

西部利得中证 1000 指数增强型证券投资基金  
2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：西部利得基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2025 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责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 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。

本报告期自 2024 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.....	7
3.3 其他指标.....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>14</b>
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	15
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>16</b>
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	18
7.3 净资产变动表.....	19
7.4 报表附注.....	21
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>53</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	53

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	53
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.....	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	73
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	75
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.....	75
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.....	75
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.....	75
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.....	75
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	75
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	75
8.12 投资组合报告附注.....	75
<b>§ 9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>76</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	76
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	77
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.....	77
<b>§ 10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>77</b>
<b>§ 11 重大事件揭示.....</b>	<b>77</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	77
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.....	78
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	78
11.4 基金投资策略的改变.....	78
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	78
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.....	78
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	78
11.8 其他重大事件.....	80
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>81</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.....	81
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	81
<b>§ 13 备查文件目录.....</b>	<b>81</b>
13.1 备查文件目录.....	81
13.2 存放地点.....	81
13.3 查阅方式.....	81

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	西部利得中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	西部利得中证 1000 指数增强	
基金主代码	018157	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 4 月 25 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	844,639,479.40 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	西部利得中证 1000 指数增强 A	西部利得中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	018157	018158
报告期末下属分级基金的份额总额	346,887,268.90 份	497,752,210.50 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型股票基金，在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。本基金力争日均跟踪误差的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8%。
投资策略	本基金以中证 1000 指数为标的指数，在控制投资组合与业绩比较基准跟踪误差的基础上，结合“自下而上”的选股方式对投资组合进行积极的管理与风险控制，力争获得超越业绩比较基准的收益。 本基金可以将标的指数成份股及备选股之外的股票纳入基金股票池，并构建主动型投资组合。（详见《基金合同》）
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率*95%+活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为股票基金，理论上其预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金和货币市场基金。

### 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
	联系电话	021-38572888
	电子邮箱	service@westleadfund.com
客户服务电话	4007-007-818	95511-3

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

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《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	2024 年		2023 年 4 月 25 日（基金合同生效 日）-2023 年 12 月 31 日	
	西部利得中证 1000 指数增强 A	西部利得中证 1000 指数增强 C	西部利得中证 1000 指数增强 A	西部利得中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	-19,342,710.08	-42,293,082.66	9,042,069.70	7,766,623.61
本期利润	-7,203,443.62	-35,693,413.89	-8,563,695.01	-15,465,070.63
加权平均基金份 额本期利润	-0.0142	-0.0501	-0.0155	-0.0188
本期加权平均净 值利润率	-1.62%	-5.78%	-1.57%	-1.91%
本期基金份额净 值增长率	1.70%	1.30%	-1.95%	-2.22%
3.1.2 期末数据 和指标	2024 年末		2023 年末	
期末可供分配利 润	-4,356,687.32	-9,544,299.85	-18,414,543.18	-31,201,322.16
期末可供分配基 金份额利润	-0.0126	-0.0192	-0.0291	-0.0318

期末基金资产净值	342,530,581.58	488,207,910.65	614,244,055.89	951,288,279.03
期末基金份额净值	0.9874	0.9808	0.9709	0.9682
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末	
基金份额累计净值增长率	-0.28%	-0.95%	-1.95%	-2.22%

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

西部利得中证 1000 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	4.76%	2.19%	4.23%	2.28%	0.53%	-0.09%
过去六个月	21.32%	2.03%	20.68%	2.13%	0.64%	-0.10%
过去一年	1.70%	1.97%	1.41%	2.01%	0.29%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-0.28%	1.61%	-10.59%	1.65%	10.31%	-0.04%

西部利得中证 1000 指数增强 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	4.66%	2.19%	4.23%	2.28%	0.43%	-0.09%
过去六个月	21.07%	2.03%	20.68%	2.13%	0.39%	-0.10%

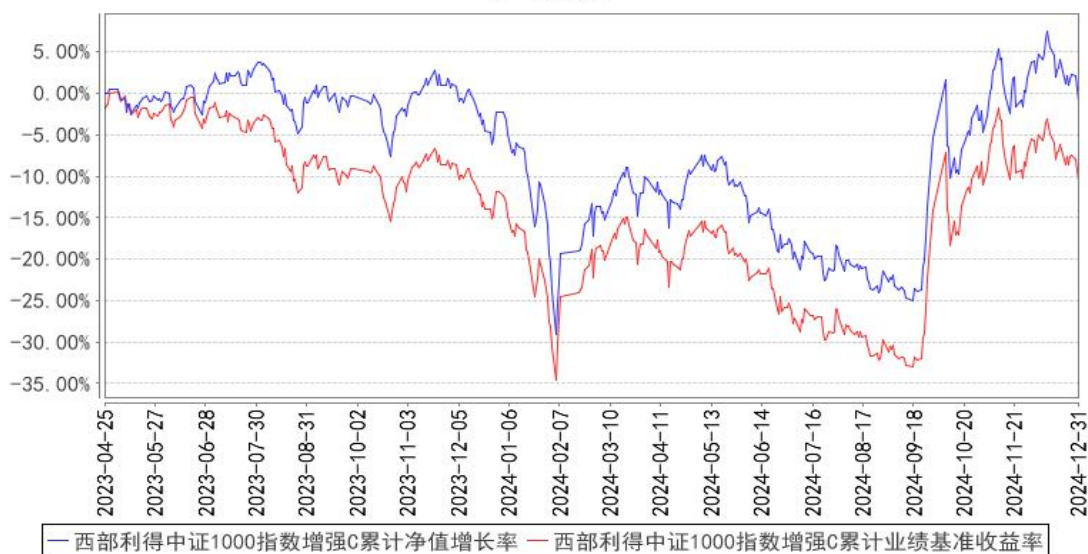
过去一年	1.30%	1.97%	1.41%	2.01%	-0.11%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-0.95%	1.61%	-10.59%	1.65%	9.64%	-0.04%

### 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

西部利得中证1000指数增强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



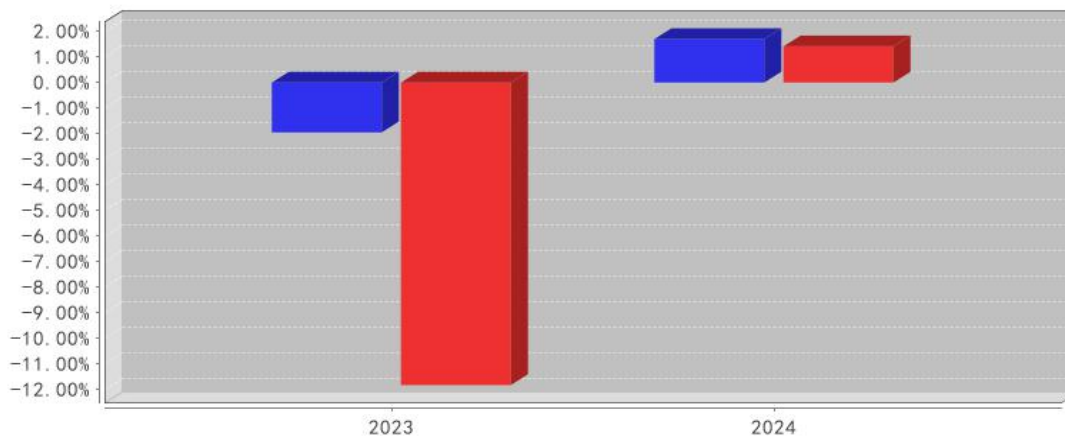
西部利得中证1000指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





