

西部利得智享量化选股混合型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：西部利得基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 4 月 14 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	62
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	62

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	62
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	62
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12 投资组合报告附注	63
§ 8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	64
§ 9 开放式基金份额变动	64
§ 10 重大事件揭示	65
10.1 基金份额持有人大会决议	65
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
10.4 基金投资策略的改变	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	65
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	66
10.8 其他重大事件	67
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	67
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	67
§ 12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录	67
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	西部利得智享量化选股混合型证券投资基金	
基金简称	西部利得智享量化选股混合	
基金主代码	026466	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 4 月 14 日	
基金管理人	西部利得基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	737,895,198.07 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	西部利得智享量化选股混合 A	西部利得智享量化选股混合 C
下属分级基金的交易代码	026466	026467
报告期末下属分级基金的份额总额	289,798,517.18 份	448,096,680.89 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过股票与债券等资产的合理配置，充分利用研究投资优势，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	大类资产配置策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、融资交易策略、资产支持证券投资策略、可转换债券投资策略、可交换债券投资策略。（详见《基金合同》）
业绩比较基准	中证全指指数收益率*80%+中债-综合全价（总值）指数收益率*20%。
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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵毅	潘琦
	联系电话	021-38572888	0755-22168257
	电子邮箱	service@westleadfund.com	PANQI003@pingan.com.cn
客户服务电话		4007-007-818	95511-3
传真		021-50710261	0755-82080387
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区耀体路 276 号 901 室-908 室	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区耀	广东省深圳市福田区益田路

	体路 276 号 901 室-908 室	5023 号平安金融中心 B 座
邮政编码	200126	518001
法定代表人	何方	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.westleadfund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人处——上海市浦东新区耀体路 276 号晶耀商务广场 3 号楼 9 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	西部利得基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区耀体路 276 号 901 室-908 室

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	2026 年 4 月 14 日（基金合同生效日）-2026 年 6 月 30 日	
	西部利得智享量化选股混合 A	西部利得智享量化选股混合 C
本期已实现收益	21,265,502.78	32,471,121.31
本期利润	26,253,381.16	40,184,423.99
加权平均基金份 额本期利润	0.0907	0.0898
本期加权平均净 值利润率	8.70%	8.61%
本期基金份额净 值增长率	9.08%	8.99%
3.1.2 期 末 数 据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	15,487,482.33	23,537,290.07
期末可供分配基 金份额利润	0.0534	0.0525
期末基金资产净 值	310,277,845.97	479,353,097.15
期末基金份额净 值	1.0707	1.0698

3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	9.08%	8.99%

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

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

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

4. 本基金为本报告期内合同生效的基金。

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

西部利得智享量化选股混合 A

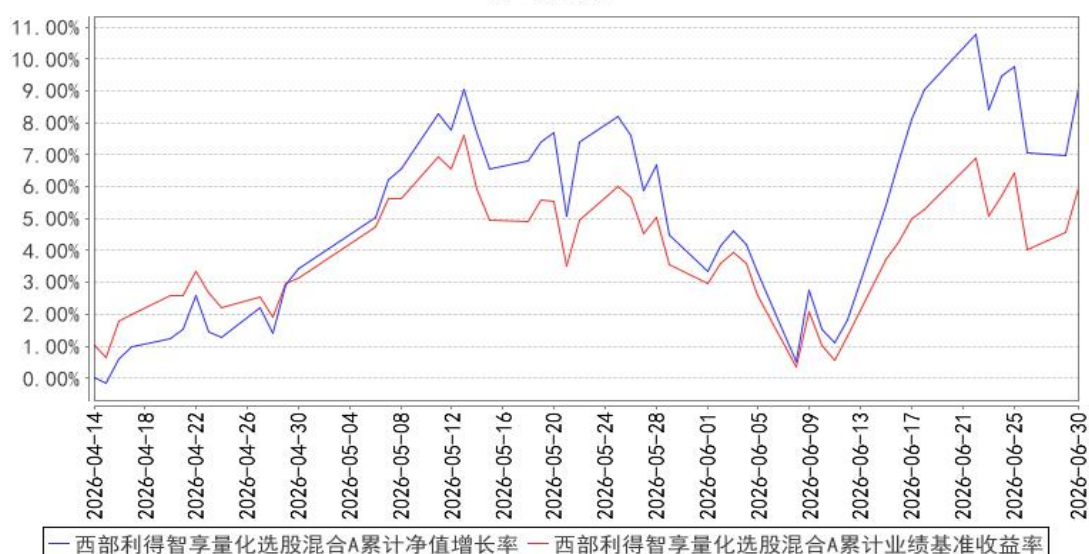
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
自基金合同生效起至今	9.08%	1.31%	5.98%	1.05%	3.10%	0.26%

西部利得智享量化选股混合 C

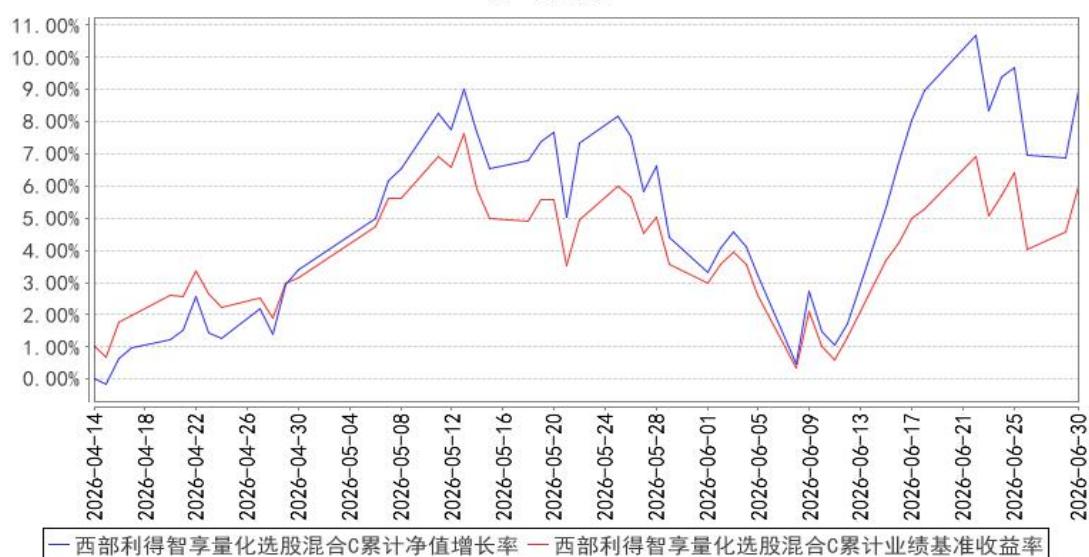
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
自基金合同生效起至今	8.99%	1.31%	5.98%	1.05%	3.01%	0.26%

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

西部利得智享量化选股混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



西部利得智享量化选股混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1. 本基金合同于 2026 年 4 月 14 日生效，截至本报告期末本基金合同生效未满一年。

2. 按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同的有关约定。截至报告期末本基金尚未完成建仓。

3.3 其他指标

无

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
翟梓舰	AI 业务副总监、基金经理	2026 年 4 月 14 日	—	8 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相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、本基金《基金合同》等法律文件和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，力争为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

交易，本基金管理人按照公司制度和流程执行。

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。公司旗下管理的各投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

投资策略上，本基金始终维持高股票仓位，行业配置参考中证全指指数，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基于人工智能的多因子策略，基于分域建模的主动量化策略，努力通过选股获得相对于中证全指指数的稳健超额收益，以期打造优质均衡风格量化基金。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内基金业绩表现参见本报告第三部分“主要财务指标和基金净值表现”。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年上半年 A 股呈现极致 K 型分化行情，流动性整体维持合理充裕，但景气、估值、资金交易结构高度割裂。总量层面宽基指数震荡走平，结构性行情集中于 AI 硬科技成长赛道；资金显著分流，形成“高景气成长抱团、红利资产持续吸金、微盘股阶段性失血”三重格局。上半年“单边成长碾压价值、大盘虹吸小盘”的极致风格或将迎来再平衡修复，全年关注“成长、红利、小

盘轮动修复”投资机会：

1. 成长行情或从普涨走向精选，纯题材高估值标的持续消化估值；
2. 红利价值或具备中长期配置价值，震荡市防御属性凸显；
3. 微盘股估值折价充分，一旦资金从拥挤科技赛道分流，关注估值修复或有机会。

估值修复的再平衡动力充足，关注大小盘、价值成长的收益剪刀差情况。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据相关法律法规的规定，本基金管理人根据企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引等制订了证券投资基金估值政策和程序，以规范基金估值相关工作的流程与方法。本基金管理人设立估值委员会，估值委员会的成员由投资、研究、风险控制、基金核算等有关人员组成。估值委员会负责基金估值政策、程序、估值方法等基金估值相关工作的评估、决策、指导和监督，以确保基金估值的公允与合理。具体职责包括对本基金管理人估值政策和程序的制订及解释；对本基金管理人旗下基金会计估计的调整及解释；在发生影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况，以及在采用新投资策略或投资新品种时，对所采用的估值模型、假设及参数的适当性进行重新评估或修订，必要时聘请会计师事务所进行审核并出具意见。本基金估值结果由本基金管理人完成估值并经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

可参见本报告“6.4.11 利润分配情况”

