	中油资本	4,249,500	22,947,300.00	0.40
19	000538	云南白药	462,180	22,716,147.00	0.40
20	300454	深信服	313,800	22,684,602.00	0.40
21	300408	三环集团	766,300	22,567,535.00	0.40
22	601169	北京银行	4,847,300	21,958,269.00	0.39
23	601800	中国交建	2,879,300	21,882,680.00	0.38
24	600061	国投资本	3,143,368	21,186,300.32	0.37
25	688561	奇安信	524,714	21,035,784.26	0.37
26	002202	金风科技	2,626,400	21,011,200.00	0.37
27	600332	白云山	715,800	20,471,880.00	0.36
28	601818	光大银行	6,987,700	20,264,330.00	0.36
29	601766	中国中车	3,711,000	19,519,860.00	0.34



30	600030	中信证券	930,890	18,962,229.30	0.33
31	300750	宁德时代	112,100	18,301,446.00	0.32
32	300498	温氏股份	910,029	18,255,181.74	0.32
33	601989	中国重工	4,288,200	17,710,266.00	0.31
34	688981	中芯国际	331,349	17,568,123.98	0.31
35	300059	东方财富	1,247,653	17,517,048.12	0.31
36	600050	中国联通	3,979,639	17,430,818.82	0.31
37	002179	中航光电	445,600	17,378,400.00	0.31
38	600893	航发动力	464,423	17,360,131.74	0.30
39	002027	分众传媒	2,705,400	17,098,128.00	0.30
40	600233	圆通速递	1,385,600	17,029,024.00	0.30
41	600039	四川路桥	2,271,640	17,014,583.60	0.30
42	601009	南京银行	2,302,300	16,990,974.00	0.30
43	600372	中航机载	1,279,768	16,867,342.24	0.30
44	601318	中国平安	417,500	16,825,250.00	0.30
45	002459	晶澳科技	809,460	16,772,011.20	0.29
46	002812	恩捷股份	294,800	16,750,536.00	0.29
47	600000	浦发银行	2,524,686	16,713,421.32	0.29
48	688599	天合光能	583,766	16,654,843.98	0.29
49	601012	隆基绿能	727,080	16,650,132.00	0.29
50	603806	福斯特	685,620	16,639,997.40	0.29
51	601888	中国中免	198,400	16,604,096.00	0.29
52	601688	华泰证券	1,188,500	16,579,575.00	0.29
53	300274	阳光电源	189,200	16,572,028.00	0.29
54	002129	TCL 中环	1,046,250	16,363,350.00	0.29
55	000733	振华科技	277,785	16,344,869.40	0.29
56	601998	中信银行	3,075,700	16,270,453.00	0.29
57	300763	锦浪科技	231,200	16,160,880.00	0.28
58	002007	华兰生物	715,250	15,828,482.50	0.28
59	601698	中国卫通	910,630	15,763,005.30	0.28
60	601658	邮储银行	3,593,700	15,632,595.00	0.27
61	600754	锦江酒店	507,200	15,165,280.00	0.27
62	300142	沃森生物	641,206	15,074,753.06	0.26
63	600036	招商银行	537,200	14,944,904.00	0.26
64	603260	合盛硅业	275,400	14,045,400.00	0.25
65	600104	上汽集团	1,037,500	14,037,375.00	0.25
66	600588	用友网络	781,215	13,897,814.85	0.24
67	300413	芒果超媒	550,170	13,864,284.00	0.24
68	600999	招商证券	1,007,700	13,745,028.00	0.24
69	601006	大秦铁路	1,889,600	13,624,016.00	0.24
70	601019	山东出版	1,447,100	13,573,798.00	0.24
71	300515	三德科技	1,163,300	13,424,482.00	0.24
72	002074	国轩高科	623,929	13,414,473.50	0.24

73	000876	新希望	1,410,200	13,143,064.00	0.23
74	000792	盐湖股份	809,600	12,913,120.00	0.23
75	002899	英派斯	775,580	12,835,849.00	0.23
76	603238	诺邦股份	922,200	12,680,250.00	0.22
77	601336	新华保险	400,790	12,476,592.70	0.22
78	002493	荣盛石化	1,203,850	12,459,847.50	0.22
79	600573	惠泉啤酒	1,199,700	12,452,886.00	0.22
80	600219	南山铝业	4,097,400	12,046,356.00	0.21
81	600016	民生银行	3,158,700	11,813,538.00	0.21
82	603833	欧派家居	168,614	11,737,220.54	0.21
83	601898	中煤能源	1,206,500	11,690,985.00	0.21
84	002916	深南电路	164,140	11,652,298.60	0.20
85	688768	容知日新	315,700	11,620,917.00	0.20
86	600438	通威股份	462,300	11,571,369.00	0.20
87	301326	捷邦科技	283,700	11,379,207.00	0.20
88	688299	长阳科技	809,642	11,294,505.90	0.20
89	000576	甘化科工	1,205,500	11,211,150.00	0.20
90	300414	中光防雷	1,153,100	11,104,353.00	0.19
91	603936	博敏电子	1,063,300	11,100,852.00	0.19
92	002474	榕基软件	1,677,800	11,039,924.00	0.19
93	301135	瑞德智能	436,600	10,836,412.00	0.19
94	603328	依顿电子	1,317,200	10,735,180.00	0.19
95	300771	智莱科技	977,800	10,628,686.00	0.19
96	002180	纳思达	456,300	10,326,069.00	0.18
97	600854	春兰股份	1,949,900	10,275,973.00	0.18
98	603989	艾华集团	475,200	10,226,304.00	0.18
99	300543	朗科智能	936,420	10,225,706.40	0.18
100	600757	长江传媒	1,358,600	10,121,570.00	0.18
101	300768	迪普科技	679,650	10,045,227.00	0.18
102	600958	东方证券	1,151,100	10,014,570.00	0.18
103	300484	蓝海华腾	785,100	9,915,813.00	0.17
104	300686	智动力	936,900	9,912,402.00	0.17
105	688509	正元地信	2,009,500	9,705,885.00	0.17
106	688226	威腾电气	515,880	9,698,544.00	0.17
107	000931	中关村	1,649,800	9,684,326.00	0.17
108	300711	广哈通信	711,000	9,491,850.00	0.17
109	300645	正元智慧	520,400	9,466,076.00	0.17
110	002288	超华科技	2,153,300	9,388,388.00	0.16
111	300481	濮阳惠成	532,300	9,288,635.00	0.16
112	603507	振江股份	353,400	9,156,594.00	0.16
113	301123	奕东电子	390,180	9,153,622.80	0.16
114	300523	辰安科技	448,000	9,094,400.00	0.16
115	603933	睿能科技	583,900	9,079,645.00	0.16

116	002636	金安国纪	1,018,900	9,078,399.00	0.16
117	000425	徐工机械	1,661,300	9,070,698.00	0.16
118	300810	中科海讯	438,300	8,941,320.00	0.16
119	688571	杭华股份	1,192,496	8,919,870.08	0.16
120	002498	汉缆股份	2,224,000	8,896,000.00	0.16
121	600379	宝光股份	883,320	8,877,366.00	0.16
122	300248	新开普	920,500	8,827,595.00	0.15
123	300546	雄帝科技	557,600	8,793,352.00	0.15
124	301302	华如科技	349,107	8,766,076.77	0.15
125	301156	美农生物	463,060	8,733,311.60	0.15
126	600031	三一重工	634,000	8,730,180.00	0.15
127	301179	泽宇智能	335,218	8,698,907.10	0.15
128	301291	明阳电气	305,748	8,671,013.28	0.15
129	002724	海洋王	1,048,000	8,614,560.00	0.15
130	688028	沃尔德	345,180	8,591,530.20	0.15
131	688138	清溢光电	379,487	8,583,995.94	0.15
132	603929	亚翔集成	358,700	8,580,104.00	0.15
133	600094	大名城	2,856,100	8,568,300.00	0.15
134	688181	八亿时空	314,300	8,486,100.00	0.15
135	300451	创业慧康	1,294,720	8,480,416.00	0.15
136	002016	世荣兆业	1,338,410	8,418,598.90	0.15
137	301160	翔楼新材	199,126	8,409,090.98	0.15
138	603080	新疆火炬	500,900	8,344,994.00	0.15
139	002105	信隆健康	1,282,300	8,309,304.00	0.15
140	601579	会稽山	770,300	8,273,022.00	0.15
141	603788	宁波高发	553,400	8,262,262.00	0.15
142	300710	万隆光电	339,700	8,261,504.00	0.15
143	300447	全信股份	568,400	8,241,800.00	0.14
144	300194	福安药业	1,879,200	8,230,896.00	0.14
145	301388	欣灵电气	337,451	8,230,429.89	0.14
146	300739	明阳电路	531,000	8,129,610.00	0.14
147	300872	天阳科技	592,380	8,103,758.40	0.14
148	300632	光莆股份	638,967	8,063,763.54	0.14
149	301330	熵基科技	243,600	8,063,160.00	0.14
150	603317	天味食品	602,604	8,008,607.16	0.14
151	002461	珠江啤酒	1,011,100	7,987,690.00	0.14
152	601098	中南传媒	785,100	7,984,467.00	0.14
153	300976	达瑞电子	149,600	7,963,208.00	0.14
154	600798	宁波海运	2,169,400	7,940,004.00	0.14
155	301043	绿岛风	241,400	7,901,022.00	0.14
156	001229	魅视科技	221,200	7,874,720.00	0.14
157	301063	海锅股份	345,351	7,874,002.80	0.14
158	603776	永安行	555,600	7,822,848.00	0.14