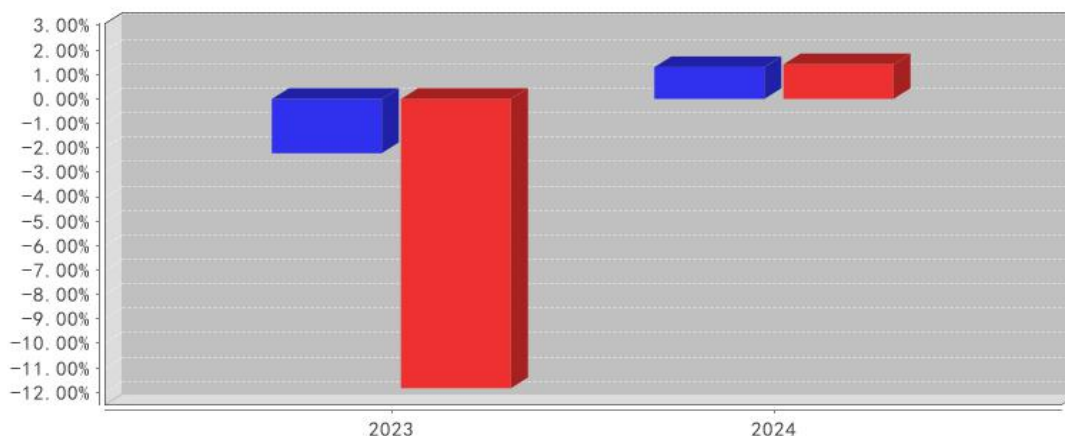
### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

西部利得中证1000指数增强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



- 西部利得中证1000指数增强A净值增长率
- 西部利得中证1000指数增强A业绩基准收益率

西部利得中证1000指数增强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



- 西部利得中证1000指数增强C净值增长率
- 西部利得中证1000指数增强C业绩基准收益率

注：本基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

无

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

西部利得中证 1000 指数增强 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	0.1000	5,422,419.9	481,125.95	5,903,545.8	-

		4		9	
合计	0.1000	5,422,419.94	481,125.95	5,903,545.89	-

## 西部利得中证 1000 指数增强 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	0.1000	6,862,161.35	99,052.50	6,961,213.85	-
合计	0.1000	6,862,161.35	99,052.50	6,961,213.85	-

## § 4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

## 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

## 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
盛丰衍	总经理助理、投资总监、主动量化投资部总经理、基金经理	2023 年 4 月 25 日	-	12 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	2023 年 10 月 21 日	-	7 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 公平交易制度和控制方法

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

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。公司旗下管理的各投资组合参与的交易所公开竞价交易中，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现 2 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。

## 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 1000 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，努力通过选股获得相对于中证 1000 指数的稳健超额收益，以期打造优质的中证 1000 指数增强基金。

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

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内基金业绩表现参见本报告第三部分“主要财务指标和基金净值表现”。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2025 年上半年，影响 A 股的主要有三股力量。

其一是中国时代的来临

近年来中国在新能源、国防、核能、电信设备、无人机、机器人等领域主导技术进步，在高附加值领域的优势和在供应链中的主导地位迅速提升，在 AI、动画电影、3A 游戏等领域缩短和世界顶级技术的差距。全球投资者将逐步认识到中国时代的到来，其认知的提升或将带来跨境资本的流入。

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、民营企业部门、地方政府部门的杠杆率也阶段性见顶，形成通缩压力。短期稳经济可能主要依赖于中央和央企部门加杠杆，对冲通缩，稳定物价。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。中央加杠杆或以对冲内外部负面压力的形式展开，危中有机。

其三是高质量发展的推进

中国经济高质量发展是未来很长一段时间的主旋律。被定义为高质量的行业发展提速，被定义为非高质量的行业发展相对减速。具体而言，国央企因其更符合高质量发展趋势而受益，而民企中硬科技占比高的企业受益；官方定位从低质量向高质量转变的行业因其边际变化可能有较高的股价弹性。央企股票不止是高股息资产，不少央企中小票也有较高投资价值，这部分市场未充

分定价。科技股中市场认知和现实差较大的科技公司或有亮眼表现。

整体来看，当下看好未来权益市场表现，结构上看好央企潜力资产，其符合当下投资者的偏好，其央企中小票定价并不充分。2024 年，小市值风格表现相对疲弱，但针对小市值公司和量化投资的政策已经出现调整，同时主题投资活跃。这些因素相互叠加，为央企中小票后续走势奠定了基础。

#### 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应用性的情况，以及在采用新投资策略或投资新品种时，估值委员会负责对所采用的估值模型、假设及参数的适当性进行重新评估或修订，必要时聘请会计师事务所进行审核并出具意见。针对个别投资品种的估值方法调整，均须通过托管银行复核。

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

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

可参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2501842 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	西部利得中证 1000 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的西部利得中证 1000 指数增强型证券投资基金(以下简称“该基金”)财务报表,包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表、2024 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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 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 2024 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>
管理层和治理层对财务报表的责任	<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),</p>

	<p>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>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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>
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	张楠   朱伊俐
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	2025 年 3 月 27 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：西部利得中证 1000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元



资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	47,624,479.35	161,604,535.31
结算备付金		1,883,485.51	19,203,922.36
存出保证金		67,924,730.06	4,260,615.45
交易性金融资产	7.4.7.2	716,817,754.36	1,432,207,796.97
其中：股票投资		716,817,754.36	1,432,207,796.97
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,090,979.07	37,777,864.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		835,341,428.35	1,655,054,734.09
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2023 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		-	26,101,956.75
应付赎回款		3,219,953.10	60,293,839.27
应付管理人报酬		870,291.69	1,586,334.86
应付托管费		145,048.60	264,389.16
应付销售服务费		162,690.97	331,412.23
应付投资顾问费		-	-
应交税费		36,951.76	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	7.4.7.9	168,000.00	944,466.90
负债合计		4,602,936.12	89,522,399.17
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	844,639,479.40	1,615,148,200.26
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-13,900,987.17	-49,615,865.34
净资产合计		830,738,492.23	1,565,532,334.92
负债和净资产总计		835,341,428.35	1,655,054,734.09