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人以及基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：西部利得智享量化选股混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	42,597,787.18
结算备付金		3,194,022.00
存出保证金		64,295,966.75
交易性金融资产	6.4.7.2	680,663,063.46
其中：股票投资		680,663,063.46
基金投资		—
债券投资		—
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
其他投资		—
衍生金融资产	6.4.7.3	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—
债权投资	6.4.7.5	—
其中：债券投资		—
资产支持证券投资		—
其他投资		—
其他债权投资	6.4.7.6	—
其他权益工具投资	6.4.7.7	—
应收清算款		—
应收股利		—
应收申购款		—
递延所得税资产		—

其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		790,750,839.39
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		758,901.52
应付托管费		126,483.58
应付销售服务费		153,574.76
应付投资顾问费		-
应交税费		13,340.97
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	67,595.44
负债合计		1,119,896.27
净资产:		
实收基金	6.4.7.10	737,895,198.07
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	51,735,745.05
净资产合计		789,630,943.12
负债和净资产总计		790,750,839.39

注：1. 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 737,895,198.07 份，其中西部利得智享量化选股混合 A 份额总额 289,798,517.18 份，基金份额净值 1.0707 元；西部利得智享量化选股混合 C 份额总额 448,096,680.89 份，基金份额净值 1.0698 元。

2. 本基金为本报告期内基金合同生效的基金，无上年度末可比数据。本财务报表的实际编制期间为自基金合同生效日 2026 年 04 月 14 日起至 2026 年 06 月 30 日止期间。

6.2 利润表

会计主体：西部利得智享量化选股混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		69,145,201.77

1. 利息收入		53,594.01
其中：存款利息收入	6.4.7.13	53,594.01
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）		56,390,426.70
其中：股票投资收益	6.4.7.14	52,776,094.94
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	396,699.99
股利收益	6.4.7.19	3,217,631.77
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	12,701,181.06
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-
减：二、营业总支出		2,707,396.62
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,945,003.16
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	324,167.21
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	393,641.04
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		1,212.81
8. 其他费用	6.4.7.23	43,372.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		66,437,805.15
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		66,437,805.15
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		66,437,805.15

注：本基金为本报告期内基金合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：西部利得智享量化选股混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2026 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	737,081,770.03	-	-	737,081,770.03
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	813,428.04	-	51,735,745.05	52,549,173.09
（一）、综合收益总额	-	-	66,437,805.15	66,437,805.15
（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）	813,428.04	-	42,283.08	855,711.12
其中：1. 基金申购款	813,428.04	-	42,283.08	855,711.12
2. 基金赎回款	-	-	-	-
（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）	-	-	-14,744,343.18	-14,744,343.18
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	737,895,198.07	-	51,735,745.05	789,630,943.12

注：本基金为本报告期内基金合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王汗青	王汗青	许野
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

西部利得智享量化选股混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2025]2805 号《关于准予西部利得智享量化选股混合型证券投资基金注册的批复》核准,由西部利得基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《西部利得智享量化选股混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 737,045,041.18 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 2600087 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《西部利得智享量化选股混合型证券投资基金基金合同》于 2026 年 4 月 14 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 737,081,770.03 份基金份额,其中认购资金利息折合 36,728.85 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,基金托管人为平安银行股份有限公司。

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

基金的投资组合比例为:本基金股票(含存托凭证)资产占基金资产的比例为 60%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。现金不包括结算备付金、存出保证金、

应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：中证全指指数收益率*80%+中债-综合全价(总值)指数收益率*20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》、《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况、自 2026 年 04 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2026 年 04 月 14 日（基金合同生效日）起至 2026 年 06 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

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

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资。

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

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

类。

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

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

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

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

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

(b) 金融负债的分类

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

- － 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

- － 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

6.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

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

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

(b) 后续计量

– 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

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

– 以摊余成本计量的金融资产

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

– 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

– 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

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

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

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

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

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

– 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

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

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

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

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

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

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

预期信用损失准备的列报

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

核销

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

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项

负债所需支付的价格。

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

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

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

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

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损

益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

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

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

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

公允价值变动收益

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《西部利得智享量化选股混合型证券投资基金基金合同》的规定，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；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该类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；由于本基金费用的不同，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。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。如果基金份额持有人所获现金红利不足支付

前述银行转账或其他手续费用，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在不违反法律法规和监管部门的规定及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致后可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，且应于变更实施日前在规定媒介公告。

6.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自2026年1月1日至2027年12月31日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌

公司”)取得的股息红利所得,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂免征收个人所得税。对本基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位:人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	42,597,787.18
等于: 本金	42,593,536.59
加: 应计利息	4,250.59
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	42,597,787.18

注: 定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		668,076,682.40	-	680,663,063.46	12,586,381.06
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		668,076,682.40	-	680,663,063.46	12,586,381.06

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	27,691,920.00	-	-	-
其中：股指期货投资	27,691,920.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	27,691,920.00	-	-	-

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

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2607	IM2607	16.00	27,806,720.00	114,800.00
合计				114,800.00
减：可抵销期货暂收款				114,800.00
净额				0.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资**6.4.7.5.1 债权投资情况**

本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末发生债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资**6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末发生其他债权投资减值准备。

6.4.7.7 其他权益工具投资**6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	42,572.40
其他	25,023.04
合计	67,595.44

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

西部利得智享量化选股混合 A

项目	本期 2026 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	289,480,996.37	289,480,996.37
本期申购	317,520.81	317,520.81
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	289,798,517.18	289,798,517.18

西部利得智享量化选股混合 C

项目	本期 2026 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	447,600,773.66	447,600,773.66
本期申购	495,907.23	495,907.23
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	448,096,680.89	448,096,680.89

注：申购含红利再投资、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

西部利得智享量化选股混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	21,265,502.78	4,987,878.38	26,253,381.16
本期基金份额交易产生的变动数	12,702.10	3,968.08	16,670.18
其中：基金申购款	12,702.10	3,968.08	16,670.18
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-5,790,722.55	-	-5,790,722.55
本期末	15,487,482.33	4,991,846.46	20,479,328.79

西部利得智享量化选股混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	32,471,121.31	7,713,302.68	40,184,423.99
本期基金份额交易产生的变动数	19,789.39	5,823.51	25,612.90
其中：基金申购款	19,789.39	5,823.51	25,612.90
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-8,953,620.63	-	-8,953,620.63
本期末	23,537,290.07	7,719,126.19	31,256,416.26

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	38,664.79

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	7,200.25
其他	7,728.97
合计	53,594.01

注：其他包括结算保证金利息收入以及销售款利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年4月14日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	52,776,094.94
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	52,776,094.94

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年4月14日（基金合同生效日）至2026年6月30日
卖出股票成交总额	1,799,444,437.76
减：卖出股票成本总额	1,743,620,909.40
减：交易费用	3,047,433.42
买卖股票差价收入	52,776,094.94

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无股票出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益**6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无资产支持证券赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无资产支持证券申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益**6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.18 衍生工具收益**6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	396,699.99

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,217,631.77
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	3,217,631.77

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	12,586,381.06
股票投资	12,586,381.06
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	114,800.00
权证投资	—
期货投资	114,800.00
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	12,701,181.06

6.4.7.21 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	12,801.36
信息披露费	29,771.04
证券出借违约金	—
银行费用	800.00
合计	43,372.40

6.4.7.24 分部报告

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
西部证券股份有限公司	2,995,705,215.77	71.14

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年4月14日（基金合同生效日）至2026年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
西部证券股份有限公司	1,335,782.26	71.14	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年4月14日（基金合同生效日）至2026年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,945,003.16
其中：应支付销售机构的客户维护费	926,856.69
应支付基金管理人的净管理费	1,018,146.47

注：1. 支付基金管理人西部利得基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.20% / 当年天数。

2. 本基金在本报告期内成立，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年4月14日（基金合同生效日）至2026年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	324,167.21

注：1. 支付基金托管人平安银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

2. 本基金在本报告期内成立，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	西部利得智享量化选股混合 A	西部利得智享量化选股混合 C	合计
平安银行股份有限公司	—	225,489.89	225,489.89
西部利得基金管理有限公司	—	—	—
西部证券股份有限公司	—	9,810.20	9,810.20
合计	—	235,300.09	235,300.09

注：1. 支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给西部利得基金管理有限公司，再由西部利得基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

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

2. 本基金在本报告期内成立，无上年度可比期间数据。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。本

基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

- 1. 本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。
- 2. 本基金在本报告期成立，无上年度可比区间数据。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

- 1. 本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。
- 2. 本基金在本报告期成立，无上年度可比区间数据。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
平安银行股份有限公司	42,597,787.18	38,664.79

- 注：1. 本基金的银行存款由基金托管人平安银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。
2. 本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

西部利得智享量化选股混合 A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2026 年 5 月 15 日	-	2026 年 5 月 15 日	0.1000	2,778,221.29	116,587.69	2,894,808.98	-
2	2026 年 6 月 26 日	-	2026 年 6 月 26 日	0.1000	2,678,310.27	217,603.30	2,895,913.57	-
合计	-	-	-	0.2000	5,456,531.56	334,190.99	5,790,722.55	-
西部利得智享量化选股混合 C								
序	权益	除息日		每 10 份	现金形	再投资形	本期利	备注

号	登记日	场内	场外	基金份额 分红数	式 发放总 额	式 发放总额	润分配 合计	
1	2026 年 5 月 15 日	-	2026 年 5 月 15 日	0.1000	4,306,19 7.92	169,807.47	4,476,00 5.39	-
2	2026 年 6 月 26 日	-	2026 年 6 月 26 日	0.1000	4,125,90 2.58	351,712.66	4,477,61 5.24	-
合计	-	-	-	0.2000	8,432,10 0.50	521,520.13	8,953,62 0.63	-