159	600184	光电股份	683,877	7,816,714.11	0.14
160	300440	运达科技	1,035,900	7,717,455.00	0.14
161	601886	江河集团	1,158,300	7,714,278.00	0.14
162	300245	天玑科技	872,100	7,691,922.00	0.14
163	000858	五粮液	54,563	7,655,734.53	0.13
164	603937	丽岛新材	603,950	7,652,046.50	0.13
165	300205	天喻信息	700,900	7,611,774.00	0.13
166	301518	长华化学	323,600	7,572,240.00	0.13
167	301002	崧盛股份	364,000	7,549,360.00	0.13
168	600153	建发股份	782,000	7,530,660.00	0.13
169	301285	鸿日达	465,900	7,445,082.00	0.13
170	002111	威海广泰	821,000	7,438,260.00	0.13
171	688126	沪硅产业	423,500	7,335,020.00	0.13
172	301356	天振股份	401,353	7,300,611.07	0.13
173	002434	万里扬	978,900	7,292,805.00	0.13
174	301119	正强股份	281,000	7,272,280.00	0.13
175	002226	江南化工	1,657,500	7,259,850.00	0.13
176	002296	辉煌科技	876,700	7,232,775.00	0.13
177	601928	凤凰传媒	812,000	7,153,720.00	0.13
178	688221	前沿生物	719,307	7,135,525.44	0.13
179	000561	烽火电子	847,600	7,119,840.00	0.12
180	300448	浩云科技	1,306,561	7,029,298.18	0.12
181	301279	金道科技	283,400	7,025,486.00	0.12
182	002297	博云新材	874,800	6,972,156.00	0.12
183	300621	维业股份	603,400	6,933,066.00	0.12
184	300843	胜蓝股份	298,500	6,859,530.00	0.12
185	301359	东南电子	257,200	6,844,092.00	0.12
186	300271	华宇软件	833,200	6,823,908.00	0.12
187	300900	广联航空	274,800	6,782,064.00	0.12
188	002030	达安基因	695,834	6,735,673.12	0.12
189	603508	思维列控	426,700	6,699,190.00	0.12
190	002714	牧原股份	161,300	6,642,334.00	0.12
191	000156	华数传媒	894,200	6,590,254.00	0.12
192	301195	北路智控	162,100	6,578,018.00	0.12
193	600755	厦门国贸	941,500	6,562,255.00	0.12
194	603017	中衡设计	652,300	6,529,523.00	0.11
195	301107	瑜欣电子	202,500	6,498,225.00	0.11
196	300508	维宏股份	229,500	6,494,850.00	0.11
197	000952	广济药业	811,400	6,483,086.00	0.11
198	002815	崇达技术	671,500	6,432,970.00	0.11
199	600710	苏美达	900,600	6,385,254.00	0.11
200	000534	万泽股份	485,500	6,355,195.00	0.11
201	300852	四会富仕	163,000	6,282,020.00	0.11

202	301112	信邦智能	209,400	6,275,718.00	0.11
203	301301	川宁生物	746,300	6,268,920.00	0.11
204	300550	和仁科技	417,600	6,259,824.00	0.11
205	300120	经纬辉开	859,800	6,242,148.00	0.11
206	603191	望变电气	401,500	6,235,295.00	0.11
207	300751	迈为股份	48,100	6,229,431.00	0.11
208	601199	江南水务	1,251,400	6,206,944.00	0.11
209	300719	安达维尔	463,400	6,177,122.00	0.11
210	000823	超声电子	644,200	6,164,994.00	0.11
211	300582	英飞特	513,273	6,164,408.73	0.11
212	300095	华伍股份	747,500	6,151,925.00	0.11
213	300756	金马游乐	379,200	6,143,040.00	0.11
214	300916	朗特智能	251,300	6,141,772.00	0.11
215	688308	欧科亿	219,700	6,129,630.00	0.11
216	603810	丰山集团	458,312	6,127,631.44	0.11
217	603096	新经典	310,504	6,110,718.72	0.11
218	000880	潍柴重机	572,860	6,089,501.80	0.11
219	688216	气派科技	219,800	6,081,866.00	0.11
220	301163	宏德股份	224,299	6,078,502.90	0.11
221	688022	瀚川智能	277,000	6,077,380.00	0.11
222	603109	神驰机电	369,900	6,073,758.00	0.11
223	301158	德石股份	376,400	6,056,276.00	0.11
224	600774	汉商集团	613,300	6,047,138.00	0.11
225	300046	台基股份	379,300	6,034,663.00	0.11
226	002829	星网宇达	222,800	6,024,512.00	0.11
227	603126	中材节能	893,100	6,019,494.00	0.11
228	301093	华兰股份	185,300	5,985,190.00	0.11
229	002066	瑞泰科技	536,600	5,961,626.00	0.10
230	603997	继峰股份	442,400	5,959,128.00	0.10
231	301138	华研精机	205,200	5,950,800.00	0.10
232	300696	爱乐达	340,540	5,928,801.40	0.10
233	601866	中远海发	2,519,100	5,894,694.00	0.10
234	002241	歌尔股份	280,400	5,891,204.00	0.10
235	300365	恒华科技	867,300	5,862,948.00	0.10
236	300813	泰林生物	238,466	5,847,186.32	0.10
237	603113	金能科技	723,200	5,836,224.00	0.10
238	601997	贵阳银行	1,133,600	5,826,704.00	0.10
239	000830	鲁西化工	580,700	5,824,421.00	0.10
240	000708	中信特钢	413,942	5,811,745.68	0.10
241	600015	华夏银行	1,033,900	5,810,518.00	0.10
242	300703	创源股份	515,800	5,797,592.00	0.10
243	002551	尚荣医疗	1,427,900	5,797,274.00	0.10
244	600855	航天长峰	539,000	5,778,080.00	0.10

245	688227	品高股份	302,549	5,769,609.43	0.10
246	600325	华发股份	797,900	5,752,859.00	0.10
247	300605	恒锋信息	383,070	5,734,557.90	0.10
248	600080	金花股份	769,000	5,729,050.00	0.10
249	002082	万邦德	891,820	5,707,648.00	0.10
250	600373	中文传媒	432,900	5,705,622.00	0.10
251	000607	华媒控股	1,244,700	5,700,726.00	0.10
252	002350	北京科锐	840,500	5,673,375.00	0.10
253	600406	国电南瑞	254,020	5,669,726.40	0.10
254	601168	西部矿业	397,100	5,666,617.00	0.10
255	300919	中伟股份	115,200	5,659,776.00	0.10
256	603321	梅轮电梯	662,700	5,659,458.00	0.10
257	600448	华纺股份	1,713,100	5,653,230.00	0.10
258	002811	郑中设计	571,100	5,625,335.00	0.10
259	300720	海川智能	404,130	5,621,448.30	0.10
260	600057	厦门象屿	836,200	5,610,902.00	0.10
261	601816	京沪高铁	1,140,000	5,608,800.00	0.10
262	002715	登云股份	345,100	5,600,973.00	0.10
263	300830	金现代	691,500	5,580,405.00	0.10
264	003025	思进智能	412,745	5,576,184.95	0.10
265	002830	名雕股份	372,500	5,546,525.00	0.10
266	002910	庄园牧场	503,500	5,508,290.00	0.10
267	002743	富煌钢构	920,800	5,506,384.00	0.10
268	300387	富邦股份	659,100	5,496,894.00	0.10
269	002449	国星光电	580,300	5,495,441.00	0.10
270	003041	真爱美家	329,520	5,486,508.00	0.10
271	300640	德艺文创	851,500	5,466,630.00	0.10
272	300243	瑞丰高材	556,300	5,435,051.00	0.10
273	600551	时代出版	498,600	5,429,754.00	0.10
274	300141	和顺电气	518,700	5,415,228.00	0.10
275	000977	浪潮信息	163,100	5,414,920.00	0.10
276	002112	三变科技	516,100	5,408,728.00	0.09
277	603988	中电电机	475,500	5,406,435.00	0.09
278	300030	阳普医疗	697,000	5,401,750.00	0.09
279	301197	工大科雅	286,933	5,391,471.07	0.09
280	300219	鸿利智汇	640,300	5,391,326.00	0.09
281	603928	兴业股份	403,200	5,390,784.00	0.09
282	603978	深圳新星	324,200	5,375,236.00	0.09
283	300782	卓胜微	38,100	5,372,100.00	0.09
284	300153	科泰电源	672,600	5,367,348.00	0.09
285	002718	友邦吊顶	315,100	5,359,851.00	0.09
286	603041	美思德	398,200	5,359,772.00	0.09
287	002012	凯恩股份	954,600	5,345,760.00	0.09