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 844,639,479.40 份，其中西部利得中证 1000 指数增强 A 份额总额 346,887,268.90 份，基金份额净值 0.9874 元；西部利得中证 1000 指数增强 C 份额总额 497,752,210.50 份，基金份额净值 0.9808 元。

## 7.2 利润表

会计主体：西部利得中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 4 月 25 日（基金 合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-25,331,951.31	-8,666,248.88
1. 利息收入		393,665.71	478,024.96
其中：存款利息收入	7.4.7.13	393,665.71	478,024.96
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）		-44,883,811.59	31,584,895.25
其中：股票投资收益		-60,122,009.79	26,175,094.38
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	1,641,028.01	-3,850,352.19
股利收益	7.4.7.19	13,597,170.19	9,260,153.06
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)	7.4.7.20	18,738,935.23	-40,837,458.95
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	419,259.34	108,289.86
<b>减：二、营业总支出</b>		17,564,906.20	15,362,516.76
1. 管理人报酬		12,782,462.54	11,140,370.13
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费		2,130,410.46	1,856,728.41
3. 销售服务费		2,479,031.98	2,217,018.22
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		5,001.22	-
8. 其他费用	7.4.7.23	168,000.00	148,400.00
<b>三、利润总额(亏损总 额以“-”号填列)</b>		-42,896,857.51	-24,028,765.64
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以 “-”号填列)</b>		-42,896,857.51	-24,028,765.64
<b>五、其他综合收益的税 后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-42,896,857.51	-24,028,765.64

### 7.3 净资产变动表

会计主体：西部利得中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	1,615,148,200. 26	-	-49,615,865.34	1,565,532,334.9 2
加：会计政策变 更	-	-	-	-
前期差错更 正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	1,615,148,200.26	-	-49,615,865.34	1,565,532,334.92
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-770,508,720.86	-	35,714,878.17	-734,793,842.69
(一)、综合收益总额	-	-	-42,896,857.51	-42,896,857.51
(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)	-770,508,720.86	-	78,611,735.68	-691,896,985.18
其中：1. 基金申购款	742,164,335.72	-	-64,964,176.52	677,200,159.20
2. 基金赎回款	-1,512,673,056.58	-	143,575,912.20	-1,369,097,144.38
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	844,639,479.40	-	-13,900,987.17	830,738,492.23
项目	上年度可比期间			
	2023 年 4 月 25 日(基金合同生效日)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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,286,476,293.64	-	-	1,286,476,293.64
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	328,671,906.62	-	-49,615,865.34	279,056,041.28

号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-24,028,765.64	-24,028,765.64
(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)	328,671,906.62	-	-12,722,339.96	315,949,566.66
其中: 1. 基金申购款	1,409,678,338.89	-	-22,629,734.40	1,387,048,604.49
2. 基金赎回款	-1,081,006,432.27	-	9,907,394.44	-1,071,099,037.83
(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)	-	-	-12,864,759.74	-12,864,759.74
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,615,148,200.26	-	-49,615,865.34	1,565,532,334.92

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

贺燕萍

张皞骏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

西部利得中证 1000 指数增强型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[2023]507 号《关于准予西部利得中证 1000 指数增强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《西部利得中证 1000 指数增强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,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,286,444,505.83 元,业经毕马威华振会

会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第 2300251 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《西部利得中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2023 年 4 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,286,476,293.64 份基金份额,其中认购资金利息折合 31,787.81 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《西部利得中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为标的指数成份股及其备选成份股、其他国内依法发行上市的股票(包含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、债券(包括国债、地方政府债券、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)及其他经中国证监会允许投资的债券或票据)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金还可根据法律法规参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金股票资产占基金资产的比例不低于 80%;投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权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。

本基金的标的指数是中证 1000 指数。本基金的业绩比较基准为:中证 1000 指数收益率\*95%+活期存款利率(税后)\*5%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 7.4.4 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。

#### 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 2024 年 12 月 31 日的财务状况、2024 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。

### 7.4.4.4 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《西部利得中证 1000 指数增强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；同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机构另有规定的，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，基金管理人在履行适当程序后可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

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

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、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》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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	47,624,479.35	161,604,535.31
等于：本金	47,619,544.93	161,588,598.01
加：应计利息	4,934.42	15,937.30
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	47,624,479.35	161,604,535.31

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 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	736,380,838.08	-	716,817,754.36	-19,563,083.72
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	736,380,838.08	-	716,817,754.36	-19,563,083.72
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,473,067,215.92	-	1,432,207,796.97	-40,859,418.95
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	1,473,067,215.92	-	1,432,207,796.97	-40,859,418.95
----	------------------	---	------------------	----------------

### 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 2024 年 12 月 31 日				备注
	合同/名义 金额	公允价值			
		资产	负债		
利率衍生工具	-	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	-	
权益衍生工具	58,519,960.00	-	-	-	
其中：股指期货投资	58,519,960.00	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	-	
合计	58,519,960.00	-	-	-	
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日				备注
	合同/名义 金额	公允价值			
		资产	负债		
利率衍生工具	-	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	-	
权益衍生工具	29,302,040.00	-	-	-	
其中：股指期货投资	29,302,040.00	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	-	
合计	29,302,040.00	-	-	-	

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
IM2501	IM2501	47.00	55,984,520.00	-2,535,440.00
合计				-2,535,440.00
减：可抵销期货 暂收款				-2,535,440.00
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。

#### 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未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末及上年度期末均未持有债权投资。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末未发生债权投资减值准备。

#### 7.4.7.6 其他债权投资

##### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末及上年度期末均未持有其他债权投资。

##### 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末未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

本基金本报告期末及上年度期末均未持有其他权益工具投资。

## 7.4.7.8 其他资产

本基金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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 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	-	796,466.90
其中：交易所市场	-	796,466.90
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	168,000.00	148,000.00
合计	168,000.00	944,466.90

## 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 西部利得中证 1000 指数增强 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	632,658,599.07	632,658,599.07
本期申购	233,953,465.22	233,953,465.22
本期赎回（以“-”号填列）	-519,724,795.39	-519,724,795.39
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	346,887,268.90	346,887,268.90

## 西部利得中证 1000 指数增强 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	982,489,601.19	982,489,601.19
本期申购	508,210,870.50	508,210,870.50
本期赎回（以“-”号填列）	-992,948,261.19	-992,948,261.19
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	497,752,210.50	497,752,210.50

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

##### 西部利得中证 1000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,731,032.49	-22,145,575.67	-18,414,543.18
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	3,731,032.49	-22,145,575.67	-18,414,543.18
本期利润	-19,342,710.08	12,139,266.46	-7,203,443.62
本期基金份额交易产生的变动数	31,153,405.58	-9,892,106.10	21,261,299.48
其中：基金申购款	-15,961,761.72	-978,670.79	-16,940,432.51
基金赎回款	47,115,167.30	-8,913,435.31	38,201,731.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,541,727.99	-19,898,415.31	-4,356,687.32