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证 券 名 称	成 功 认 购 日	受 限 期	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 （ 单 位： 股）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	锁定期	10.12	27.73	4,412	44,649.44	122,344.76	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	锁定期	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	锁定期	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括信用风险、流动性风险、市场风险等。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人实行全员参与的全面风险管理，董事会及其下设合规审核委员会、监事会、经营管理层及其下设合规及风险管理委员会、督察长、风险管理部、监察稽核部、各业务部门和分支机构均根据公司制度规定履行各自的风险管理职责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用风险评估、交易对手分类管理、投资比例控制等方式来管控信用风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在信用良好的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金于本报告期末未持有债券、资产支持证券、同业存单，因此无相关重大信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严

密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	42,597,787.18	-	-	-	42,597,787.18
结算备付金	3,194,022.00	-	-	-	3,194,022.00
存出保证金	64,295,966.75	-	-	-	64,295,966.75
交易性金融资产	-	-	-	680,663,063.46	680,663,063.46
资产总计	110,087,775.93	-	-	680,663,063.46	790,750,839.39
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	758,901.52	758,901.52
应付托管费	-	-	-	126,483.58	126,483.58
应付销售服务费	-	-	-	153,574.76	153,574.76
应交税费	-	-	-	13,340.97	13,340.97
其他负债	-	-	-	67,595.44	67,595.44
负债总计	-	-	-	1,119,896.27	1,119,896.27
利率敏感度缺口	110,087,775.93	-	-	-679,543,167.19	789,630,943.12

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金主要投资于权益类金融工具，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的重大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）

交易性金融资产—股票投资	680,663,063.46	86.20
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	680,663,063.46	86.20

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2026年6月30日）
	业绩比较基准上升 5%的影响金额	47,340,000.00
	业绩比较基准下降 5%的影响金额	-47,340,000.00

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下： 第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价； 第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值； 第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年6月30日
第一层次	680,428,197.61
第二层次	—

第三层次	234,865.85
合计	680,663,063.46

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2026 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	680,663,063.46	86.08
	其中：股票	680,663,063.46	86.08
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	45,791,809.18	5.79
8	其他各项资产	64,295,966.75	8.13
9	合计	790,750,839.39	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例
----	------	---------	-----------

			(%)
A	农、林、牧、渔业	3,782,357.60	0.48
B	采矿业	19,834,167.00	2.51
C	制造业	486,036,521.92	61.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,849,592.00	2.13
E	建筑业	6,486,087.00	0.82
F	批发和零售业	7,388,560.00	0.94
G	交通运输、仓储和邮政业	9,013,729.00	1.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	36,530,982.14	4.63
J	金融业	62,774,524.00	7.95
K	房地产业	4,676,598.00	0.59
L	租赁和商务服务业	2,721,716.00	0.34
M	科学研究和技术服务业	18,394,884.80	2.33
N	水利、环境和公共设施管理业	3,664,912.50	0.46
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,508,431.50	0.32
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	680,663,063.46	86.20

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	300308	中际旭创	9,100	11,557,000.00	1.46
2	300502	新易盛	14,580	8,850,060.00	1.12
3	300750	宁德时代	19,400	7,624,394.00	0.97
4	603986	兆易创新	6,900	5,623,500.00	0.71
5	601857	中国石油	579,100	5,026,588.00	0.64
6	600176	中国巨石	67,800	4,941,264.00	0.63
7	600519	贵州茅台	4,100	4,860,509.00	0.62
8	300661	圣邦股份	31,600	4,533,968.00	0.57
9	600482	中国动力	137,400	4,506,720.00	0.57
10	601899	紫金矿业	177,800	4,469,892.00	0.57
11	002938	鹏鼎控股	39,400	4,151,972.00	0.53
12	601600	中国铝业	500,500	4,114,110.00	0.52

13	600030	中信证券	142,700	4,099,771.00	0.52
14	601288	农业银行	661,600	4,015,912.00	0.51
15	300394	天孚通信	13,240	4,007,483.20	0.51
16	600150	中国船舶	117,400	3,966,946.00	0.50
17	601398	工商银行	560,400	3,962,028.00	0.50
18	688256	寒武纪	2,402	3,832,511.10	0.49
19	000333	美的集团	50,400	3,806,712.00	0.48
20	601138	工业富联	50,500	3,643,575.00	0.46
21	300408	三环集团	21,750	3,630,075.00	0.46
22	002493	荣盛石化	331,500	3,563,625.00	0.45
23	600674	川投能源	250,300	3,546,751.00	0.45
24	002384	东山精密	13,500	3,541,725.00	0.45
25	300476	胜宏科技	9,700	3,360,371.00	0.43
26	603083	剑桥科技	12,900	3,287,823.00	0.42
27	300604	长川科技	9,500	3,243,490.00	0.41
28	000807	云铝股份	142,400	3,152,736.00	0.40
29	600999	招商证券	146,030	3,081,233.00	0.39
30	688328	深科达	31,881	3,051,011.70	0.39
31	601688	华泰证券	147,500	3,041,450.00	0.39
32	600036	招商银行	82,200	2,918,100.00	0.37
33	600989	宝丰能源	142,500	2,897,025.00	0.37
34	300438	鹏辉能源	34,600	2,866,610.00	0.36
35	300475	香农芯创	9,200	2,760,000.00	0.35
36	603799	华友钴业	57,100	2,755,646.00	0.35
37	601166	兴业银行	165,900	2,747,304.00	0.35
38	002738	中矿资源	45,500	2,684,045.00	0.34
39	002001	新 和 成	94,100	2,674,322.00	0.34
40	300005	探路者	118,000	2,666,800.00	0.34
41	600919	江苏银行	246,900	2,661,582.00	0.34
42	688388	嘉元科技	60,070	2,643,080.00	0.33
43	600900	长江电力	96,400	2,551,708.00	0.32
44	601988	中国银行	446,000	2,551,120.00	0.32
45	000630	铜陵有色	399,800	2,542,728.00	0.32
46	688221	前沿生物	111,529	2,498,249.60	0.32
47	688313	仕佳光子	13,400	2,474,310.00	0.31
48	603259	药明康德	19,800	2,465,298.00	0.31
49	002648	卫星化学	104,700	2,459,403.00	0.31
50	600547	山东黄金	106,200	2,452,158.00	0.31
51	600219	南山铝业	608,200	2,426,718.00	0.31
52	000100	TCL 科技	414,100	2,410,062.00	0.31
53	601939	建设银行	242,900	2,339,127.00	0.30
54	688981	中芯国际	14,542	2,309,560.44	0.29
55	000651	格力电器	61,400	2,302,500.00	0.29

56	605003	众望布艺	108,600	2,226,300.00	0.28
57	688717	艾罗能源	26,691	2,203,875.87	0.28
58	688020	方邦股份	8,700	2,171,520.00	0.28
59	600641	先导基电	53,100	2,116,566.00	0.27
60	300970	华绿生物	115,500	2,111,340.00	0.27
61	601658	邮储银行	427,400	2,107,082.00	0.27
62	603228	景旺电子	29,000	2,099,890.00	0.27
63	002645	华宏科技	74,480	2,048,944.80	0.26
64	688222	成都先导	63,400	2,035,774.00	0.26
65	002768	国恩股份	38,912	2,025,758.72	0.26
66	300179	四方达	33,800	2,008,734.00	0.25
67	688362	甬矽电子	20,800	2,005,120.00	0.25
68	601872	招商轮船	113,800	1,999,466.00	0.25
69	600276	恒瑞医药	38,400	1,998,336.00	0.25
70	601328	交通银行	308,500	1,983,655.00	0.25
71	300480	光力科技	46,400	1,980,352.00	0.25
72	002851	麦格米特	11,800	1,972,724.00	0.25
73	003041	真爱美家	44,800	1,955,520.00	0.25
74	600418	江淮汽车	74,600	1,926,918.00	0.24
75	300731	科创新源	32,880	1,918,876.80	0.24
76	600026	中远海能	106,900	1,917,786.00	0.24
77	301191	菲菱科思	16,620	1,887,201.00	0.24
78	002415	海康威视	55,000	1,881,000.00	0.24
79	601229	上海银行	211,800	1,838,424.00	0.23
80	300737	科顺股份	277,900	1,825,803.00	0.23
81	300825	阿尔特	126,500	1,806,420.00	0.23
82	688385	复旦微电	25,094	1,788,951.26	0.23
83	300033	同花顺	7,400	1,783,400.00	0.23
84	603993	洛阳钼业	101,600	1,783,080.00	0.23
85	688521	芯原股份	4,800	1,781,472.00	0.23
86	000975	山金国际	104,600	1,778,200.00	0.23
87	688700	东威科技	19,775	1,767,885.00	0.22
88	688331	荣昌生物	13,500	1,758,510.00	0.22
89	002225	濮耐股份	371,100	1,755,303.00	0.22
90	000538	云南白药	37,000	1,752,690.00	0.22
91	688068	热景生物	20,200	1,749,320.00	0.22
92	600887	伊利股份	72,500	1,737,100.00	0.22
93	000338	潍柴动力	63,600	1,733,100.00	0.22
94	300723	一品红	46,000	1,714,880.00	0.22
95	688691	灿芯股份	14,700	1,704,171.00	0.22
96	601818	光大银行	587,900	1,699,031.00	0.22
97	600105	永鼎股份	25,100	1,693,748.00	0.21
98	300840	酷特智能	81,900	1,689,597.00	0.21