288	688355	明志科技	268,500	5,343,150.00	0.09
289	603045	福达合金	338,300	5,341,757.00	0.09
290	603580	艾艾精工	358,600	5,339,554.00	0.09
291	300594	朗进科技	255,600	5,336,928.00	0.09
292	003001	中岩大地	295,200	5,334,264.00	0.09
293	002144	宏达高科	458,900	5,332,418.00	0.09
294	002160	常铝股份	1,272,500	5,331,775.00	0.09
295	001256	炜冈科技	287,304	5,317,997.04	0.09
296	300549	优德精密	277,700	5,317,955.00	0.09
297	605287	德才股份	312,820	5,308,555.40	0.09
298	603226	菲林格尔	762,700	5,308,392.00	0.09
299	300321	同大股份	274,300	5,307,705.00	0.09
300	603869	新智认知	561,500	5,300,560.00	0.09
301	301226	祥明智能	232,100	5,298,843.00	0.09
302	603790	雅运股份	378,000	5,295,780.00	0.09
303	301233	盛帮股份	119,100	5,290,422.00	0.09
304	603086	先达股份	899,500	5,289,060.00	0.09
305	603089	正裕工业	460,600	5,287,688.00	0.09
306	002136	安纳达	454,900	5,285,938.00	0.09
307	301079	邵阳液压	305,450	5,284,285.00	0.09
308	301161	唯万密封	261,300	5,283,486.00	0.09
309	300611	美力科技	459,400	5,278,506.00	0.09
310	603102	百合股份	136,100	5,277,958.00	0.09
311	605033	美邦股份	293,800	5,273,710.00	0.09
312	002134	天津普林	480,700	5,273,279.00	0.09
313	001288	运机集团	313,223	5,268,410.86	0.09
314	301006	迈拓股份	290,900	5,268,199.00	0.09
315	603616	韩建河山	942,300	5,267,457.00	0.09
316	300717	华信新材	313,380	5,261,650.20	0.09
317	002857	三晖电气	318,800	5,260,200.00	0.09
318	603320	迪贝电气	330,500	5,258,255.00	0.09
319	603331	百达精工	401,340	5,257,554.00	0.09
320	603499	翔港科技	488,600	5,257,336.00	0.09
321	300371	汇中股份	431,280	5,257,303.20	0.09
322	300641	正丹股份	932,100	5,257,044.00	0.09
323	300828	锐新科技	336,100	5,256,604.00	0.09
324	603040	新坐标	200,930	5,254,319.50	0.09
325	003018	金富科技	493,300	5,253,645.00	0.09
326	603637	镇海股份	583,700	5,253,300.00	0.09
327	002084	海鸥住工	1,319,288	5,250,766.24	0.09
328	002817	黄山胶囊	599,040	5,247,590.40	0.09
329	688519	南亚新材	203,632	5,245,560.32	0.09
330	001296	长江材料	222,900	5,244,837.00	0.09

331	301198	喜悦智行	431,607	5,239,708.98	0.09
332	301072	中捷精工	207,500	5,239,375.00	0.09
333	300651	金陵体育	262,200	5,238,756.00	0.09
334	002169	智光电气	761,300	5,237,744.00	0.09
335	600193	创兴资源	1,012,800	5,236,176.00	0.09
336	002887	绿茵生态	603,200	5,235,776.00	0.09
337	002802	洪汇新材	408,670	5,235,062.70	0.09
338	605100	华丰股份	329,000	5,234,390.00	0.09
339	000055	方大集团	1,157,900	5,233,708.00	0.09
340	301235	华康医疗	204,200	5,233,646.00	0.09
341	300126	锐奇股份	731,900	5,233,085.00	0.09
342	603097	江苏华辰	218,100	5,232,219.00	0.09
343	003011	海象新材	246,321	5,229,394.83	0.09
344	301113	雅艺科技	162,000	5,227,740.00	0.09
345	000030	富奥股份	978,900	5,227,326.00	0.09
346	003027	同兴环保	285,850	5,219,621.00	0.09
347	605180	华生科技	372,600	5,216,400.00	0.09
348	603633	徕木股份	544,300	5,214,394.00	0.09
349	000590	启迪药业	581,800	5,212,928.00	0.09
350	688209	英集芯	291,803	5,211,601.58	0.09
351	301037	保立佳	261,400	5,209,702.00	0.09
352	301057	汇隆新材	310,000	5,208,000.00	0.09
353	002871	伟隆股份	465,550	5,204,849.00	0.09
354	002842	翔鹭钨业	596,500	5,201,480.00	0.09
355	603182	嘉华股份	351,900	5,197,563.00	0.09
356	300752	隆利科技	286,000	5,196,620.00	0.09
357	002778	中晟高科	345,960	5,196,319.20	0.09
358	603908	牧高笛	139,400	5,187,074.00	0.09
359	300692	中环环保	836,620	5,187,044.00	0.09
360	301192	泰祥股份	225,900	5,186,664.00	0.09
361	301056	森赫股份	507,400	5,185,628.00	0.09
362	301008	宏昌科技	171,600	5,180,604.00	0.09
363	002357	富临运业	686,000	5,179,300.00	0.09
364	301066	万事利	402,000	5,177,760.00	0.09
365	300234	开尔新材	993,300	5,175,093.00	0.09
366	300819	聚杰微纤	332,800	5,175,040.00	0.09
367	300823	建科机械	240,500	5,173,155.00	0.09
368	300854	中兰环保	296,400	5,172,180.00	0.09
369	300564	筑博设计	384,240	5,171,870.40	0.09
370	301010	晶雪节能	276,500	5,167,785.00	0.09
371	300385	雪浪环境	769,000	5,167,680.00	0.09
372	300658	延江股份	762,780	5,164,020.60	0.09
373	603955	大千生态	351,400	5,162,066.00	0.09



374	300749	顶固集创	556,800	5,161,536.00	0.09
375	605189	富春染织	318,440	5,158,728.00	0.09
376	300675	建科院	340,275	5,155,166.25	0.09
377	300562	乐心医疗	451,700	5,153,897.00	0.09
378	301148	嘉戎技术	233,700	5,153,085.00	0.09
379	001259	利仁科技	181,900	5,151,408.00	0.09
380	002057	中钢天源	640,300	5,148,012.00	0.09
381	300879	大叶股份	297,200	5,147,504.00	0.09
382	002394	联发股份	619,200	5,145,552.00	0.09
383	301209	联合化学	206,100	5,144,256.00	0.09
384	600969	郴电国际	791,000	5,141,500.00	0.09
385	301227	森鹰窗业	189,900	5,140,593.00	0.09
386	000586	汇源通信	408,400	5,137,672.00	0.09
387	002826	易明医药	432,700	5,136,149.00	0.09
388	300753	爱朋医疗	299,000	5,133,830.00	0.09
389	301077	星华新材	252,500	5,133,325.00	0.09
390	603059	倍加洁	227,500	5,132,400.00	0.09
391	001230	劲旅环境	218,700	5,130,702.00	0.09
392	000573	粤宏远 A	1,517,800	5,130,164.00	0.09
393	001231	农心科技	246,200	5,128,346.00	0.09
394	603269	海鸥股份	380,600	5,126,682.00	0.09
395	000605	渤海股份	799,700	5,126,077.00	0.09
396	301182	凯旺科技	218,900	5,117,882.00	0.09
397	603214	爱婴室	312,800	5,117,408.00	0.09
398	605298	必得科技	327,830	5,110,869.70	0.09
399	600356	恒丰纸业	640,000	5,107,200.00	0.09
400	301051	信濠光电	80,200	5,106,334.00	0.09
401	603311	金海高科	493,800	5,105,892.00	0.09
402	301199	迈赫股份	193,992	5,092,290.00	0.09
403	603183	建研院	1,090,100	5,090,767.00	0.09
404	300504	天邑股份	278,100	5,086,449.00	0.09
405	600901	江苏金租	1,050,900	5,086,356.00	0.09
406	002492	恒基达鑫	847,550	5,076,824.50	0.09
407	003026	中晶科技	141,800	5,076,440.00	0.09
408	300649	杭州园林	303,000	5,075,250.00	0.09
409	300746	汉嘉设计	504,900	5,074,245.00	0.09
410	001211	双枪科技	210,000	5,073,600.00	0.09
411	300689	澄天伟业	261,900	5,073,003.00	0.09
412	600082	海泰发展	1,470,100	5,071,845.00	0.09
413	600802	福建水泥	978,200	5,067,076.00	0.09
414	600584	长电科技	169,600	5,064,256.00	0.09
415	600196	复星医药	202,029	5,056,785.87	0.09
416	002236	大华股份	274,000	5,055,300.00	0.09