##### 西部利得中证 1000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,139,583.95	-34,340,906.11	-31,201,322.16
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	3,139,583.95	-34,340,906.11	-31,201,322.16
本期利润	-42,293,082.66	6,599,668.77	-35,693,413.89
本期基金份额交易产生的变动数	58,009,455.72	-659,019.52	57,350,436.20
其中：基金申购款	-35,285,930.97	-12,737,813.04	-48,023,744.01
基金赎回款	93,295,386.69	12,078,793.52	105,374,180.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,855,957.01	-28,400,256.86	-9,544,299.85

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 4 月 25 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日

活期存款利息收入	254,003.82	389,727.85
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	64,328.35	70,432.89
其他	75,333.54	17,864.22
合计	393,665.71	478,024.96

注：其他包括结算保证金利息收入以及销售款利息收入。

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年4月25日（基金合同 生效日）至2023年12月31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	-60,122,009.79	26,175,094.38
股票投资收益——赎回 差价收入	-	-
股票投资收益——申购 差价收入	-	-
股票投资收益——证券 出借差价收入	-	-
合计	-60,122,009.79	26,175,094.38

##### 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 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年4月25日（基金合 同生效日）至2023年12月31日
卖出股票成交总 额	8,071,728,446.19	5,317,468,348.30
减：卖出股票成本 总额	8,124,259,477.27	5,282,308,822.27
减：交易费用	7,590,978.71	8,984,431.65
买卖股票差价收 入	-60,122,009.79	26,175,094.38

##### 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买卖债券差价收入。

##### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券赎回差价收入。

##### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券申购差价收入。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖资产支持证券差价收入。

##### 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赎回差价收入。

##### 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申购差价收入。

#### 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无贵金属投资收益。

##### 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无贵金属投资收益。

##### 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无贵金属投资收益。

##### 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无贵金属投资收益。

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	1,641,028.01	-3,850,352.19

## 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	13,597,170.19	9,260,153.06
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	13,597,170.19	9,260,153.06

## 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	21,296,335.23	-40,859,418.95
股票投资	21,296,335.23	-40,859,418.95
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	-2,557,400.00	21,960.00
权证投资	-	-
期货投资	-2,557,400.00	21,960.00
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	18,738,935.23	-40,837,458.95

## 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
----	--	---

	月 31 日	合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	333,888.67	108,033.95
基金转换费收入	85,370.67	255.91
合计	419,259.34	108,289.86

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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 4 月 25 日(基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	48,000.00	48,000.00
信息披露费	120,000.00	100,000.00
证券出借违约金	-	-
其他	-	400.00
合计	168,000.00	148,400.00

#### 7.4.7.24 分部报告

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

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

#### 7.4.9 关联方关系

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年 12月31日		上年度可比期间 2023年4月25日（基金合同生效日）至2023 年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额 的比例 （%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
西部证券股份有限公司	224,684,307.73	1.45	2,434,289,604.39	20.18

#### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
西部证券股份有限公司	100,188.97	3.91	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年4月25日（基金合同生效日）至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
西部证券股份有限公司	1,061,671.78	24.56	214,079.05	26.88

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。

2024年7月1日前，该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。自2024年7月1日起，券商不再为本基金提供除交易单元租用以外服务。



## 7.4.10.2 关联方报酬

## 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	12,782,462.54	11,140,370.13
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,955,839.19	3,980,173.12
应支付基金管理人的净管理费	7,826,623.35	7,160,197.01

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

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

## 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,130,410.46	1,856,728.41

注：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：

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

## 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	西部利得中证 1000 指数增强 A	西部利得中证 1000 指数增强 C	合计
平安银行股份有限公司	-	1,791,153.44	1,791,153.44
西部利得基金管理有限公司	-	65,089.70	65,089.70
西部证券股份有限公司	-	9,213.16	9,213.16
合计	-	1,865,456.30	1,865,456.30
获得销售服务费的各关	上年度可比期间		

关联方名称	2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	西部利得中证 1000 指数增强 A	西部利得中证 1000 指数增强 C	合计
平安银行股份有限公司	-	1,325,477.25	1,325,477.25
西部利得基金管理有限 公司	-	240,418.86	240,418.86
西部证券股份有限公司	-	14,067.65	14,067.65
合计	-	1,579,963.76	1,579,963.76

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 0.40% 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，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：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.40% / 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。

##### 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金管理人于本报告期及上年度可比区间未运用固有资金投资本基金。

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

本报告期末及上年度可比区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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行股份有限公司	47,624,479.35	254,003.82	161,604,535.31	389,727.85

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. 本基金通过“平安银行股份有限公司基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2024 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 0.00 元。（2023 年 12 月 31 日：人民币 5,279,967.41 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

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2024 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
001279	强邦新材	2024 年 9 月 27 日	6 个月	锁定期	9.68	27.91	265	2,565.20	7,396.15	-
001391	国货航	2024 年 12 月 23 日	6 个月	锁定期	2.30	6.80	4,686	10,777.80	31,864.80	-
301522	上大股份	2024 年 10 月 9 日	6 个月	锁定期	6.88	24.84	816	5,614.08	20,269.44	-
301556	托普云农	2024 年 10 月 10 日	6 个月	锁定期	14.50	59.05	267	3,871.50	15,766.35	-
301571	国	2024	6 个月	锁定	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-

	科天成	年 8 月 14 日		期						
301585	蓝宇股份	2024 年 12 月 10 日	6 个月	锁定期	23.95	35.85	210	5,029.50	7,528.50	-
301586	佳力奇	2024 年 8 月 21 日	6 个月	锁定期	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	-
301603	乔锋智能	2024 年 7 月 3 日	6 个月	锁定期	26.50	41.98	233	6,174.50	9,781.34	-
301606	绿联科技	2024 年 7 月 17 日	6 个月	锁定期	21.21	36.49	396	8,399.16	14,450.04	-
301607	富特科技	2024 年 8 月 28 日	6 个月	锁定期	14.00	36.14	257	3,598.00	9,287.98	-
301608	博实结	2024 年 7 月 25 日	6 个月	锁定期	44.50	65.38	184	8,188.00	12,029.92	-
301611	珂玛科技	2024 年 8 月 7 日	6 个月	锁定期	8.00	56.10	804	6,432.00	45,104.40	-
301617	博苑股份	2024 年 12 月 3 日	6 个月	锁定期	27.76	39.79	253	7,023.28	10,066.87	-
301622	英思特	2024 年 11 月 26 日	6 个月	锁定期	22.36	44.92	306	6,842.16	13,745.52	-
301631	壹连科技	2024 年 11 月 12 日	6 个月	锁定期	72.99	101.96	153	11,167.47	15,599.88	-
603072	天	2024	1 个月	新股	12.30	12.30	2,029	24,956.70	24,956.70	-