99	688141	杰华特	11,000	1,688,500.00	0.21
100	688382	益方生物	93,100	1,675,800.00	0.21
101	300418	昆仑万维	41,200	1,662,832.00	0.21
102	688347	华虹宏力	4,900	1,647,870.00	0.21
103	002245	蔚蓝锂芯	87,104	1,629,715.84	0.21
104	300769	德方纳米	24,500	1,629,250.00	0.21
105	000776	广发证券	69,300	1,621,620.00	0.21
106	301230	泓博医药	43,700	1,609,908.00	0.20
107	601211	国泰海通	88,300	1,607,060.00	0.20
108	301002	崧盛股份	41,500	1,601,900.00	0.20
109	002394	联发股份	179,300	1,599,356.00	0.20
110	688041	海光信息	4,304	1,593,771.20	0.20
111	300548	长芯博创	5,700	1,584,600.00	0.20
112	300132	诺斯贝尔	278,800	1,583,584.00	0.20
113	000792	盐湖股份	52,100	1,572,899.00	0.20
114	002494	华斯股份	353,900	1,571,316.00	0.20
115	002250	联化科技	114,400	1,563,848.00	0.20
116	002080	中材科技	17,300	1,557,000.00	0.20
117	300570	太辰光	6,300	1,554,273.00	0.20
118	600527	江南高纤	725,400	1,552,356.00	0.20
119	300620	光库科技	4,100	1,550,620.00	0.20
120	002042	华孚时尚	454,100	1,548,481.00	0.20
121	601668	中国建筑	356,100	1,545,474.00	0.20
122	301526	国际复材	33,100	1,544,777.00	0.20
123	301066	万事利	132,900	1,542,969.00	0.20
124	601838	成都银行	87,100	1,541,670.00	0.20
125	688205	德科立	7,400	1,540,606.00	0.20
126	600448	华纺股份	609,500	1,535,940.00	0.19
127	300986	志特新材	89,400	1,533,210.00	0.19
128	688167	炬光科技	4,300	1,523,103.00	0.19
129	601066	中信建投	52,300	1,520,361.00	0.19
130	300244	迪安诊断	80,900	1,516,066.00	0.19
131	601766	中国中车	290,500	1,510,600.00	0.19
132	002371	北方华创	1,700	1,503,752.00	0.19
133	301536	星辰科技	11,600	1,493,036.00	0.19
134	601077	渝农商行	244,100	1,491,451.00	0.19
135	301507	民生健康	122,400	1,472,472.00	0.19
136	601009	南京银行	148,800	1,471,632.00	0.19
137	688559	海目星	17,500	1,468,600.00	0.19
138	301193	家联科技	78,800	1,460,952.00	0.19
139	301486	致尚科技	7,000	1,458,240.00	0.18
140	600023	浙能电力	276,800	1,455,968.00	0.18
141	002466	天齐锂业	23,700	1,453,284.00	0.18

142	600189	泉阳泉	190,800	1,436,724.00	0.18
143	605006	山东玻纤	67,678	1,427,329.02	0.18
144	688090	瑞松科技	13,300	1,415,785.00	0.18
145	000066	中国长城	74,200	1,413,510.00	0.18
146	300602	飞荣达	27,600	1,413,120.00	0.18
147	002201	九鼎新材	129,200	1,412,156.00	0.18
148	000725	京东方 A	162,200	1,407,896.00	0.18
149	002736	国信证券	140,500	1,403,595.00	0.18
150	601995	中金公司	38,700	1,399,005.00	0.18
151	301529	福赛科技	14,420	1,389,511.20	0.18
152	600660	福耀玻璃	27,500	1,387,100.00	0.18
153	600183	生益科技	7,900	1,369,860.00	0.17
154	300806	斯迪克	12,200	1,366,400.00	0.17
155	601628	中国人寿	38,400	1,357,440.00	0.17
156	603195	公牛集团	34,600	1,354,590.00	0.17
157	600938	中国海油	49,500	1,343,925.00	0.17
158	600246	万通发展	69,800	1,326,200.00	0.17
159	301122	采纳股份	45,000	1,323,450.00	0.17
160	600031	三一重工	75,600	1,306,368.00	0.17
161	601916	浙商银行	483,800	1,272,394.00	0.16
162	600460	士兰微	23,100	1,262,646.00	0.16
163	002049	紫光国微	14,100	1,251,375.00	0.16
164	600585	海螺水泥	72,900	1,235,655.00	0.16
165	601998	中信银行	177,600	1,230,768.00	0.16
166	688381	帝奥微	23,000	1,230,500.00	0.16
167	603011	合锻智能	37,000	1,223,960.00	0.16
168	600601	方正科技	87,500	1,211,000.00	0.15
169	301397	溯联股份	37,400	1,210,264.00	0.15
170	000800	一汽解放	203,400	1,210,230.00	0.15
171	601975	招商南油	322,600	1,203,298.00	0.15
172	600926	杭州银行	83,200	1,202,240.00	0.15
173	603283	赛腾股份	14,740	1,193,645.20	0.15
174	002916	深南电路	2,600	1,190,540.00	0.15
175	603019	中科曙光	11,100	1,190,253.00	0.15
176	688596	正帆科技	15,000	1,185,900.00	0.15
177	300790	宇瞳光学	45,100	1,177,561.00	0.15
178	002979	雷赛智能	21,100	1,176,958.00	0.15
179	301263	泰恩康	57,200	1,172,028.00	0.15
180	600886	国投电力	87,900	1,169,949.00	0.15
181	688202	美迪西	14,400	1,162,224.00	0.15
182	688009	中国通号	242,400	1,153,824.00	0.15
183	002943	宇晶股份	25,560	1,130,518.80	0.14
184	002353	杰瑞股份	7,400	1,128,500.00	0.14

185	300990	同飞股份	10,700	1,124,249.00	0.14
186	002922	伊戈尔	34,100	1,118,480.00	0.14
187	001389	广合科技	4,700	1,115,075.00	0.14
188	301183	东田微	4,200	1,112,454.00	0.14
189	688690	纳微科技	25,200	1,111,320.00	0.14
190	301396	宏景科技	3,300	1,094,280.00	0.14
191	300613	富瀚微	13,600	1,089,088.00	0.14
192	688120	华海清科	3,380	1,088,968.40	0.14
193	002515	金字火腿	107,640	1,077,476.40	0.14
194	300776	帝尔激光	5,000	1,074,800.00	0.14
195	301115	联检科技	30,400	1,065,824.00	0.13
196	600160	巨化股份	20,100	1,065,501.00	0.13
197	688352	硕中科技	43,900	1,061,502.00	0.13
198	688220	翱捷科技	8,500	1,056,720.00	0.13
199	003816	中国广核	270,200	1,056,482.00	0.13
200	603061	金海通	2,100	1,054,662.00	0.13
201	301365	矩阵股份	27,800	1,053,898.00	0.13
202	688628	优利德	10,600	1,048,764.00	0.13
203	000967	盈峰环境	99,400	1,046,682.00	0.13
204	002025	航天电器	13,700	1,044,214.00	0.13
205	603225	新凤鸣	53,100	1,043,415.00	0.13
206	002886	沃特股份	37,000	1,039,330.00	0.13
207	688099	晶晨股份	10,100	1,039,290.00	0.13
208	002458	益生股份	133,580	1,037,916.60	0.13
209	002439	启明星辰	81,900	1,036,035.00	0.13
210	688450	光格科技	15,378	1,030,172.22	0.13
211	688173	希荻微	53,600	1,025,904.00	0.13
212	301588	美新科技	23,400	1,023,984.00	0.13
213	002558	巨人网络	37,100	1,022,476.00	0.13
214	600115	中国东航	267,600	1,019,556.00	0.13
215	000938	紫光股份	35,200	1,015,872.00	0.13
216	000032	深桑达 A	40,600	1,012,970.00	0.13
217	000830	鲁西化工	84,400	1,012,800.00	0.13
218	601018	宁波港	321,400	1,012,410.00	0.13
219	300623	捷捷微电	22,500	1,012,275.00	0.13
220	002179	中航光电	21,900	1,011,780.00	0.13
221	002273	水晶光电	28,500	1,011,180.00	0.13
222	601607	上海医药	65,400	1,007,160.00	0.13
223	688156	路德科技	33,266	1,006,296.50	0.13
224	301362	民爆光电	5,460	1,004,203.20	0.13
225	002281	光迅科技	3,900	1,002,066.00	0.13
226	301239	普瑞眼科	32,590	992,365.50	0.13
227	688301	奕瑞科技	8,000	992,000.00	0.13