417	603316	诚邦股份	750,000	5,055,000.00	0.09
418	600539	狮头股份	704,800	5,053,416.00	0.09
419	603221	爱丽家居	508,300	5,052,502.00	0.09
420	002828	贝肯能源	484,030	5,048,432.90	0.09
421	300329	海伦钢琴	676,500	5,039,925.00	0.09
422	603192	汇得科技	256,300	5,036,295.00	0.09
423	603709	中源家居	279,780	5,036,040.00	0.09
424	002760	凤形股份	229,600	5,032,832.00	0.09
425	600538	国发股份	1,083,900	5,029,296.00	0.09
426	002780	三夫户外	402,000	5,029,020.00	0.09
427	603166	福达股份	727,500	5,027,025.00	0.09
428	300875	捷强装备	172,200	5,026,518.00	0.09
429	300732	设研院	569,100	5,025,153.00	0.09
430	301003	江苏博云	201,300	5,024,448.00	0.09
431	600051	宁波联合	695,400	5,020,788.00	0.09
432	300743	天地数码	361,600	5,019,008.00	0.09
433	600137	浪莎股份	275,400	5,017,788.00	0.09
434	605069	正和生态	510,940	5,017,430.80	0.09
435	300838	浙江力诺	306,500	5,014,340.00	0.09
436	600493	凤竹纺织	745,700	5,011,104.00	0.09
437	603506	南都物业	460,960	5,010,635.20	0.09
438	301086	鸿富瀚	108,200	5,001,004.00	0.09
439	301130	西点药业	179,300	4,998,884.00	0.09
440	300610	晨化股份	443,100	4,993,737.00	0.09
441	300642	透景生命	282,700	4,989,655.00	0.09
442	600857	宁波中百	529,000	4,988,470.00	0.09
443	600749	西藏旅游	423,900	4,985,064.00	0.09
444	603798	康普顿	515,330	4,983,241.10	0.09
445	300578	会畅通讯	279,000	4,982,940.00	0.09
446	688600	皖仪科技	246,616	4,981,643.20	0.09
447	000608	阳光股份	1,726,600	4,972,608.00	0.09
448	600883	博闻科技	584,800	4,970,800.00	0.09
449	300188	国投智能	309,700	4,961,394.00	0.09
450	600198	大唐电信	755,100	4,961,007.00	0.09
451	301048	金鹰重工	470,354	4,957,531.16	0.09
452	002491	通鼎互联	946,000	4,957,040.00	0.09
453	002486	嘉麟杰	1,695,500	4,950,860.00	0.09
454	605303	园林股份	405,400	4,945,880.00	0.09
455	301167	建研设计	292,000	4,940,640.00	0.09
456	002093	国脉科技	655,400	4,928,608.00	0.09
457	002879	长缆科技	307,200	4,921,344.00	0.09
458	002346	柘中股份	440,800	4,914,920.00	0.09
459	600345	长江通信	253,700	4,914,169.00	0.09

460	002376	新北洋	644,500	4,911,090.00	0.09
461	301055	张小泉	339,919	4,901,631.98	0.09
462	605138	盛泰集团	632,300	4,900,325.00	0.09
463	002214	大立科技	426,900	4,896,543.00	0.09
464	002267	陕天然气	667,100	4,889,843.00	0.09
465	001696	宗申动力	736,500	4,882,995.00	0.09
466	603813	原尚股份	301,000	4,861,150.00	0.09
467	002298	中电兴发	842,700	4,853,952.00	0.09
468	300836	佰奥智能	169,800	4,825,716.00	0.08
469	301276	嘉曼服饰	196,800	4,797,984.00	0.08
470	301040	中环海陆	251,600	4,772,852.00	0.08
471	301237	和顺科技	156,200	4,759,414.00	0.08
472	000789	万年青	692,300	4,749,178.00	0.08
473	301125	腾亚精工	251,000	4,748,920.00	0.08
474	002475	立讯精密	137,600	4,740,320.00	0.08
475	002774	快意电梯	569,600	4,727,680.00	0.08
476	002980	华盛昌	172,200	4,718,280.00	0.08
477	301273	瑞晨环保	170,700	4,709,613.00	0.08
478	601838	成都银行	416,500	4,689,790.00	0.08
479	301016	雷尔伟	211,900	4,674,514.00	0.08
480	603151	邦基科技	307,700	4,643,193.00	0.08
481	300501	海顺新材	321,400	4,637,802.00	0.08
482	001336	楚环科技	161,100	4,626,792.00	0.08
483	300557	理工光科	131,300	4,625,699.00	0.08
484	601689	拓普集团	62,900	4,623,150.00	0.08
485	301336	趣睡科技	105,400	4,615,466.00	0.08
486	603585	苏利股份	322,521	4,615,275.51	0.08
487	300851	交大思诺	147,800	4,606,926.00	0.08
488	002264	新华都	835,900	4,605,809.00	0.08
489	688012	中微公司	29,888	4,590,796.80	0.08
490	002996	顺博合金	416,200	4,544,904.00	0.08
491	601390	中国中铁	796,800	4,525,824.00	0.08
492	603177	德创环保	381,300	4,506,966.00	0.08
493	301081	严牌股份	404,820	4,493,502.00	0.08
494	600389	江山股份	257,100	4,473,540.00	0.08
495	000100	TCL 科技	1,039,600	4,470,280.00	0.08
496	605003	众望布艺	225,200	4,445,448.00	0.08
497	601956	东贝集团	740,300	4,419,591.00	0.08
498	601919	中远海控	461,100	4,417,338.00	0.08
499	301068	大地海洋	145,300	4,417,120.00	0.08
500	600746	江苏索普	600,800	4,397,856.00	0.08
501	600064	南京高科	727,900	4,396,516.00	0.08
502	605155	西大门	282,900	4,379,292.00	0.08

503	301317	鑫磊股份	222,085	4,366,191.10	0.08
504	605305	中际联合	134,600	4,348,926.00	0.08
505	000090	天健集团	933,300	4,293,180.00	0.08
506	688569	铁科轨道	154,900	4,276,789.00	0.08
507	002452	长高电新	602,300	4,276,330.00	0.08
508	601298	青岛港	689,400	4,260,492.00	0.07
509	600928	西安银行	1,278,500	4,257,405.00	0.07
510	601628	中国人寿	150,000	4,252,500.00	0.07
511	600997	开滦股份	555,800	4,240,754.00	0.07
512	002943	宇晶股份	151,500	4,237,455.00	0.07
513	300774	倍杰特	411,100	4,230,219.00	0.07
514	688230	芯导科技	101,100	4,230,024.00	0.07
515	301290	东星医疗	152,900	4,218,511.00	0.07
516	003019	宸展光电	185,880	4,200,888.00	0.07
517	600795	国电电力	1,009,500	4,199,520.00	0.07
518	688663	新风光	148,000	4,149,920.00	0.07
519	603076	乐惠国际	154,800	4,148,640.00	0.07
520	688148	芳源股份	540,600	4,146,402.00	0.07
521	300802	矩子科技	216,000	4,129,920.00	0.07
522	605066	天正电气	448,900	4,120,902.00	0.07
523	300486	东杰智能	595,270	4,113,315.70	0.07
524	300903	科翔股份	408,760	4,112,125.60	0.07
525	300490	华自科技	354,000	4,109,940.00	0.07
526	600429	三元股份	921,500	4,109,890.00	0.07
527	300239	东宝生物	657,500	4,096,225.00	0.07
528	603232	格尔软件	297,900	4,078,251.00	0.07
529	603421	鼎信通讯	433,320	4,073,208.00	0.07
530	600099	林海股份	397,200	4,059,384.00	0.07
531	603758	秦安股份	353,700	4,046,328.00	0.07
532	301292	海科新源	207,463	4,045,441.05	0.07
533	600803	新奥股份	240,225	4,040,584.50	0.07
534	300694	蠡湖股份	320,100	4,036,461.00	0.07
535	688125	安达智能	102,300	4,035,735.00	0.07
536	600350	山东高速	580,900	4,031,446.00	0.07
537	301053	远信工业	144,400	4,022,984.00	0.07
538	003017	大洋生物	165,300	4,020,096.00	0.07
539	603261	立航科技	117,600	4,011,336.00	0.07
540	605068	明新旭腾	178,700	4,010,028.00	0.07
541	300816	艾可蓝	162,400	4,006,408.00	0.07
542	002209	达意隆	364,200	4,006,200.00	0.07
543	300994	久祺股份	272,160	4,000,752.00	0.07
544	002337	赛象科技	704,100	3,999,288.00	0.07
545	000856	冀东装备	416,600	3,986,862.00	0.07