	和磁材	年 12 月 24 日	内	未上市						
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月	锁定期	12.30	12.30	226	2,779.80	2,779.80	-
603205	健尔康	2024 年 10 月 29 日	6 个月	锁定期	14.65	27.35	128	1,875.20	3,500.80	-
603207	小方制药	2024 年 8 月 19 日	6 个月	锁定期	12.47	26.65	185	2,306.95	4,930.25	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	6 个月	锁定期	18.65	22.61	129	2,405.85	2,916.69	-
603310	巍华新材	2024 年 8 月 7 日	6 个月	锁定期	17.39	17.95	254	4,417.06	4,559.30	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	6 个月	锁定期	20.56	36.17	106	2,179.36	3,834.02	-
603395	红四方	2024 年 11 月 19 日	6 个月	锁定期	7.98	35.77	154	1,228.92	5,508.58	-
688449	联芸科技	2024 年 11 月 20 日	6 个月	锁定期	11.25	29.44	1,406	15,817.50	41,392.64	-
688605	先锋精科	2024 年 12 月 4 日	6 个月	锁定期	11.29	53.68	744	8,399.76	39,937.92	-
688708	佳驰科技	2024 年 11 月 27 日	6 个月	锁定期	27.08	48.95	780	21,122.40	38,181.00	-
688710	益	2024	6 个月	锁定	19.06	33.58	332	6,327.92	11,148.56	-

	诺思	年 8 月 27 日		期						
688721	龙图光罩	2024 年 7 月 30 日	6 个月	锁定期	18.50	56.85	279	5,161.50	15,861.15	-
688750	金天钛业	2024 年 11 月 12 日	6 个月	锁定期	7.16	15.44	1,685	12,064.60	26,016.40	-

#### 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银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

#### 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。

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

下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约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 2024 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	47,624,479.35	-	-	-	47,624,479.35
结算备付金	1,883,485.51	-	-	-	1,883,485.51
存出保证金	67,924,730.06	-	-	-	67,924,730.06
交易性金融资产	-	-	-	-716,817,754.36	716,817,754.36
应收申购款	-	-	-	1,090,979.07	1,090,979.07
资产总计	117,432,694.92	-	-	-717,908,733.43	835,341,428.35
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,219,953.10	3,219,953.10
应付管理人报酬	-	-	-	870,291.69	870,291.69
应付托管费	-	-	-	145,048.60	145,048.60
应付销售服务费	-	-	-	162,690.97	162,690.97
应交税费	-	-	-	36,951.76	36,951.76



其他负债	-	-	-	168,000.00	168,000.00
负债总计	-	-	-	4,602,936.12	4,602,936.12
利率敏感度缺口	117,432,694.92	-	-	-713,305,797.31	830,738,492.23
上年度末 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	161,604,535.31	-	-	-	161,604,535.31
结算备付金	19,203,922.36	-	-	-	19,203,922.36
存出保证金	4,260,615.45	-	-	-	4,260,615.45
交易性金融资产	-	-	-	1,432,207,796.97	1,432,207,796.97
应收申购款	-	-	-	37,777,864.00	37,777,864.00
资产总计	185,069,073.12	-	-	1,469,985,660.97	1,655,054,734.09
负债					
应付赎回款	-	-	-	60,293,839.27	60,293,839.27
应付管理人报酬	-	-	-	1,586,334.86	1,586,334.86
应付托管费	-	-	-	264,389.16	264,389.16
应付清算款	-	-	-	26,101,956.75	26,101,956.75
应付销售服务费	-	-	-	331,412.23	331,412.23
其他负债	-	-	-	944,466.90	944,466.90
负债总计	-	-	-	89,522,399.17	89,522,399.17
利率敏感度缺口	185,069,073.12	-	-	1,380,463,261.80	1,565,532,334.92

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 2024 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（2023 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 2024 年 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 2024年12月31日		上年度末 2023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	716,817,754.36	86.29	1,432,207,796.97	91.48
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	716,817,754.36	86.29	1,432,207,796.97	91.48

## 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（2024年12月31日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升5%的影响金额	39,851,000.00	72,503,000.00
	业绩比较基准下降5%的影响金额	-39,851,000.00	-72,503,000.00

注：自 2024 年起，基金管理人对于基金产品成立后封闭期内的其他价格风险敏感性分析基础数据提升了数据精度。

## 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	716,353,623.76	1,431,017,723.58
第二层次	27,736.50	-
第三层次	436,394.10	1,190,073.39
合计	716,817,754.36	1,432,207,796.97

## 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	1,190,073.39	1,190,073.39
当期购买	-	395,884.24	395,884.24
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,457,419.92	1,457,419.92
当期利得或损失总额	-	307,856.39	307,856.39
其中：计入损益的利得或损失	-	307,856.39	307,856.39
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	436,394.10	436,394.10
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	-	253,565.20	253,565.20
项目	上年度可比期间 2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）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	-	-	-
当期购买	-	1,152,684.08	1,152,684.08
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	135,201.30	135,201.30
当期利得或损失总额	-	172,590.61	172,590.61
其中：计入损益的利得或损失	-	172,590.61	172,590.61
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,190,073.39	1,190,073.39
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	-	156,076.55	156,076.55

#### 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	436,394.10	亚式期权模型	预期波动率	34.23%-574.44%	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	1,190,073.39	亚式期权模型	预期波动率	18.55%-219.88%	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 2024 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（2023 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 2024 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	716,817,754.36	85.81
	其中：股票	716,817,754.36	85.81
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	49,507,964.86	5.93
8	其他各项资产	69,015,709.13	8.26
9	合计	835,341,428.35	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	4,582,289.00	0.55
B	采矿业	14,272,509.80	1.72
C	制造业	423,366,607.34	50.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,859,505.00	1.55
E	建筑业	1,631,742.00	0.20
F	批发和零售业	23,782,272.00	2.86
G	交通运输、仓储和邮政业	15,142,458.80	1.82
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	81,626,836.26	9.83
J	金融业	23,950,344.60	2.88
K	房地产业	9,260,843.00	1.11
L	租赁和商务服务业	7,784,825.00	0.94

M	科学研究和技术服务业	3,990,501.50	0.48
N	水利、环境和公共设施管理业	4,219,181.50	0.51
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	794,312.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	9,490,610.00	1.14
S	综合	-	-
	合计	636,754,837.80	76.65

### 8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	867,474.00	0.10
B	采矿业	1,943,607.00	0.23
C	制造业	65,472,338.21	7.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,263,285.00	0.27
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,277,976.00	0.27
G	交通运输、仓储和邮政业	323,831.80	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,813,113.99	0.34
J	金融业	-	-
K	房地产业	215,404.00	0.03
L	租赁和商务服务业	255,248.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	1,026,660.56	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	857,803.00	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	253,006.00	0.03
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,493,169.00	0.18
S	综合	-	-
	合计	80,062,916.56	9.64