228	002531	天顺风能	117,100	987,153.00	0.13
229	688213	思特威	9,200	985,044.00	0.12
230	600707	彩虹股份	58,200	982,998.00	0.12
231	002008	大族激光	6,500	975,715.00	0.12
232	688378	奥来德	15,700	973,400.00	0.12
233	002475	立讯精密	13,800	971,520.00	0.12
234	300681	英搏尔	33,900	970,218.00	0.12
235	301290	东星医疗	35,500	967,375.00	0.12
236	002484	江海股份	9,200	966,000.00	0.12
237	601137	博威合金	43,200	964,656.00	0.12
238	603179	新泉股份	19,400	963,210.00	0.12
239	000060	中金岭南	126,700	959,119.00	0.12
240	601117	中国化学	130,200	956,970.00	0.12
241	688108	赛诺医疗	51,428	952,960.84	0.12
242	688129	东来技术	36,285	950,304.15	0.12
243	688337	普源精电	12,664	948,913.52	0.12
244	601231	环旭电子	29,200	946,080.00	0.12
245	301252	同星科技	23,100	936,243.00	0.12
246	603319	美湖股份	28,100	933,201.00	0.12
247	603290	斯达半导	6,100	932,934.00	0.12
248	002432	九安医疗	13,100	925,908.00	0.12
249	601127	赛力斯	15,100	924,875.00	0.12
250	301018	申菱环境	7,980	922,567.80	0.12
251	300782	卓胜微	8,400	920,472.00	0.12
252	603063	禾望电气	17,300	914,997.00	0.12
253	688249	晶合集成	15,500	914,965.00	0.12
254	301227	森鹰窗业	36,280	914,618.80	0.12
255	002600	领益智造	52,700	913,818.00	0.12
256	605111	新洁能	9,200	912,088.00	0.12
257	301123	奕东电子	7,500	905,400.00	0.11
258	002174	游族网络	71,400	900,354.00	0.11
259	002056	横店东磁	29,500	899,160.00	0.11
260	603067	振华股份	19,300	893,397.00	0.11
261	688371	菲沃泰	22,900	892,871.00	0.11
262	605598	上海港湾	23,100	887,733.00	0.11
263	301068	大地海洋	36,900	878,220.00	0.11
264	301119	正强股份	35,700	876,078.00	0.11
265	688686	奥普特	5,200	875,628.00	0.11
266	000425	徐工机械	108,100	874,529.00	0.11
267	002532	天山铝业	80,700	865,911.00	0.11
268	301033	迈普医学	16,700	864,893.00	0.11
269	300763	锦浪科技	9,500	858,325.00	0.11
270	601985	中国核电	94,700	855,141.00	0.11

271	301169	零点有数	12,100	854,986.00	0.11
272	688191	智洋创新	23,900	853,230.00	0.11
273	300803	指南针	9,300	852,531.00	0.11
274	603267	鸿远电子	10,900	844,532.00	0.11
275	001326	联域股份	14,200	841,918.00	0.11
276	301286	侨源股份	14,500	840,855.00	0.11
277	603507	振江股份	25,500	838,695.00	0.11
278	300416	苏试试验	41,000	835,580.00	0.11
279	301589	诺瓦星云	5,600	834,288.00	0.11
280	301603	乔锋智能	5,800	834,040.00	0.11
281	600773	西藏城投	64,800	833,976.00	0.11
282	000733	振华科技	14,700	832,608.00	0.11
283	600458	时代新材	50,300	832,465.00	0.11
284	603306	华懋科技	8,000	829,520.00	0.11
285	300724	捷佳伟创	11,600	818,960.00	0.10
286	002865	钧达股份	13,700	817,616.00	0.10
287	688365	光云科技	51,800	816,886.00	0.10
288	301024	霍普股份	22,000	810,040.00	0.10
289	000050	深天马 A	81,400	806,674.00	0.10
290	000415	渤海租赁	197,900	805,453.00	0.10
291	000166	申万宏源	182,800	804,320.00	0.10
292	688772	珠海冠宇	40,900	802,867.00	0.10
293	301580	爱迪特	12,480	802,838.40	0.10
294	301203	国泰环保	19,000	802,750.00	0.10
295	002536	飞龙股份	17,000	802,060.00	0.10
296	688787	海天瑞声	5,964	801,859.80	0.10
297	300687	赛意信息	25,800	799,800.00	0.10
298	688079	美迪凯	26,000	799,500.00	0.10
299	003030	祖名股份	38,900	799,395.00	0.10
300	600726	华电能源	112,100	798,152.00	0.10
301	000408	藏格矿业	11,500	797,180.00	0.10
302	300672	国科微	2,700	796,500.00	0.10
303	300567	精测电子	2,500	794,000.00	0.10
304	301280	珠城科技	15,700	793,949.00	0.10
305	301097	天益医疗	22,188	792,111.60	0.10
306	688479	友车科技	20,639	783,662.83	0.10
307	600769	祥龙电业	37,900	777,329.00	0.10
308	301071	力量钻石	8,400	777,000.00	0.10
309	600061	国投资本	118,300	774,865.00	0.10
310	300679	电连技术	12,900	773,871.00	0.10
311	301055	张小泉	18,100	768,707.00	0.10
312	300319	麦捷科技	25,900	767,417.00	0.10
313	301045	天禄科技	8,600	766,088.00	0.10

314	000157	中联重科	109,400	762,518.00	0.10
315	600863	华能蒙电	160,200	752,940.00	0.10
316	688718	唯赛勃	46,873	748,561.81	0.09
317	300857	协创数据	2,200	747,780.00	0.09
318	603713	密尔克卫	10,400	740,168.00	0.09
319	688059	华锐精密	3,700	738,927.00	0.09
320	600226	亨通股份	77,000	738,430.00	0.09
321	688682	霍莱沃	18,922	736,065.80	0.09
322	301607	富特科技	14,080	735,680.00	0.09
323	603660	苏州科达	60,000	735,000.00	0.09
324	002957	科瑞技术	13,400	734,856.00	0.09
325	300283	温州宏丰	35,700	733,635.00	0.09
326	603995	甬金股份	31,500	731,115.00	0.09
327	300928	华安鑫创	25,300	730,664.00	0.09
328	603681	永冠新材	31,800	726,630.00	0.09
329	300938	信测标准	14,560	726,252.80	0.09
330	301631	壹连科技	9,940	714,288.40	0.09
331	002460	赣锋锂业	10,900	712,860.00	0.09
332	688322	奥比中光	5,400	704,970.00	0.09
333	002930	宏川智慧	76,000	699,200.00	0.09
334	301198	喜悦智行	52,000	696,800.00	0.09
335	002747	埃斯顿	18,600	694,338.00	0.09
336	688733	壹石通	16,775	693,646.25	0.09
337	300373	扬杰科技	4,400	691,812.00	0.09
338	301212	联盛化学	29,500	688,825.00	0.09
339	301356	天振股份	26,100	685,647.00	0.09
340	600903	贵州燃气	102,000	677,280.00	0.09
341	002885	京泉华	16,400	670,104.00	0.08
342	603385	惠达卫浴	136,500	666,120.00	0.08
343	600941	中国移动	7,700	663,201.00	0.08
344	300853	申昊科技	21,300	657,957.00	0.08
345	688105	诺唯赞	37,520	650,972.00	0.08
346	300222	科大智能	47,000	650,950.00	0.08
347	002487	大金重工	11,200	649,264.00	0.08
348	301160	翔楼新材	13,900	648,435.00	0.08
349	688235	百济神州	2,538	646,200.18	0.08
350	688416	恒烁股份	4,610	645,400.00	0.08
351	301323	新莱福	7,800	636,402.00	0.08
352	300299	富春股份	128,600	630,140.00	0.08
353	002079	苏州固锝	41,800	628,254.00	0.08
354	300715	凯伦股份	38,100	627,126.00	0.08
355	688112	鼎阳科技	8,500	624,410.00	0.08
356	600961	株冶集团	19,200	621,888.00	0.08

357	600362	江西铜业	14,100	610,530.00	0.08
358	688390	固德威	5,600	607,656.00	0.08
359	301307	美利信	8,000	602,320.00	0.08
360	301345	涛涛车业	2,600	600,600.00	0.08
361	600590	泰豪科技	58,600	591,860.00	0.07
362	688499	利元亨	11,210	589,085.50	0.07
363	688345	博力威	10,100	586,608.00	0.07
364	688679	通源环境	13,900	585,051.00	0.07
365	002420	毅昌科技	107,200	583,168.00	0.07
366	688148	芳源股份	67,100	575,718.00	0.07
367	002793	罗欣药业	149,500	574,080.00	0.07
368	601699	潞安环能	40,200	574,056.00	0.07
369	601728	中国电信	109,900	570,381.00	0.07
370	301382	蜂助手	12,300	565,800.00	0.07
371	688195	腾景科技	2,864	551,549.12	0.07
372	002463	沪电股份	3,600	550,080.00	0.07
373	301127	武汉天源	26,500	549,080.00	0.07
374	300184	力源信息	31,000	544,050.00	0.07
375	605358	立昂微	7,000	543,200.00	0.07
376	301295	美硕科技	12,800	539,904.00	0.07
377	301201	诚达药业	14,800	538,128.00	0.07
378	300745	欣锐科技	12,700	536,194.00	0.07
379	688531	日联科技	3,000	533,520.00	0.07
380	600497	驰宏锌锗	44,000	532,840.00	0.07
381	301095	广立微	4,500	531,225.00	0.07
382	600011	华能国际	69,900	530,541.00	0.07
383	300489	光智科技	1,700	530,315.00	0.07
384	300504	天邑股份	32,800	529,064.00	0.07
385	300966	共同药业	19,200	528,192.00	0.07
386	300513	恒实科技	72,600	525,624.00	0.07
387	688231	隆达股份	14,241	523,071.93	0.07
388	300779	惠城环保	10,160	510,032.00	0.06
389	600000	浦发银行	58,900	507,129.00	0.06
390	600966	博汇纸业	105,900	506,202.00	0.06
391	301393	昊帆生物	7,800	505,206.00	0.06
392	688668	鼎通科技	1,347	502,835.10	0.06
393	300358	楚天科技	62,800	502,400.00	0.06
394	603268	松发股份	3,600	501,408.00	0.06
395	688720	艾森股份	4,900	494,900.00	0.06
396	300870	欧陆通	1,420	490,879.80	0.06
397	000831	中国稀土	8,800	488,312.00	0.06
398	600392	盛和资源	16,400	488,228.00	0.06
399	002313	日海智能	66,400	486,048.00	0.06