546	600826	兰生股份	450,700	3,984,188.00	0.07
547	600692	亚通股份	639,100	3,981,593.00	0.07
548	300066	三川智慧	788,400	3,981,420.00	0.07
549	301248	杰创智能	225,800	3,976,338.00	0.07
550	300405	科隆股份	615,100	3,973,546.00	0.07
551	001209	洪兴股份	220,900	3,956,319.00	0.07
552	603324	盛剑环境	130,200	3,954,174.00	0.07
553	301007	德迈仕	233,500	3,948,485.00	0.07
554	300048	合康新能	776,600	3,929,596.00	0.07
555	603987	康德莱	411,900	3,929,526.00	0.07
556	603319	湘油泵	223,600	3,921,944.00	0.07
557	300956	英力股份	210,100	3,914,163.00	0.07
558	601601	中国太保	164,300	3,907,054.00	0.07
559	688391	钜泉科技	78,200	3,878,720.00	0.07
560	002691	冀凯股份	516,600	3,869,334.00	0.07
561	688365	光云科技	354,500	3,860,505.00	0.07
562	000888	峨眉山 A	432,300	3,860,439.00	0.07
563	002253	川大智胜	269,100	3,848,130.00	0.07
564	601002	晋亿实业	793,500	3,840,540.00	0.07
565	600269	赣粤高速	934,100	3,839,151.00	0.07
566	600756	浪潮软件	275,500	3,821,185.00	0.07
567	603903	中持股份	386,600	3,819,608.00	0.07
568	601868	中国能建	1,812,900	3,807,090.00	0.07
569	002438	江苏神通	317,600	3,795,320.00	0.07
570	603725	天安新材	336,100	3,740,793.00	0.07
571	601618	中国中冶	1,215,300	3,718,818.00	0.07
572	002181	粤传媒	808,400	3,718,640.00	0.07
573	600346	恒力石化	282,300	3,717,891.00	0.07
574	601211	国泰君安	248,900	3,703,632.00	0.07
575	600502	安徽建工	788,800	3,667,920.00	0.06
576	605507	国邦医药	207,000	3,634,920.00	0.06
577	300673	佩蒂股份	270,600	3,598,980.00	0.06
578	600841	动力新科	607,500	3,590,325.00	0.06
579	002820	桂发祥	311,400	3,556,188.00	0.06
580	600488	津药药业	725,700	3,555,930.00	0.06
581	600019	宝钢股份	598,000	3,546,140.00	0.06
582	002373	千方科技	316,200	3,544,602.00	0.06
583	603860	中公高科	113,400	3,521,070.00	0.06
584	300215	电科院	655,100	3,465,479.00	0.06
585	601238	广汽集团	394,200	3,449,250.00	0.06
586	603389	亚振家居	519,500	3,444,285.00	0.06
587	600875	东方电气	235,400	3,441,548.00	0.06
588	605336	帅丰电器	230,130	3,424,334.40	0.06

589	603308	应流股份	236,200	3,384,746.00	0.06
590	688330	宏力达	118,688	3,371,926.08	0.06
591	603901	永创智能	280,700	3,340,330.00	0.06
592	600037	歌华有线	430,000	3,323,900.00	0.06
593	601369	陕鼓动力	412,800	3,294,144.00	0.06
594	301238	瑞泰新材	186,300	3,265,839.00	0.06
595	300644	南京聚隆	156,400	3,245,300.00	0.06
596	002534	西子洁能	259,500	3,241,155.00	0.06
597	002999	天禾股份	431,500	3,236,250.00	0.06
598	300950	德固特	200,300	3,230,839.00	0.06
599	002801	微光股份	147,200	3,201,600.00	0.06
600	300880	迦南智能	159,600	3,179,232.00	0.06
601	300565	科信技术	208,300	3,149,496.00	0.06
602	301319	唯特偶	53,900	3,148,299.00	0.06
603	600918	中泰证券	458,500	3,145,310.00	0.06
604	688080	映翰通	77,039	3,126,242.62	0.05
605	301049	超越科技	134,800	3,121,968.00	0.05
606	300585	奥联电子	185,900	3,115,684.00	0.05
607	603015	弘讯科技	317,700	3,100,752.00	0.05
608	002199	东晶电子	330,000	3,095,400.00	0.05
609	002255	海陆重工	583,400	3,086,186.00	0.05
610	003043	华亚智能	61,400	3,082,894.00	0.05
611	300943	春晖智控	214,400	3,074,496.00	0.05
612	300656	民德电子	124,800	3,061,344.00	0.05
613	001210	金房能源	155,000	3,061,250.00	0.05
614	300590	移为通信	254,300	3,054,143.00	0.05
615	603855	华荣股份	153,000	3,053,880.00	0.05
616	002017	东信和平	293,100	3,051,171.00	0.05
617	688182	灿勤科技	171,400	3,047,492.00	0.05
618	603886	元祖股份	167,000	3,044,410.00	0.05
619	600819	耀皮玻璃	596,000	3,033,640.00	0.05
620	002667	威领股份	268,400	3,024,868.00	0.05
621	002061	浙江交科	827,700	3,021,105.00	0.05
622	688588	凌志软件	253,384	3,015,269.60	0.05
623	603416	信捷电气	79,700	2,993,532.00	0.05
624	300964	本川智能	75,800	2,988,036.00	0.05
625	603280	南方路机	111,300	2,976,162.00	0.05
626	603351	威尔药业	112,400	2,963,988.00	0.05
627	002380	科远智慧	173,100	2,947,893.00	0.05
628	002644	佛慈制药	302,200	2,946,450.00	0.05
629	603359	东珠生态	383,484	2,945,157.12	0.05
630	300540	蜀道装备	119,400	2,943,210.00	0.05
631	002441	众业达	310,700	2,942,329.00	0.05

632	300249	依米康	340,400	2,934,248.00	0.05
633	603060	国检集团	348,700	2,929,080.00	0.05
634	600616	金枫酒业	467,800	2,928,428.00	0.05
635	603800	道森股份	110,900	2,927,760.00	0.05
636	600229	城市传媒	387,700	2,927,135.00	0.05
637	002398	垒知集团	609,300	2,906,361.00	0.05
638	688112	鼎阳科技	72,300	2,894,892.00	0.05
639	002342	巨力索具	671,600	2,894,596.00	0.05
640	000886	海南高速	705,800	2,893,780.00	0.05
641	002923	润都股份	233,900	2,886,326.00	0.05
642	002344	海宁皮城	703,400	2,883,940.00	0.05
643	002073	软控股份	438,900	2,883,573.00	0.05
644	603963	大理药业	242,100	2,876,148.00	0.05
645	601700	风范股份	572,400	2,867,724.00	0.05
646	301115	建科股份	159,785	2,860,151.50	0.05
647	600810	神马股份	384,200	2,858,448.00	0.05
648	601999	出版传媒	383,000	2,849,520.00	0.05
649	300472	新元科技	300,100	2,832,944.00	0.05
650	301328	维峰电子	57,700	2,824,992.00	0.05
651	601330	绿色动力	424,600	2,819,344.00	0.05
652	605366	宏柏新材	340,772	2,818,184.44	0.05
653	300349	金卡智能	226,200	2,809,404.00	0.05
654	688020	方邦股份	57,881	2,806,070.88	0.05
655	601163	三角轮胎	193,300	2,785,453.00	0.05
656	000985	大庆华科	171,200	2,770,016.00	0.05
657	600791	京能置业	567,200	2,756,592.00	0.05
658	688051	佳华科技	82,579	2,754,009.65	0.05
659	301223	中荣股份	151,200	2,739,744.00	0.05
660	000632	三木集团	595,200	2,720,064.00	0.05
661	600836	上海易连	697,400	2,671,042.00	0.05
662	688030	山石网科	132,900	2,660,658.00	0.05
663	300957	贝泰妮	39,000	2,658,630.00	0.05
664	600668	尖峰集团	238,900	2,639,845.00	0.05
665	300918	南山智尚	254,600	2,630,018.00	0.05
666	603876	鼎胜新材	209,000	2,618,770.00	0.05
667	300335	迪森股份	462,000	2,587,200.00	0.05
668	688699	明微电子	63,661	2,568,721.35	0.05
669	002367	康力电梯	341,100	2,565,072.00	0.05
670	603150	万朗磁塑	87,400	2,538,970.00	0.04
671	600831	广电网络	483,500	2,533,540.00	0.04
672	688232	新点软件	69,856	2,528,787.20	0.04
673	002883	中设股份	197,900	2,430,212.00	0.04
674	300981	中红医疗	151,600	2,428,632.00	0.04