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300134	大富科技	458,800	5,381,724.00	0.65
2	002651	利君股份	698,800	5,122,204.00	0.62
3	300232	洲明科技	705,300	4,845,411.00	0.58
4	002745	木林森	509,500	4,442,840.00	0.53
5	600420	国药现代	371,800	4,439,292.00	0.53
6	002174	游族网络	470,800	4,401,980.00	0.53
7	300123	亚光科技	748,400	4,340,720.00	0.52
8	002987	京北方	294,752	4,194,320.96	0.50
9	300593	新雷能	348,700	3,905,440.00	0.47
10	300079	数码视讯	684,300	3,702,063.00	0.45
11	000686	东北证券	465,140	3,693,211.60	0.44
12	002434	万里扬	583,000	3,614,600.00	0.44
13	300527	中船应急	439,900	3,549,993.00	0.43
14	603308	应流股份	248,900	3,509,490.00	0.42
15	300171	东富龙	261,100	3,467,408.00	0.42
16	600266	城建发展	675,000	3,442,500.00	0.41
17	300768	迪普科技	195,800	3,426,500.00	0.41
18	000062	深圳华强	152,700	3,420,480.00	0.41
19	002550	千红制药	551,500	3,419,300.00	0.41
20	301339	通行宝	167,900	3,415,086.00	0.41
21	601311	骆驼股份	400,600	3,320,974.00	0.40
22	300363	博腾股份	208,500	3,288,045.00	0.40
23	600335	国机汽车	525,300	3,272,619.00	0.39
24	300674	宇信科技	167,100	3,261,792.00	0.39
25	002378	章源钨业	501,400	3,244,058.00	0.39
26	600259	广晟有色	113,700	3,161,997.00	0.38
27	300180	华峰超纤	494,000	3,112,200.00	0.37
28	002036	联创电子	330,700	3,108,580.00	0.37
29	002249	大洋电机	525,200	3,082,924.00	0.37
30	300663	科蓝软件	173,700	3,015,432.00	0.36
31	002537	海联金汇	523,600	3,010,700.00	0.36
32	301526	国际复材	805,700	2,981,090.00	0.36
33	600216	浙江医药	185,600	2,943,616.00	0.35
34	002777	久远银海	168,500	2,901,570.00	0.35
35	300303	聚飞光电	424,500	2,895,090.00	0.35

36	600882	妙可蓝多	161,400	2,889,060.00	0.35
37	688110	东芯股份	115,100	2,865,990.00	0.34
38	002405	四维图新	296,000	2,853,440.00	0.34
39	688209	英集芯	159,300	2,814,831.00	0.34
40	301246	宏源药业	205,800	2,784,474.00	0.34
41	688598	金博股份	131,700	2,773,602.00	0.33
42	603328	依顿电子	276,400	2,725,304.00	0.33
43	300088	长信科技	415,200	2,715,408.00	0.33
44	001269	欧晶科技	95,000	2,706,550.00	0.33
45	301348	蓝箭电子	104,800	2,684,976.00	0.32
46	600864	哈投股份	364,300	2,677,605.00	0.32
47	603766	隆鑫通用	292,700	2,663,570.00	0.32
48	000528	柳 工	216,600	2,612,196.00	0.31
49	002446	盛路通信	396,300	2,595,765.00	0.31
50	601777	力帆科技	334,100	2,555,865.00	0.31
51	000917	电广传媒	359,100	2,538,837.00	0.31
52	300083	创世纪	388,300	2,527,833.00	0.30
53	000881	中广核技	343,800	2,520,054.00	0.30
54	300770	新媒股份	61,700	2,493,297.00	0.30
55	300393	中来股份	394,500	2,465,625.00	0.30
56	600508	上海能源	185,600	2,455,488.00	0.30
57	300166	东方国信	259,820	2,442,308.00	0.29
58	603583	捷昌驱动	98,200	2,426,522.00	0.29
59	600643	爱建集团	461,600	2,386,472.00	0.29
60	001236	弘业期货	246,800	2,379,152.00	0.29
61	300183	东软载波	122,600	2,372,310.00	0.29
62	002123	梦网科技	218,000	2,356,580.00	0.28
63	300602	飞荣达	122,100	2,346,762.00	0.28
64	600908	无锡银行	386,700	2,285,397.00	0.28
65	688298	东方生物	77,500	2,273,075.00	0.27
66	600366	宁波韵升	308,660	2,271,737.60	0.27
67	600621	华鑫股份	137,500	2,266,000.00	0.27
68	301511	德福科技	180,315	2,264,756.40	0.27
69	600320	振华重工	571,540	2,240,436.80	0.27
70	002626	金达威	147,700	2,230,270.00	0.27
71	000557	西部创业	428,400	2,223,396.00	0.27
72	601187	厦门银行	391,900	2,210,316.00	0.27
73	603123	翠微股份	274,100	2,206,505.00	0.27
74	000828	东莞控股	205,100	2,192,519.00	0.26
75	603989	艾华集团	144,173	2,174,128.84	0.26
76	688403	汇成股份	241,800	2,166,528.00	0.26
77	600645	中源协和	111,000	2,142,300.00	0.26
78	300261	雅本化学	312,700	2,141,995.00	0.26



79	601890	亚星锚链	272,786	2,125,002.94	0.26
80	300772	运达股份	158,600	2,099,864.00	0.25
81	002675	东诚药业	166,600	2,035,852.00	0.25
82	002649	博彦科技	167,000	2,024,040.00	0.24
83	600662	外服控股	398,600	2,020,902.00	0.24
84	600478	科力远	484,500	2,000,985.00	0.24
85	000156	华数传媒	276,100	1,987,920.00	0.24
86	605333	沪光股份	60,900	1,987,167.00	0.24
87	688586	江航装备	206,900	1,980,033.00	0.24
88	601126	四方股份	116,500	1,975,840.00	0.24
89	300257	开山股份	216,600	1,975,392.00	0.24
90	601969	海南矿业	277,100	1,964,639.00	0.24
91	002151	北斗星通	73,900	1,961,306.00	0.24
92	002349	精华制药	256,300	1,960,695.00	0.24
93	002243	力合科创	242,500	1,954,550.00	0.24
94	300525	博思软件	125,400	1,953,732.00	0.24
95	002020	京新药业	152,200	1,948,160.00	0.23
96	300031	宝通科技	106,000	1,941,920.00	0.23
97	600267	海正药业	231,600	1,922,280.00	0.23
98	603985	恒润股份	164,100	1,916,688.00	0.23
99	600330	天通股份	269,800	1,915,580.00	0.23
100	002214	大立科技	171,600	1,913,340.00	0.23
101	601801	皖新传媒	260,200	1,909,868.00	0.23
102	688019	安集科技	13,600	1,895,296.00	0.23
103	300726	宏达电子	60,900	1,893,990.00	0.23
104	688322	奥比中光	40,706	1,892,829.00	0.23
105	600757	长江传媒	196,900	1,884,333.00	0.23
106	301217	铜冠铜箔	169,200	1,874,736.00	0.23
107	300026	红日药业	491,100	1,861,269.00	0.22
108	603997	继峰股份	162,200	1,857,190.00	0.22
109	000059	华锦股份	386,100	1,849,419.00	0.22
110	000019	深粮控股	281,300	1,848,141.00	0.22
111	600057	厦门象屿	284,000	1,843,160.00	0.22
112	600305	恒顺醋业	227,700	1,817,046.00	0.22
113	603118	共进股份	202,600	1,803,140.00	0.22
114	603083	剑桥科技	44,400	1,802,640.00	0.22
115	002458	益生股份	185,500	1,782,655.00	0.21
116	300170	汉得信息	143,200	1,775,680.00	0.21
117	002484	江海股份	99,900	1,756,242.00	0.21
118	600550	保变电气	223,700	1,756,045.00	0.21
119	601369	陕鼓动力	201,400	1,752,180.00	0.21
120	600055	万东医疗	115,800	1,748,580.00	0.21
121	000901	航天科技	157,800	1,731,066.00	0.21