400	300428	立中集团	26,700	485,406.00	0.06
401	603803	瑞斯康达	40,700	477,818.00	0.06
402	688028	沃尔德	3,047	474,935.89	0.06
403	002203	海亮股份	20,700	472,995.00	0.06
404	003018	金富科技	6,200	472,626.00	0.06
405	601225	陕西煤业	23,200	472,120.00	0.06
406	300887	谱尼测试	67,800	471,888.00	0.06
407	300720	海川智能	4,900	471,380.00	0.06
408	002222	福晶科技	5,100	470,628.00	0.06
409	300689	澄天伟业	6,700	470,206.00	0.06
410	688103	国力电子	6,300	468,783.00	0.06
411	688307	中润光学	5,816	464,989.20	0.06
412	002838	道恩股份	15,100	462,362.00	0.06
413	688758	赛分科技	21,000	462,210.00	0.06
414	688087	英科再生	13,800	461,196.00	0.06
415	603257	中国瑞林	5,900	460,141.00	0.06
416	002780	三夫户外	37,800	458,892.00	0.06
417	301235	华康洁净	6,100	457,561.00	0.06
418	688710	益诺思	6,800	456,960.00	0.06
419	688721	龙图光罩	7,800	455,364.00	0.06
420	688667	菱电电控	3,400	454,410.00	0.06
421	300843	胜蓝股份	2,900	453,125.00	0.06
422	300786	国林科技	18,000	451,260.00	0.06
423	002803	吉宏股份	17,400	449,616.00	0.06
424	601898	中煤能源	36,900	449,442.00	0.06
425	300390	天华新能	4,800	448,848.00	0.06
426	688419	耐科装备	5,700	448,305.00	0.06
427	688418	震有科技	9,300	447,144.00	0.06
428	300201	海伦哲	21,100	444,577.00	0.06
429	002396	星网锐捷	23,100	442,827.00	0.06
430	301369	联动科技	1,800	441,000.00	0.06
431	603115	海星股份	3,600	440,892.00	0.06
432	688261	东微半导	4,200	440,706.00	0.06
433	301257	普蕊斯	9,700	440,186.00	0.06
434	688253	英诺特	7,300	440,044.00	0.06
435	002299	圣农发展	29,000	439,640.00	0.06
436	002785	万里石	9,900	438,669.00	0.06
437	603826	坤彩科技	17,100	437,076.00	0.06
438	688199	久日新材	12,600	435,078.00	0.06
439	600584	长电科技	4,200	434,910.00	0.06
440	688621	阳光诺和	7,900	433,789.00	0.05
441	688071	华依科技	11,900	433,636.00	0.05
442	688135	利扬芯片	10,297	433,297.76	0.05

443	688010	福光股份	8,900	432,807.00	0.05
444	688518	联赢激光	14,000	432,600.00	0.05
445	002963	豪尔赛	20,500	431,730.00	0.05
446	603800	洪田股份	5,300	430,837.00	0.05
447	301312	智立方	3,700	429,237.00	0.05
448	300572	安车检测	15,100	428,387.00	0.05
449	688197	首药控股	12,800	427,648.00	0.05
450	688179	阿拉丁	15,400	426,734.00	0.05
451	300331	苏大维格	6,000	426,660.00	0.05
451	300761	立华股份	26,000	426,660.00	0.05
452	688508	芯朋微	4,557	423,618.72	0.05
453	300590	移为通信	29,500	423,325.00	0.05
454	603031	安孚科技	7,900	420,675.00	0.05
455	301093	华兰股份	3,100	420,453.00	0.05
456	301099	雅创电子	4,400	420,200.00	0.05
457	688209	英集芯	14,415	419,188.20	0.05
458	300042	朗科科技	5,500	418,935.00	0.05
459	688049	炬芯科技	8,900	417,499.00	0.05
460	688530	欧莱新材	4,300	416,670.00	0.05
461	301150	中一科技	6,600	416,526.00	0.05
462	301067	显盈科技	11,000	416,020.00	0.05
463	603931	格林达	7,000	415,800.00	0.05
464	002090	金智科技	47,000	415,480.00	0.05
465	002057	中钢天源	33,400	415,162.00	0.05
466	688386	泛亚微透	4,600	413,264.00	0.05
467	002810	山东赫达	16,700	412,490.00	0.05
468	002796	世嘉科技	10,100	411,878.00	0.05
469	688601	力芯微	6,800	411,740.00	0.05
470	688305	科德数控	6,300	411,201.00	0.05
471	301265	华新科技	14,900	410,495.00	0.05
472	301186	超达装备	10,000	410,000.00	0.05
473	688166	博瑞医药	11,700	409,617.00	0.05
474	301363	美好医疗	22,260	408,025.80	0.05
475	002980	华盛昌	3,500	407,890.00	0.05
476	300836	佰奥智能	5,500	406,945.00	0.05
477	301326	捷邦科技	2,900	404,173.00	0.05
478	002843	泰嘉股份	18,800	403,636.00	0.05
479	300450	先导智能	9,900	403,128.00	0.05
480	688428	诺诚健华	14,104	401,540.88	0.05
481	301188	力诺药包	6,000	401,400.00	0.05
482	300263	隆华科技	24,600	400,980.00	0.05
483	300943	春晖智控	8,900	400,055.00	0.05
484	603701	德宏股份	18,200	400,036.00	0.05

485	600510	黑牡丹	53,600	399,856.00	0.05
486	300862	蓝盾光电	19,100	398,044.00	0.05
487	301086	鸿富瀚	1,900	397,632.00	0.05
488	301387	光大同创	4,300	397,406.00	0.05
489	688360	德马科技	22,200	397,380.00	0.05
490	688210	统联精密	9,800	396,998.00	0.05
491	603130	云中马	9,500	396,625.00	0.05
492	002712	思美传媒	95,100	394,665.00	0.05
493	301281	科源制药	8,000	394,400.00	0.05
494	688351	微电生理	17,400	394,284.00	0.05
495	300842	帝科股份	4,400	392,348.00	0.05
496	688609	九联科技	35,600	391,956.00	0.05
497	301557	常友科技	4,300	390,913.00	0.05
498	301568	思泰克	3,500	390,600.00	0.05
499	300508	维宏股份	6,800	390,524.00	0.05
500	688799	华纳药厂	8,700	390,369.00	0.05
501	605287	德才股份	9,400	390,006.00	0.05
502	688237	超卓航科	7,300	389,966.00	0.05
503	300174	元力股份	13,200	385,704.00	0.05
504	301289	国缆检测	8,200	385,482.00	0.05
505	600019	宝钢股份	70,800	384,444.00	0.05
506	300959	线上线下	2,600	384,306.00	0.05
507	603040	新坐标	6,090	384,096.30	0.05
508	001212	中旗新材	8,100	383,778.00	0.05
509	301148	嘉戎技术	7,200	383,472.00	0.05
510	002975	博杰股份	2,700	383,400.00	0.05
511	002655	共达电声	8,300	381,800.00	0.05
512	002919	名臣健康	20,100	381,699.00	0.05
513	688768	容知日新	7,400	381,396.00	0.05
514	002929	润建股份	5,700	381,216.00	0.05
515	688737	中自科技	19,900	380,886.00	0.05
516	300473	德尔股份	12,500	380,000.00	0.05
517	688258	卓易信息	3,200	379,328.00	0.05
518	301322	绿通科技	7,100	378,785.00	0.05
519	600396	华电辽能	25,300	378,488.00	0.05
520	301591	肯特股份	8,000	378,400.00	0.05
521	301021	英诺激光	3,100	377,890.00	0.05
522	688035	德邦科技	4,100	376,380.00	0.05
523	688500	慧辰股份	8,300	376,239.00	0.05
524	300952	恒辉安防	21,600	375,840.00	0.05
525	300499	高澜股份	9,700	375,390.00	0.05
526	300903	科翔股份	3,700	374,847.00	0.05
527	603618	杭电股份	7,500	374,100.00	0.05