675	688347	华虹公司	56,173	2,362,636.38	0.04
676	600689	上海三毛	203,200	2,351,024.00	0.04
677	301200	大族数控	61,700	2,330,409.00	0.04
678	600919	江苏银行	346,200	2,316,078.00	0.04
679	600011	华能国际	296,400	2,282,280.00	0.04
680	600479	千金药业	211,000	2,272,470.00	0.04
681	688225	亚信安全	122,100	2,239,314.00	0.04
682	600778	友好集团	357,600	2,235,000.00	0.04
683	600797	浙大网新	327,500	2,148,400.00	0.04
684	688678	福立旺	115,900	2,133,719.00	0.04
685	688579	山大地纬	167,400	2,125,980.00	0.04
686	002922	伊戈尔	142,503	2,116,169.55	0.04
687	300617	安靠智电	69,200	2,100,912.00	0.04
688	001332	锡装股份	63,900	2,099,115.00	0.04
689	002687	乔治白	393,500	2,097,355.00	0.04
690	688510	航亚科技	118,800	2,093,256.00	0.04
691	688659	元琛科技	167,990	2,091,475.50	0.04
692	300708	聚灿光电	183,400	2,068,752.00	0.04
693	688788	科思科技	53,353	2,063,694.04	0.04
694	300586	美联新材	254,846	2,061,704.14	0.04
695	002388	新亚制程	326,900	2,056,201.00	0.04
696	300057	万顺新材	333,000	2,054,610.00	0.04
697	301132	满坤科技	71,500	2,052,765.00	0.04
698	600469	风神股份	332,500	2,051,525.00	0.04
699	301298	东利机械	120,600	2,050,200.00	0.04
700	301009	可靠股份	192,000	2,046,720.00	0.04
701	002026	山东威达	201,600	2,046,240.00	0.04
702	603698	航天工程	142,200	2,043,414.00	0.04
703	603618	杭电股份	319,200	2,042,880.00	0.04
704	603115	海星股份	139,500	2,042,280.00	0.04
705	600152	维科技术	280,300	2,040,584.00	0.04
706	601808	中海油服	139,500	2,039,490.00	0.04
707	600202	哈空调	326,800	2,039,232.00	0.04
708	301282	金禄电子	81,300	2,031,687.00	0.04
709	300986	志特新材	159,595	2,031,644.35	0.04
710	300731	科创新源	96,800	2,028,928.00	0.04
711	301137	哈焊华通	110,900	2,028,361.00	0.04
712	002765	蓝黛科技	301,300	2,021,723.00	0.04
713	300884	狄耐克	154,500	2,020,860.00	0.04
714	300254	仟源医药	209,200	2,014,596.00	0.04
715	300963	中洲特材	153,425	2,012,936.00	0.04
716	688010	福光股份	83,500	2,009,010.00	0.04
717	605196	华通线缆	260,600	2,006,620.00	0.04



718	003029	吉大正元	101,800	2,006,478.00	0.04
719	601089	福元医药	116,100	2,001,564.00	0.04
720	688085	三友医疗	102,600	2,000,700.00	0.04
721	301126	达嘉维康	153,500	2,000,105.00	0.04
722	300272	开能健康	322,400	1,998,880.00	0.04
723	603917	合力科技	112,500	1,998,000.00	0.04
724	002870	香山股份	55,700	1,997,959.00	0.04
725	603219	富佳股份	146,500	1,986,540.00	0.03
726	002420	毅昌科技	317,600	1,981,824.00	0.03
727	603313	梦百合	188,500	1,979,250.00	0.03
728	301369	联动科技	34,200	1,979,154.00	0.03
729	300488	恒锋工具	80,500	1,978,690.00	0.03
730	002696	百洋股份	298,600	1,976,732.00	0.03
731	605001	威奥股份	295,300	1,975,557.00	0.03
732	002900	哈三联	144,700	1,975,155.00	0.03
733	300460	惠伦晶体	160,700	1,970,182.00	0.03
734	300289	利德曼	319,900	1,967,385.00	0.03
735	300959	线上线下	54,500	1,962,000.00	0.03
736	300908	仲景食品	47,500	1,960,325.00	0.03
737	600395	盘江股份	317,100	1,956,507.00	0.03
738	300636	同和药业	185,500	1,955,170.00	0.03
739	002650	加加食品	477,100	1,946,568.00	0.03
740	603203	快克智能	67,200	1,942,752.00	0.03
741	688459	哈铁科技	207,200	1,939,392.00	0.03
742	000581	威孚高科	128,500	1,936,495.00	0.03
743	002853	皮阿诺	149,300	1,924,477.00	0.03
744	301176	逸豪新材	114,700	1,923,519.00	0.03
745	600727	鲁北化工	292,200	1,922,676.00	0.03
746	300193	佳士科技	247,400	1,922,298.00	0.03
747	600113	浙江东日	233,800	1,921,836.00	0.03
748	301201	诚达药业	75,300	1,914,879.00	0.03
749	003023	彩虹集团	94,500	1,914,570.00	0.03
750	001267	汇绿生态	365,500	1,911,565.00	0.03
751	300040	九洲集团	340,580	1,907,248.00	0.03
752	002998	优彩资源	238,700	1,897,665.00	0.03
753	002110	三钢闽光	467,500	1,893,375.00	0.03
754	603887	城地香江	235,200	1,891,008.00	0.03
755	603067	振华股份	184,200	1,876,998.00	0.03
756	002154	报喜鸟	329,500	1,871,560.00	0.03
757	600055	万东医疗	109,400	1,868,552.00	0.03
758	300076	GQY 视讯	342,100	1,867,866.00	0.03
759	603679	华体科技	124,200	1,854,306.00	0.03
760	688132	邦彦技术	86,400	1,851,552.00	0.03

761	600523	贵航股份	132,100	1,819,017.00	0.03
762	301058	中粮科工	166,200	1,816,566.00	0.03
763	603859	能科科技	48,100	1,814,813.00	0.03
764	688697	纽威数控	96,300	1,813,329.00	0.03
765	600228	返利科技	231,000	1,801,800.00	0.03
766	603227	雪峰科技	260,800	1,799,520.00	0.03
767	001206	依依股份	114,000	1,798,920.00	0.03
768	603112	华翔股份	145,600	1,769,040.00	0.03
769	688329	艾隆科技	71,110	1,767,794.60	0.03
770	002818	富森美	141,800	1,766,828.00	0.03
771	301122	采纳股份	51,800	1,753,948.00	0.03
772	300837	浙矿股份	58,500	1,747,395.00	0.03
773	605399	晨光新材	127,500	1,728,900.00	0.03
774	002190	成飞集成	90,800	1,722,476.00	0.03
775	000565	渝三峡 A	272,400	1,718,844.00	0.03
776	605060	联德股份	90,100	1,684,870.00	0.03
777	600235	民丰特纸	273,600	1,679,904.00	0.03
778	301303	真兰仪表	84,798	1,669,672.62	0.03
779	301110	青木股份	40,600	1,632,526.00	0.03
780	002573	清新环境	325,700	1,612,215.00	0.03
781	002391	长青股份	255,900	1,612,170.00	0.03
782	301389	隆扬电子	82,900	1,581,732.00	0.03
783	000401	冀东水泥	245,900	1,571,301.00	0.03
784	603187	海容冷链	100,600	1,525,096.00	0.03
785	603048	浙江黎明	82,100	1,524,597.00	0.03
786	300240	飞力达	224,550	1,513,467.00	0.03
787	600714	金瑞矿业	157,200	1,509,120.00	0.03
788	600478	科力远	306,700	1,508,964.00	0.03
789	300623	捷捷微电	94,800	1,504,476.00	0.03
790	600897	厦门空港	120,100	1,500,049.00	0.03
791	600097	开创国际	138,400	1,479,496.00	0.03
792	300871	回盛生物	101,200	1,463,352.00	0.03
793	605258	协和电子	52,500	1,457,925.00	0.03
794	002543	万和电气	163,400	1,457,528.00	0.03
795	300539	横河精密	116,300	1,443,283.00	0.03
796	301296	新巨丰	139,700	1,438,910.00	0.03
797	001268	联合精密	57,000	1,425,000.00	0.03
798	000726	鲁泰 A	219,500	1,422,360.00	0.02
799	603755	日辰股份	52,900	1,406,082.00	0.02
800	300283	温州宏丰	219,900	1,398,564.00	0.02
801	601101	昊华能源	217,920	1,377,254.40	0.02
802	001222	源飞宠物	91,100	1,339,170.00	0.02
803	605255	天普股份	76,000	1,333,800.00	0.02