122	300737	科顺股份	341,400	1,730,898.00	0.21
123	000035	中国天楹	354,900	1,728,363.00	0.21
124	000848	承德露露	192,200	1,724,034.00	0.21
125	301238	瑞泰新材	109,600	1,716,336.00	0.21
126	603876	鼎胜新材	193,300	1,710,705.00	0.21
127	002396	星网锐捷	89,600	1,701,504.00	0.20
128	688690	纳微科技	96,500	1,698,400.00	0.20
129	002023	海特高新	167,200	1,697,080.00	0.20
130	603533	掌阅科技	83,500	1,695,885.00	0.20
131	600710	苏美达	181,400	1,687,020.00	0.20
132	300725	药石科技	50,200	1,686,720.00	0.20
133	688388	嘉元科技	114,500	1,686,585.00	0.20
134	688001	华兴源创	61,100	1,655,810.00	0.20
135	301180	万祥科技	106,400	1,646,008.00	0.20
136	600461	洪城环境	164,700	1,638,765.00	0.20
137	601606	长城军工	137,000	1,611,120.00	0.19
138	300188	国投智能	116,700	1,609,293.00	0.19
139	600273	嘉化能源	201,200	1,603,564.00	0.19
140	000029	深深房 A	106,400	1,602,384.00	0.19
141	601107	四川成渝	305,200	1,596,196.00	0.19
142	000048	京基智农	88,600	1,594,800.00	0.19
143	002488	金固股份	152,200	1,588,968.00	0.19
144	605011	杭州热电	73,900	1,582,938.00	0.19
145	300045	华力创通	75,100	1,568,839.00	0.19
146	002946	新乳业	107,100	1,554,021.00	0.19
147	688206	概伦电子	82,118	1,552,851.38	0.19
148	002701	奥瑞金	273,300	1,549,611.00	0.19
149	000672	上峰水泥	200,900	1,536,885.00	0.19
150	300080	易成新能	348,300	1,522,071.00	0.18
151	002891	中宠股份	42,600	1,520,820.00	0.18
152	600657	信达地产	365,000	1,518,400.00	0.18
153	601677	明泰铝业	126,040	1,516,261.20	0.18
154	300130	新国都	68,800	1,490,208.00	0.18
155	300687	赛意信息	81,800	1,488,760.00	0.18
156	688266	泽璟制药	23,731	1,478,678.61	0.18
157	300455	航天智装	113,900	1,476,144.00	0.18
158	002320	海峡股份	224,700	1,471,785.00	0.18
159	000030	富奥股份	286,400	1,469,232.00	0.18
160	603033	三维股份	115,500	1,465,695.00	0.18
161	002099	海翔药业	283,700	1,463,892.00	0.18
162	600635	大众公用	328,200	1,460,490.00	0.18
163	002079	苏州固锝	142,000	1,458,340.00	0.18
164	688432	有研硅	129,000	1,457,700.00	0.18

165	000415	渤海租赁	382,600	1,442,402.00	0.17
166	300672	国科微	21,600	1,441,800.00	0.17
167	301015	百洋医药	59,300	1,435,653.00	0.17
168	600728	佳都科技	306,000	1,432,080.00	0.17
169	002226	江南化工	263,900	1,430,338.00	0.17
170	600718	东软集团	132,200	1,423,794.00	0.17
171	688235	百济神州	8,800	1,416,976.00	0.17
172	600562	国睿科技	70,700	1,409,051.00	0.17
173	301606	绿联科技	37,096	1,401,710.04	0.17
174	300409	道氏技术	102,700	1,397,747.00	0.17
175	600997	开滦股份	206,300	1,394,588.00	0.17
176	002237	恒邦股份	137,600	1,389,760.00	0.17
177	000875	吉电股份	263,800	1,387,588.00	0.17
178	002461	珠江啤酒	139,800	1,382,622.00	0.17
179	002635	安洁科技	85,500	1,361,160.00	0.16
180	600648	外高桥	114,200	1,360,122.00	0.16
181	300115	长盈精密	83,689	1,359,109.36	0.16
182	301363	美好医疗	41,800	1,355,156.00	0.16
183	600073	光明肉业	195,200	1,354,688.00	0.16
184	002773	康弘药业	69,100	1,354,360.00	0.16
185	300398	飞凯材料	85,900	1,353,784.00	0.16
186	002212	天融信	208,500	1,344,825.00	0.16
187	000603	盛达资源	111,300	1,334,487.00	0.16
188	300451	创业慧康	297,100	1,331,008.00	0.16
189	002097	山河智能	176,100	1,320,750.00	0.16
190	002125	湘潭电化	130,600	1,316,448.00	0.16
191	002585	双星新材	246,400	1,315,776.00	0.16
192	000550	江铃汽车	55,900	1,310,855.00	0.16
193	600075	新疆天业	300,600	1,307,610.00	0.16
194	600446	金证股份	75,800	1,306,792.00	0.16
195	300415	伊之密	64,800	1,299,888.00	0.16
196	600217	中再资环	244,300	1,294,790.00	0.16
197	603719	良品铺子	91,100	1,294,531.00	0.16
198	688352	颀中科技	106,600	1,293,058.00	0.16
199	600623	华谊集团	184,100	1,288,700.00	0.16
200	000902	新洋丰	98,600	1,285,744.00	0.15
201	000719	中原传媒	113,000	1,283,680.00	0.15
202	002697	红旗连锁	216,000	1,276,560.00	0.15
203	603169	兰石重装	233,200	1,270,940.00	0.15
204	000058	深赛格	158,200	1,270,346.00	0.15
205	600428	中远海特	173,600	1,267,280.00	0.15
206	002747	埃斯顿	68,500	1,267,250.00	0.15
207	600577	精达股份	172,700	1,258,983.00	0.15