528	688171	纬德信息	8,500	373,660.00	0.05
529	001367	海森药业	20,200	372,286.00	0.05
530	688273	麦澜德	9,600	371,904.00	0.05
531	600050	中国联通	92,900	371,600.00	0.05
532	002048	宁波华翔	16,100	370,300.00	0.05
533	688379	华光新材	4,400	369,732.00	0.05
534	603777	来伊份	23,800	369,614.00	0.05
535	603286	日盈电子	8,100	369,603.00	0.05
536	300286	安科瑞	15,300	369,495.00	0.05
537	301003	江苏博云	6,900	369,150.00	0.05
538	603421	鼎信通讯	60,000	369,000.00	0.05
539	002348	高乐股份	35,000	368,900.00	0.05
540	688292	浩瀚深度	19,800	368,280.00	0.05
541	603150	万朗磁塑	5,200	368,160.00	0.05
542	688757	胜科纳米	5,500	366,850.00	0.05
543	300920	润阳科技	10,600	366,230.00	0.05
544	688598	金博股份	7,400	365,930.00	0.05
545	688228	开普云	4,700	363,498.00	0.05
546	688392	骄成超声	1,600	363,488.00	0.05
547	300881	盛德鑫泰	9,700	363,265.00	0.05
548	603186	华正新材	1,600	360,480.00	0.05
549	300617	安靠智电	6,800	360,332.00	0.05
550	002545	东方铁塔	22,200	360,084.00	0.05
551	301391	卡莱特	6,300	359,730.00	0.05
552	601319	中国人保	53,200	359,632.00	0.05
553	688095	福昕软件	6,046	359,313.78	0.05
554	000426	兴业银锡	10,900	359,264.00	0.05
555	301046	能辉科技	14,000	359,240.00	0.05
556	688480	赛恩斯	4,100	359,119.00	0.05
557	301128	强瑞技术	2,300	358,570.00	0.05
558	300976	达瑞电子	4,500	358,425.00	0.05
559	002708	光洋股份	27,000	356,130.00	0.05
560	688109	品茗科技	4,700	355,790.00	0.05
561	301560	众捷汽车	13,300	355,509.00	0.05
562	300056	中创环保	48,900	355,503.00	0.05
563	603538	美诺华	10,900	354,795.00	0.04
564	300616	尚品宅配	34,000	354,280.00	0.04
565	002735	王子新材	21,800	353,814.00	0.04
566	002297	博云新材	12,200	353,678.00	0.04
567	600685	中船防务	13,900	353,616.00	0.04
568	603676	卫信康	43,900	353,395.00	0.04
569	301285	鸿日达	3,200	353,056.00	0.04
570	688267	中触媒	17,700	348,690.00	0.04

571	301299	卓创资讯	7,900	348,074.00	0.04
572	001288	运机集团	14,600	347,334.00	0.04
573	300813	泰林生物	18,100	345,529.00	0.04
574	301172	君逸数码	13,300	345,135.00	0.04
575	605168	三人行	6,800	344,352.00	0.04
576	300816	艾可蓝	4,700	344,040.00	0.04
577	688677	海泰新光	3,400	343,842.00	0.04
578	600027	华电国际	77,200	343,540.00	0.04
579	000700	模塑科技	23,000	339,480.00	0.04
580	002970	锐明技术	6,300	336,609.00	0.04
581	688030	山石网科	21,200	334,748.00	0.04
582	603439	三力制药	26,300	331,643.00	0.04
583	301499	维科精密	11,300	329,734.00	0.04
584	000070	特发信息	15,800	329,272.00	0.04
585	002709	天赐材料	6,400	329,152.00	0.04
586	600686	金龙汽车	29,100	328,539.00	0.04
587	301373	凌玮科技	2,100	326,550.00	0.04
588	601888	中国中免	6,000	322,260.00	0.04
589	300556	丝路视觉	18,400	319,608.00	0.04
590	300553	集智股份	5,200	319,228.00	0.04
591	603093	南华期货	17,500	317,625.00	0.04
592	600973	宝胜股份	44,300	314,087.00	0.04
593	301176	逸豪新材	4,600	312,800.00	0.04
594	601778	晶科科技	72,600	312,180.00	0.04
595	300626	华瑞股份	8,900	310,432.00	0.04
596	688335	复洁科技	12,842	308,721.68	0.04
597	300814	中富电路	1,500	306,750.00	0.04
598	300922	天秦装备	20,200	306,030.00	0.04
599	688503	聚和材料	2,300	305,210.00	0.04
600	301366	一博科技	4,900	299,733.00	0.04
601	600188	兖矿能源	16,200	287,874.00	0.04
602	002805	丰元股份	9,900	283,041.00	0.04
603	603311	金海高科	7,700	282,205.00	0.04
604	603678	火炬电子	3,400	282,200.00	0.04
605	300907	康平科技	5,000	280,000.00	0.04
606	300839	博汇股份	23,000	269,330.00	0.03
607	300503	昊志机电	2,900	267,670.00	0.03
608	300031	宝通科技	9,100	259,987.00	0.03
609	601233	桐昆股份	11,900	257,635.00	0.03
610	600498	烽火通信	3,500	257,600.00	0.03
611	002081	金螳螂	59,100	255,903.00	0.03
612	600184	光电股份	7,900	252,879.00	0.03
613	300223	北京君正	1,000	248,900.00	0.03

614	300491	通合科技	6,500	248,235.00	0.03
615	002129	TCL 中环	20,500	246,410.00	0.03
616	002897	意华股份	2,800	246,344.00	0.03
617	688045	必易微	3,044	245,894.32	0.03
618	688396	华润微	2,500	243,875.00	0.03
619	002821	凯莱英	1,500	243,000.00	0.03
620	605198	安德利	3,800	240,768.00	0.03
621	603886	元祖股份	18,200	232,596.00	0.03
622	688246	嘉和美康	11,300	232,215.00	0.03
623	688075	安旭生物	7,700	229,152.00	0.03
624	000783	长江证券	23,400	228,150.00	0.03
625	600186	莲花控股	16,200	226,800.00	0.03
626	601881	中国银河	17,800	223,746.00	0.03
627	688410	山外山	15,400	221,144.00	0.03
628	002290	禾盛新材	2,400	220,488.00	0.03
629	600909	华安证券	19,800	219,978.00	0.03
630	603120	肯特催化	4,100	218,735.00	0.03
631	002364	中恒电气	4,000	215,200.00	0.03
632	603256	宏和科技	800	212,264.00	0.03
633	301051	信濠光电	10,920	211,848.00	0.03
634	300260	新莱应材	2,100	210,966.00	0.03
635	300571	平治信息	4,600	210,036.00	0.03
636	300975	商络电子	4,000	207,000.00	0.03
637	002714	牧原股份	5,900	206,441.00	0.03
638	301041	金百泽	6,100	205,875.00	0.03
639	603738	泰晶科技	3,400	204,170.00	0.03
640	301031	中熔电气	1,700	203,065.00	0.03
641	600203	福日电子	16,700	202,905.00	0.03
642	301248	杰创智能	2,400	201,432.00	0.03
643	688515	裕太微	800	199,008.00	0.03
644	300607	拓斯达	4,800	197,904.00	0.03
645	603901	永创智能	18,100	196,747.00	0.02
646	600489	中金黄金	10,900	196,745.00	0.02
647	605369	拱东医疗	11,180	196,097.20	0.02
648	000977	浪潮信息	2,800	196,000.00	0.02
649	002927	泰永长征	10,000	194,500.00	0.02
650	688070	纵横股份	5,200	194,116.00	0.02
651	688216	气派科技	4,600	193,246.00	0.02
652	688600	皖仪科技	5,805	193,190.40	0.02
653	002602	世纪华通	13,700	193,170.00	0.02
654	002555	三七互娱	10,200	192,474.00	0.02
655	002748	世龙实业	18,300	191,784.00	0.02
656	688008	澜起科技	616	190,898.40	0.02

657	002156	通富微电	2,500	189,675.00	0.02
658	301178	天亿马	3,800	189,050.00	0.02
659	605289	罗曼股份	1,300	188,500.00	0.02
660	688368	晶丰明源	860	186,207.20	0.02
661	600015	华夏银行	29,100	185,949.00	0.02
662	002266	浙富控股	36,400	184,184.00	0.02
663	000567	海德股份	30,800	183,876.00	0.02
664	300168	万达信息	40,000	183,600.00	0.02
665	300835	龙磁科技	800	183,592.00	0.02
666	603527	众源新材	15,400	183,568.00	0.02
667	601126	四方股份	2,900	183,280.00	0.02
668	688180	君实生物	5,300	179,246.00	0.02
669	300025	华星创业	42,400	178,080.00	0.02
670	688569	铁科轨道	11,005	177,730.75	0.02
671	300726	宏达电子	2,100	177,597.00	0.02
672	600869	远东股份	5,300	177,391.00	0.02
673	688182	灿勤科技	4,100	176,587.00	0.02
674	600232	金鹰股份	28,000	176,400.00	0.02
675	300710	万隆光电	5,100	175,950.00	0.02
676	002835	同为股份	15,300	175,491.00	0.02
677	688177	百奥泰	10,400	174,928.00	0.02
678	600366	宁波韵升	11,900	174,692.00	0.02
679	300575	中旗股份	35,300	173,676.00	0.02
680	300176	鸿特科技	35,800	173,630.00	0.02
681	001339	智微智能	1,690	172,853.20	0.02
682	300239	东宝生物	32,400	172,692.00	0.02
683	001289	龙源电力	11,000	171,930.00	0.02
684	601798	蓝科高新	23,700	171,588.00	0.02
685	601111	中国国航	28,300	171,215.00	0.02
686	601918	新集能源	19,900	170,941.00	0.02
687	002606	大连电瓷	12,700	170,307.00	0.02
688	688207	格灵深瞳	8,400	168,840.00	0.02
689	300069	金利华电	5,300	168,699.00	0.02
690	601601	中国太保	5,900	168,268.00	0.02
691	603076	乐惠国际	8,100	167,832.00	0.02
692	002479	富春环保	39,700	167,137.00	0.02
693	300407	凯发电气	15,400	166,320.00	0.02
694	301111	粤万年青	6,400	165,632.00	0.02
695	001366	播恩集团	15,200	164,768.00	0.02
696	688227	品高股份	1,600	164,304.00	0.02
697	688005	容百科技	5,368	164,260.80	0.02
698	000681	视觉中国	8,200	163,508.00	0.02
699	300709	精研科技	2,900	163,125.00	0.02