804	300519	新光药业	79,600	1,318,972.00	0.02
805	301212	联盛化学	45,700	1,233,900.00	0.02
806	601077	渝农商行	301,000	1,228,080.00	0.02
807	688136	科兴制药	60,431	1,223,727.75	0.02
808	301229	纽泰格	36,700	1,220,275.00	0.02
809	603577	汇金通	116,900	1,215,760.00	0.02
810	300787	海能实业	69,700	1,172,354.00	0.02
811	603272	联翔股份	68,900	1,163,032.00	0.02
812	000011	深物业 A	130,800	1,158,888.00	0.02
813	002282	博深股份	137,900	1,116,990.00	0.02
814	600833	第一医药	92,500	1,111,850.00	0.02
815	603458	勘设股份	127,543	1,100,696.09	0.02
816	300265	通光线缆	117,500	1,088,050.00	0.02
817	301283	聚胶股份	32,500	1,068,600.00	0.02
818	301259	艾布鲁	63,700	1,052,961.00	0.02
819	002272	川润股份	153,800	1,051,992.00	0.02
820	688061	灿瑞科技	26,100	1,044,000.00	0.02
821	300410	正业科技	118,200	1,038,978.00	0.02
822	603895	天永智能	40,300	1,038,934.00	0.02
823	300712	永福股份	38,600	1,034,480.00	0.02
824	603990	麦迪科技	80,000	1,033,600.00	0.02
825	002792	通宇通讯	61,400	1,029,064.00	0.02
826	603768	常青股份	55,500	1,028,970.00	0.02
827	605167	利柏特	107,800	1,023,022.00	0.02
828	002577	雷柏科技	58,000	1,022,540.00	0.02
829	600900	长江电力	43,800	1,022,292.00	0.02
830	301041	金百泽	37,800	1,021,356.00	0.02
831	002213	大为股份	72,400	1,018,668.00	0.02
832	688306	均普智能	182,700	1,017,639.00	0.02
833	603339	四方科技	85,500	1,016,595.00	0.02
834	301361	众智科技	42,600	1,015,584.00	0.02
835	688128	中国电研	49,400	1,013,688.00	0.02
836	601798	蓝科高新	133,100	1,012,891.00	0.02
837	301150	中一科技	30,400	1,011,104.00	0.02
838	002689	远大智能	227,100	1,010,595.00	0.02
839	300575	中旗股份	131,900	1,007,716.00	0.02
840	301366	一博科技	30,100	1,004,437.00	0.02
841	688150	莱特光电	46,500	1,003,935.00	0.02
842	301129	瑞纳智能	37,600	1,001,288.00	0.02
843	300176	派生科技	148,100	1,001,156.00	0.02
844	002759	天际股份	94,100	998,401.00	0.02
845	300099	尤洛卡	161,200	997,828.00	0.02
846	603206	嘉环科技	55,900	995,579.00	0.02

847	688282	理工导航	25,300	994,290.00	0.02
848	301024	霍普股份	32,800	993,840.00	0.02
849	300647	超频三	154,700	993,174.00	0.02
850	301103	何氏眼科	33,100	992,338.00	0.02
851	300479	神思电子	50,400	991,872.00	0.02
852	301187	欧圣电气	49,700	989,527.00	0.02
853	688273	麦澜德	29,700	989,307.00	0.02
854	300439	美康生物	85,200	989,172.00	0.02
855	603173	福斯达	43,900	988,628.00	0.02
856	002912	中新赛克	35,300	988,047.00	0.02
857	603222	济民医疗	123,100	986,031.00	0.02
858	600851	海欣股份	143,300	984,471.00	0.02
859	300513	恒实科技	82,700	982,476.00	0.02
860	603757	大元泵业	40,500	981,720.00	0.02
861	688373	盟科药业	150,100	980,153.00	0.02
862	301121	紫建电子	23,580	979,984.80	0.02
863	002524	光正眼科	151,900	979,755.00	0.02
864	688075	安旭生物	24,300	978,804.00	0.02
865	002365	永安药业	100,000	978,000.00	0.02
866	300542	新晨科技	74,600	977,260.00	0.02
867	600176	中国巨石	99,300	976,119.00	0.02
868	300453	三鑫医疗	127,900	975,877.00	0.02
869	300381	溢多利	132,300	975,051.00	0.02
870	002733	雄韬股份	64,800	974,592.00	0.02
871	000680	山推股份	197,000	973,180.00	0.02
872	601939	建设银行	149,000	969,990.00	0.02
873	688662	富信科技	26,600	969,570.00	0.02
874	001313	粤海饲料	112,400	968,888.00	0.02
875	603258	电魂网络	42,100	967,458.00	0.02
876	603699	纽威股份	69,700	966,042.00	0.02
877	301306	西测测试	24,400	965,996.00	0.02
878	603387	基蛋生物	87,800	965,800.00	0.02
879	002546	新联电子	193,000	965,000.00	0.02
880	603630	拉芳家化	63,000	963,900.00	0.02
881	002227	奥特迅	72,081	963,722.97	0.02
882	600268	国电南自	138,100	962,557.00	0.02
883	002435	长江健康	230,800	962,436.00	0.02
884	002039	黔源电力	69,700	961,163.00	0.02
885	300092	科新机电	72,100	960,372.00	0.02
886	301046	能辉科技	35,400	960,048.00	0.02
887	688201	信安世纪	48,700	958,416.00	0.02
888	688058	宝兰德	20,300	958,363.00	0.02
889	601811	新华文轩	70,100	957,566.00	0.02

890	002679	福建金森	77,600	956,808.00	0.02
891	300179	四方达	107,300	956,043.00	0.02
892	002334	英威腾	109,500	955,935.00	0.02
893	300518	新迅达	55,500	947,940.00	0.02
894	600526	菲达环保	191,300	945,022.00	0.02
895	603916	苏博特	92,400	941,556.00	0.02
896	688529	豪森智能	40,700	938,949.00	0.02
897	000507	珠海港	176,800	929,968.00	0.02
898	300436	广生堂	36,100	925,243.00	0.02
899	000652	泰达股份	237,800	925,042.00	0.02
900	603035	常熟汽饰	49,000	924,630.00	0.02
901	688345	博力威	29,300	921,778.00	0.02
902	300996	普联软件	40,100	918,290.00	0.02
903	002386	天原股份	176,910	912,855.60	0.02
904	301190	善水科技	48,100	912,457.00	0.02
905	301170	锡南科技	29,950	911,378.50	0.02
906	002664	信质集团	54,800	911,324.00	0.02
907	000852	石化机械	148,000	910,200.00	0.02
908	300577	开润股份	61,500	902,205.00	0.02
909	002674	兴业科技	73,800	898,146.00	0.02
910	603085	天成自控	86,700	884,340.00	0.02
911	688426	康为世纪	28,900	882,895.00	0.02
912	002775	文科股份	220,300	881,200.00	0.02
913	603176	汇通集团	141,000	871,380.00	0.02
914	601339	百隆东方	178,500	869,295.00	0.02
915	002562	兄弟科技	210,100	848,804.00	0.01
916	600640	国脉文化	73,800	846,486.00	0.01
917	300733	西菱动力	70,000	842,800.00	0.01
918	300932	三友联众	51,320	835,489.60	0.01
919	603377	东方时尚	194,700	819,687.00	0.01
920	600276	恒瑞医药	18,000	814,140.00	0.01
921	603378	亚士创能	93,600	791,856.00	0.01
922	688015	交控科技	41,900	786,044.00	0.01
923	688045	必易微	18,239	781,176.37	0.01
924	603551	奥普家居	73,200	775,188.00	0.01
925	301234	五洲医疗	22,700	769,076.00	0.01
926	600722	金牛化工	148,200	739,518.00	0.01
927	688231	隆达股份	33,100	728,531.00	0.01
928	002963	豪尔赛	45,800	709,900.00	0.01
929	301365	矩阵股份	43,400	656,208.00	0.01
930	002308	威创股份	195,900	634,716.00	0.01
931	000901	航天科技	63,810	594,709.20	0.01
932	000679	大连友谊	106,400	587,328.00	0.01

933	601899	紫金矿业	45,600	568,176.00	0.01
934	002620	瑞和股份	94,400	507,872.00	0.01
935	301088	戎美股份	33,100	504,113.00	0.01
936	002109	兴化股份	102,200	484,428.00	0.01
937	688353	华盛锂电	17,500	479,500.00	0.01
938	603058	永吉股份	50,900	461,663.00	0.01
939	000552	甘肃能化	139,600	425,780.00	0.01
940	002606	大连电瓷	53,500	422,650.00	0.01
941	300863	卡倍亿	7,900	395,316.00	0.01
942	301335	天元宠物	16,400	350,960.00	0.01
943	002246	北化股份	17,300	141,687.00	0.00
944	600207	安彩高科	28,800	137,376.00	0.00
945	688563	航材股份	1,436	86,863.64	0.00
946	688548	广钢气体	4,048	51,612.00	0.00
947	301526	国际复材	9,723	43,267.35	0.00
948	301487	盟固利	867	35,512.32	0.00
949	688549	中巨芯	4,294	34,738.46	0.00
950	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.00
951	688702	盛科通信	549	26,450.82	0.00
952	688582	芯动联科	648	25,058.16	0.00
953	301559	中集环科	1,315	23,985.60	0.00
954	301486	致尚科技	482	22,774.50	0.00
955	301511	德福科技	982	22,261.94	0.00
956	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
957	301525	儒竞科技	266	21,668.36	0.00
958	301498	乖宝宠物	554	21,500.74	0.00
959	301371	敷尔佳	564	21,195.12	0.00
960	301370	国科恒泰	1,240	19,852.40	0.00
961	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
962	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
963	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
964	688591	泰凌微	681	19,081.62	0.00
965	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
966	301172	君逸数码	438	16,714.08	0.00
967	301362	民爆光电	420	16,178.40	0.00
968	688612	威迈斯	422	16,023.34	0.00
969	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
970	688610	埃科光电	275	14,025.00	0.00
971	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
972	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
973	301210	金杨股份	281	12,779.88	0.00
974	301566	C 达利凯普	576	12,752.64	0.00
975	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00