700	000657	中钨高新	1,700	162,724.00	0.02
701	300921	南凌科技	8,000	162,480.00	0.02
702	600395	盘江股份	35,600	162,336.00	0.02
703	688719	爱科赛博	2,100	161,700.00	0.02
704	301516	中远通	11,300	159,895.00	0.02
705	300206	理邦仪器	13,000	158,990.00	0.02
706	603285	键邦股份	3,500	156,835.00	0.02
707	002357	富临运业	17,600	156,640.00	0.02
708	601088	中国神华	4,000	156,160.00	0.02
709	300953	震裕科技	1,160	155,092.00	0.02
710	600711	盛屯矿业	13,800	151,386.00	0.02
711	301020	密封科技	6,900	150,696.00	0.02
712	600714	金瑞矿业	7,300	149,869.00	0.02
713	000063	中兴通讯	4,100	148,379.00	0.02
714	301012	扬电科技	6,300	147,987.00	0.02
715	688593	新相微	3,800	147,896.00	0.02
716	688472	阿特斯	13,200	142,824.00	0.02
717	301308	江波龙	200	140,760.00	0.02
718	688620	安凯微	8,300	134,460.00	0.02
719	301026	浩通科技	6,600	133,452.00	0.02
720	300328	宜安科技	9,500	133,380.00	0.02
721	300077	国民技术	4,200	131,670.00	0.02
722	300721	怡达股份	3,400	128,010.00	0.02
723	001399	惠科股份	4,412	122,344.76	0.02
724	600549	厦门钨业	1,300	110,760.00	0.01
725	301377	鼎泰高科	200	110,180.00	0.01
726	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
727	300013	新宁物流	24,100	93,990.00	0.01
728	688217	睿昂基因	4,529	93,569.14	0.01
729	603045	福达合金	1,300	92,807.00	0.01
730	002952	亚世光电	4,200	92,526.00	0.01
731	603258	电魂网络	7,300	87,527.00	0.01
732	603823	百合花	1,400	76,398.00	0.01
733	002837	英维克	910	72,399.60	0.01
734	600809	山西汾酒	600	65,622.00	0.01
735	301662	宏工科技	365	36,981.80	0.00
736	688369	致远互联	1,559	32,754.59	0.00
737	688599	天合光能	1,500	21,180.00	0.00
738	605580	恒盛能源	600	16,566.00	0.00
739	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	22,070,797.00	2.80
2	601899	紫金矿业	21,092,749.00	2.67
3	300502	新易盛	17,977,169.00	2.28
4	300750	宁德时代	17,309,262.00	2.19
5	300394	天孚通信	13,766,834.00	1.74
6	688256	寒武纪	13,115,869.84	1.66
7	300476	胜宏科技	12,326,009.00	1.56
8	600519	贵州茅台	12,073,985.00	1.53
9	603986	兆易创新	11,964,145.00	1.52
10	600547	山东黄金	11,369,096.20	1.44
11	002384	东山精密	10,687,911.00	1.35
12	601138	工业富联	10,679,102.00	1.35
13	600487	亨通光电	10,004,867.00	1.27
14	688521	芯原股份	9,177,869.86	1.16
15	000975	山金国际	9,073,356.00	1.15
16	603259	药明康德	8,961,447.00	1.13
17	601857	中国石油	8,284,432.00	1.05
18	002463	沪电股份	8,004,964.00	1.01
19	002738	中矿资源	7,972,031.00	1.01
20	600176	中国巨石	7,931,829.00	1.00

注：本表“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	15,589,326.00	1.97
2	601899	紫金矿业	14,457,408.09	1.83
3	603986	兆易创新	13,080,672.00	1.66
4	300502	新易盛	12,908,666.00	1.63
5	688256	寒武纪	12,260,343.95	1.55
6	300394	天孚通信	11,449,562.20	1.45
7	600487	亨通光电	11,418,125.00	1.45
8	002384	东山精密	9,450,278.46	1.20
9	300476	胜宏科技	9,421,570.00	1.19
10	002463	沪电股份	8,856,739.81	1.12
11	300750	宁德时代	8,731,295.00	1.11
12	600183	生益科技	8,378,577.00	1.06
13	688521	芯原股份	8,241,859.26	1.04
14	601138	工业富联	7,826,273.00	0.99

15	600547	山东黄金	7,811,916.00	0.99
16	002709	天赐材料	7,203,085.00	0.91
17	688008	澜起科技	7,058,212.95	0.89
18	688668	鼎通科技	6,960,855.88	0.88
19	001389	广合科技	6,833,480.00	0.87
20	002008	大族激光	6,817,512.00	0.86

注：本表“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,411,697,591.80
卖出股票收入（成交）总额	1,799,444,437.76

注：本表“买入股票成本（成交）总额”，“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，选择流动性好、交易活跃的标的指数对应的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，同时兼顾基差的变化，以达到有效跟踪并力争超越标的指数的目的。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	64,295,966.75
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	64,295,966.75

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
西部利得智享量化选股混合 A	3,054	94,891.46	12,315,642.83	4.25	277,482,874.35	95.75
西部利得智享量化选股混合 C	8,467	52,922.72	13,970,433.39	3.12	434,126,247.50	96.88
合计	11,435	64,529.53	26,286,076.22	3.56	711,609,121.85	96.44

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

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	西部利得智享量化选股混合 A	55,631.87	0.0192
	西部利得智享量化选股混合 C	20,000.00	0.0045
	合计	75,631.87	0.0102

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	西部利得智享量化选股混合 A	西部利得智享量化选股混合 C
基金合同生效日 (2026 年 4 月 14 日) 基金份额总额	289,480,996.37	447,600,773.66

基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	317,520.81	495,907.23
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	289,798,517.18	448,096,680.89

注：其中“总申购份额”含红利再投、转换入份额；“总赎回份额”含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开本基金份额持有人大会，无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人的重大人事变动如下：

根据基金管理人第二届董事会第五十一次会议决议，自 2026 年 4 月 23 日起聘任王汗青担任公司总经理，董事长何方不再代为履行公司总经理职务。

2026 年 6 月 23 日，根据托管人工作安排，聘任宋卓先生为平安银行股份有限公司资产托管部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金进行审计。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
西部证券	3	2,995,705,215.77	71.14	1,335,782.26	71.14	-
平安证券	3	1,215,194,349.83	28.86	541,898.20	28.86	-

注：1. 本基金交易单元的选择标准主要包括：(1) 主体指标，包括证券公司的财务状况评估、经营规范评估、合规内控评估；(2) 研究服务指标，包括证券公司的研究资源评估、研究能力评估、研究合规性持续评估等。选择程序主要如下：基于上述评估指标，公司定期开展券商准入评估，结合负面剔除情形，形成研究服务准入白名单，公司对进入研究服务准入白名单的券商进行券结业务准入评估，通过评估的券商可开展基金产品券商交易模式下的业务合作，签订经纪服务相关协议。

2. 上表为本基金通过证券公司进行股票投资及佣金支付情况，报告期间为 2026 年 04 月 14 日-2026 年 6 月 30 日。

3. 本基金采用券商交易结算模式。本基金选择的证券经纪商为平安证券股份有限公司、西部证券股份有限公司。西部证券股份有限公司为本基金管理人的股东。平安证券股份有限公司与本基金托管人平安银行受同一母公司控制。

4. 证券经营机构的佣金费率如下：

平安证券股份有限公司：沪深北交易所股票交易佣金费率为 0.05%（含费），基金交易佣金费率为 0.05%，港股通交易佣金费率为 0.05%。沪深企业转债交易佣金费率为 0.004%（含费），记账国债、企业债、公司债、凭证国债、私募债以及债券回购交易不收取佣金。

西部证券股份有限公司：沪深北交易所股票交易佣金费率为 0.05%（含费），沪深港股通交易佣金费率为 0.0423%，沪深优先股交易佣金费率为 0.05%。沪深债券交易佣金费率为 0.001%，其中沪深可转债交易佣金费率为 0.004%，沪市可交换公司债交易佣金费率为 0.001%。北交所可

转债交易佣金费率为 0.008%（含费），北交所公司债交易佣金费率为 0.001%，股转 A 可转债交易不收取佣金。沪深协议式回购交易佣金费率为 0.001%。沪深基金交易佣金费率为 0.008%，其中沪深债券 ETF 和货币 ETF 交易不收取佣金。回购交易佣金费率按品种列示如下：1 天期 0.001%，2 天期 0.002%，3 天期 0.003%，4 天期 0.004%，7 天期 0.005%，14 天期 0.01%，28 天期 0.02%，91 天和 182 天期 0.03%。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

10.8 其他重大事件

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

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本报告期内，本基金未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （1）中国证监会批准本基金设立的相关文件；
- （2）本基金《基金合同》；
- （3）本基金更新的《招募说明书》；

- (4) 本基金《托管协议》;
- (5) 基金管理人《基金管理资格证书》及《企业法人营业执照》;
- (6) 报告期内涉及本基金公告的各项原稿。

12.2 存放地点

本基金管理人处——上海市浦东新区耀体路 276 号晶耀商务广场 3 号楼 9 层

12.3 查阅方式

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

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

西部利得基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日