976	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
977	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
978	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
979	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
980	688592	司南导航	216	10,914.48	0.00
981	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
982	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
983	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
984	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
985	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
986	301372	科净源	231	10,069.29	0.00
987	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
988	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
989	301395	仁信新材	520	9,718.80	0.00
990	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
991	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
992	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
993	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
994	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
995	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
996	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
997	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
998	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
999	688638	誉辰智能	141	8,414.88	0.00
1,000	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
1,001	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
1,002	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
1,003	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
1,004	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
1,005	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
1,006	301578	C辰奕智能	118	8,061.76	0.00
1,007	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
1,008	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
1,009	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
1,010	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
1,011	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
1,012	603275	众辰科技	193	7,662.10	0.00
1,013	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
1,014	603062	麦加芯彩	126	7,284.06	0.00
1,015	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
1,016	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
1,017	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
1,018	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00

1,019	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
1,020	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
1,021	603004	C 鼎龙	195	6,082.05	0.00
1,022	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
1,023	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
1,024	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
1,025	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
1,026	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
1,027	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00
1,028	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
1,029	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
1,030	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
1,031	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
1,032	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
1,033	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
1,034	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00
1,035	603689	皖天然气	100	869.00	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	601699	潞安环能	69,929,058.36	4.18
2	601225	陕西煤业	58,931,738.00	3.52
3	300162	雷曼光电	54,855,861.68	3.28
4	600188	兖矿能源	51,627,616.89	3.08
5	601398	工商银行	50,956,474.00	3.04
6	300389	艾比森	50,099,712.66	2.99
7	600519	贵州茅台	45,606,155.80	2.72
8	600741	华域汽车	43,757,053.27	2.61
9	002270	华明装备	43,579,083.00	2.60
10	601319	中国人保	43,380,700.00	2.59
11	603605	珀莱雅	43,365,345.59	2.59
12	301039	中集车辆	42,920,349.76	2.56
13	000983	山西焦煤	42,760,362.42	2.55
14	300014	亿纬锂能	42,531,088.96	2.54
15	301153	中科江南	41,298,297.91	2.47
16	603338	浙江鼎力	40,958,791.00	2.45
17	300433	蓝思科技	40,259,947.10	2.40
18	000002	万科 A	40,243,781.40	2.40
19	600066	宇通客车	39,436,215.00	2.36
20	605077	华康股份	39,123,950.28	2.34
21	002478	常宝股份	39,079,910.83	2.33



22	600048	保利发展	39,071,408.17	2.33
23	000858	五粮液	38,661,232.01	2.31
24	601989	中国重工	37,894,596.00	2.26
25	601728	中国电信	37,861,501.00	2.26
26	002877	智能自控	37,784,247.00	2.26
27	601615	明阳智能	37,667,308.22	2.25
28	601898	中煤能源	37,543,325.99	2.24
29	601607	上海医药	37,148,705.11	2.22
30	600039	四川路桥	37,116,382.24	2.22
31	000921	海信家电	36,808,811.92	2.20
32	001979	招商蛇口	36,596,397.51	2.19
33	300777	中简科技	36,475,492.00	2.18
34	000521	长虹美菱	35,615,782.56	2.13
35	000811	冰轮环境	35,306,784.89	2.11
36	000333	美的集团	35,213,469.00	2.10
37	300926	博俊科技	35,064,980.80	2.09
38	300308	中际旭创	34,738,920.00	2.08
39	300779	惠城环保	34,726,747.00	2.07
40	688556	高测股份	34,643,293.62	2.07
41	601088	中国神华	33,987,933.00	2.03
42	002669	康达新材	33,578,064.00	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	601699	潞安环能	89,084,311.74	5.32
2	600188	兖矿能源	68,180,170.64	4.07
3	601225	陕西煤业	62,544,855.98	3.74
4	300389	艾比森	48,616,478.76	2.90
5	002270	华明装备	47,421,661.04	2.83
6	600519	贵州茅台	47,301,753.80	2.83
7	301039	中集车辆	47,113,239.19	2.81
8	000983	山西焦煤	47,041,741.60	2.81
9	301153	中科江南	42,487,926.84	2.54
10	300926	博俊科技	41,803,773.47	2.50
11	002478	常宝股份	41,602,763.16	2.49
12	603605	珀莱雅	40,770,307.62	2.44
13	002271	东方雨虹	40,500,776.47	2.42
14	600066	宇通客车	40,207,640.00	2.40
15	000002	万科 A	39,835,807.00	2.38

16	300820	英杰电气	38,947,531.00	2.33
17	603338	浙江鼎力	37,948,578.00	2.27
18	300779	惠城环保	37,772,672.92	2.26
19	000921	海信家电	37,306,211.00	2.23
20	600048	保利发展	36,270,075.00	2.17
21	605077	华康股份	35,946,805.14	2.15
22	601088	中国神华	35,741,501.70	2.14
23	688556	高测股份	35,454,068.96	2.12
24	301268	铭利达	34,502,254.24	2.06
25	002877	智能自控	34,203,335.00	2.04
26	300777	中简科技	34,156,846.00	2.04
27	601882	海天精工	33,764,985.00	2.02

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	21,776,568,549.32
卖出股票收入（成交）总额	18,352,014,048.92

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 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

本基金本报告期末未持有权证投资。

#### 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	11,943,943.22
2	应收清算款	65,674,951.81
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	41,608,454.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	119,227,349.88

### 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

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	002735	王子新材	35,197,296.29	0.62	锁定期
2	300162	雷曼光电	34,825,492.80	0.61	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 量化成长 混合 A	84,125	18,930.46	1,126,915,331.31	70.76	465,609,694.46	29.24
西部利得 量化成长 混合 C	70,388	16,952.22	969,150,198.91	81.22	224,082,969.76	18.78
合计	151,882	18,341.60	2,096,065,530.22	75.24	689,692,664.22	24.76

注：1. “持有人户数”合计数小于各份额级别持有人户数的总和，是由于一个持有人同时持有多个级别基金份额；

2. 分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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	西部利得量化成长混合 A	4,758,740.43	0.2988
	西部利得量化成长混合 C	912,051.73	0.0764
	合计	5,670,792.16	0.2036

### 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 研究部门负责人持有本开放式基金	西部利得量化成长混合 A	>100
	西部利得量化成长混合 C	50~100
	合计	>100

本基金基金经理持有 本开放式基金	西部利得量化成长混合 A	0~10
	西部利得量化成长混合 C	-
	合计	0~10

#### 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额 占基金总 份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占 基金总份额 比例(%)	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	7,629,935.47	0.27	5,050,605.20	0.18	36 个月
基金管理人高级管理人员	1,696,137.21	0.06	-	-	-
基金经理等人员	81,973.03	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	3,764,540.56	0.14	-	-	-
合计	13,172,586.27	0.47	5,050,605.20	0.18	36 个月

注：基金经理等人员持有份额占基金总份额比例为 0.003%，四舍五入后为 0。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	西部利得量化成长混合 A	西部利得量化成长混合 C
基金合同生效日 (2019 年 3 月 19 日) 基金份额总额	177,856,344.09	-
本报告期期初基金 份额总额	785,555,877.51	108,995,959.38
本报告期基金总申 购份额	1,264,559,138.04	1,473,389,126.66
减：本报告期基金 总赎回份额	457,589,989.78	389,151,917.37
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	1,592,525,025.77	1,193,233,168.67

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。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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。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 62,000.00 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，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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 (%)	
方正证券	2	8,098,809,915.83	22.30	4,336,137.56	22.92	-
国海证券	2	6,750,174,082.27	18.59	1,612,621.59	8.52	-
长江证券	1	6,443,448,846.99	17.75	2,811,249.75	14.86	-

国信证券	2	3,469,526,800.33	9.56	2,558,283.18	13.52	-
民生证券	1	3,370,532,909.34	9.28	2,491,425.82	13.17	-
英大证券	1	2,498,153,844.51	6.88	1,826,910.54	9.66	-
中泰证券	1	2,339,805,394.28	6.44	1,741,058.21	9.20	-
海通证券	2	1,592,526,173.03	4.39	854,061.99	4.51	-
东北证券	3	1,221,267,000.95	3.36	300,324.51	1.59	-
光大证券	1	295,172,566.33	0.81	220,171.42	1.16	-
中银国际	3	230,741,189.77	0.64	168,738.29	0.89	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

注：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(%)
方正证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国信证	-	-	-	-	-	-

券						
民生证 券	-	-	-	-	-	-
英大证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-

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
3	西部利得基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修改基金合同等事项的公告	同上	2023年7月29日
4	西部利得基金管理有限公司关于运用公司自有资金申购旗下部分量化基金的公告	同上	2023年10月25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

投资者	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-----	----------------	------------



类别	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20230706-20230711	0.00	817,969,460.02	60,868,652.40	757,100,807.62	27.18
	2	20231027-20231231	0.00	817,969,460.02	60,868,652.40	757,100,807.62	27.18
<b>产品特有风险</b>							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20% 的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

## 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