208	002270	华明装备	74,500	1,258,305.00	0.15
209	300379	东方通	83,300	1,256,997.00	0.15
210	002755	奥赛康	98,400	1,250,664.00	0.15
211	688321	微芯生物	67,000	1,244,860.00	0.15
212	000737	北方铜业	158,900	1,239,420.00	0.15
213	600633	浙数文化	118,000	1,234,280.00	0.15
214	301175	中科环保	228,300	1,232,820.00	0.15
215	688183	生益电子	31,200	1,224,912.00	0.15
216	301559	中集环科	79,700	1,223,395.00	0.15
217	002544	普天科技	56,800	1,217,224.00	0.15
218	688128	中国电研	57,700	1,212,277.00	0.15
219	300655	晶瑞电材	129,100	1,208,376.00	0.15
220	600812	华北制药	233,200	1,205,644.00	0.15
221	300035	中科电气	80,400	1,201,980.00	0.14
222	688062	迈威生物	58,800	1,187,760.00	0.14
223	000950	重药控股	219,200	1,179,296.00	0.14
224	600604	市北高新	247,200	1,176,672.00	0.14
225	301177	迪阿股份	51,500	1,176,260.00	0.14
226	300463	迈克生物	88,800	1,172,160.00	0.14
227	603983	丸美生物	36,200	1,167,812.00	0.14
228	002326	永太科技	128,800	1,151,472.00	0.14
229	603801	志邦家居	88,100	1,128,561.00	0.14
230	002706	良信股份	146,700	1,126,656.00	0.14
231	000766	通化金马	71,700	1,125,690.00	0.14
232	300705	九典制药	62,700	1,125,465.00	0.14
233	600269	赣粤高速	200,000	1,122,000.00	0.14
234	002389	航天彩虹	62,100	1,120,905.00	0.13
235	000758	中色股份	226,200	1,117,428.00	0.13
236	600301	华锡有色	65,500	1,114,155.00	0.13
237	603323	苏农银行	209,400	1,107,726.00	0.13
238	603005	晶方科技	39,100	1,104,575.00	0.13
239	601963	XD 重庆银	118,300	1,097,824.00	0.13
240	300618	寒锐钴业	32,500	1,097,525.00	0.13
241	688347	华虹公司	23,600	1,096,692.00	0.13
242	300598	诚迈科技	22,600	1,093,840.00	0.13
243	601375	中原证券	252,900	1,092,528.00	0.13
244	300773	拉卡拉	61,400	1,086,780.00	0.13
245	688779	五矿新能	204,000	1,085,280.00	0.13
246	002726	龙大美食	135,900	1,076,328.00	0.13
247	003009	中天火箭	27,500	1,072,500.00	0.13
248	603565	中谷物流	109,306	1,071,198.80	0.13
249	600783	鲁信创投	84,400	1,069,348.00	0.13
250	300579	数字认证	33,800	1,061,996.00	0.13

251	600552	凯盛科技	92,900	1,059,989.00	0.13
252	002004	华邦健康	234,200	1,058,584.00	0.13
253	300253	卫宁健康	147,200	1,053,952.00	0.13
254	002063	远光软件	182,000	1,048,320.00	0.13
255	300039	上海凯宝	168,300	1,040,094.00	0.13
256	600058	五矿发展	145,100	1,033,112.00	0.12
257	688048	长光华芯	26,400	1,029,336.00	0.12
258	603915	国茂股份	87,700	1,027,844.00	0.12
259	002928	华夏航空	132,400	1,027,424.00	0.12
260	002034	旺能环境	66,000	1,023,000.00	0.12
261	002139	拓邦股份	75,100	1,022,111.00	0.12
262	601678	XD 滨化股	271,700	1,021,592.00	0.12
263	600556	天下秀	196,300	1,020,760.00	0.12
264	601949	中国出版	142,000	1,019,560.00	0.12
265	300109	新开源	63,800	1,017,610.00	0.12
266	600963	岳阳林纸	199,200	1,011,936.00	0.12
267	002895	川恒股份	40,900	1,006,140.00	0.12
268	000555	神州信息	89,100	997,920.00	0.12
269	600125	铁龙物流	168,100	996,833.00	0.12
270	300723	一品红	57,600	982,656.00	0.12
271	002101	广东鸿图	81,800	979,964.00	0.12
272	603699	纽威股份	44,200	979,914.00	0.12
273	300034	钢研高纳	62,200	970,320.00	0.12
274	600480	凌云股份	89,100	963,171.00	0.12
275	688326	经纬恒润	11,331	952,937.10	0.11
276	002068	黑猫股份	89,400	951,216.00	0.11
277	600780	通宝能源	168,900	950,907.00	0.11
278	601096	宏盛华源	218,000	948,300.00	0.11
279	002990	盛视科技	40,600	940,702.00	0.11
280	600449	宁夏建材	62,200	934,244.00	0.11
281	605123	派克新材	17,100	919,296.00	0.11
282	300133	华策影视	126,900	916,218.00	0.11
283	300638	广和通	45,380	914,407.00	0.11
284	300682	朗新集团	74,600	910,120.00	0.11
285	000885	城发环境	69,350	909,178.50	0.11
286	000969	安泰科技	81,500	908,725.00	0.11
287	603995	甬金股份	49,603	907,238.87	0.11
288	603108	润达医疗	56,800	904,824.00	0.11
289	603100	川仪股份	41,680	898,204.00	0.11
290	600986	浙文互联	149,900	896,402.00	0.11
291	600158	中体产业	108,100	893,987.00	0.11
292	002539	云图控股	113,700	889,134.00	0.11
293	600850	电科数字	37,200	889,080.00	0.11

294	002332	仙琚制药	89,000	884,660.00	0.11
295	688083	中望软件	10,306	881,884.42	0.11
296	605507	国邦医药	42,000	874,860.00	0.11
297	002911	佛燃能源	69,150	874,056.00	0.11
298	603317	天味食品	65,300	871,102.00	0.10
299	001311	多利科技	33,480	863,449.20	0.10
300	002597	金禾实业	36,000	821,880.00	0.10
301	002906	华阳集团	26,600	817,950.00	0.10
302	300151	昌红科技	48,100	817,700.00	0.10
303	688315	诺禾致源	64,415	805,187.50	0.10
304	603055	台华新材	72,366	801,815.28	0.10
305	600874	创业环保	133,400	796,398.00	0.10
306	301207	华兰疫苗	45,300	793,203.00	0.10
307	300406	九强生物	58,900	786,904.00	0.09
308	002534	西子洁能	70,600	784,366.00	0.09
309	603171	税友股份	25,521	778,390.50	0.09
310	300570	太辰光	10,700	777,890.00	0.09
311	688380	中微半导	26,000	777,400.00	0.09
312	600750	江中药业	34,200	776,340.00	0.09
313	002913	奥士康	31,482	759,031.02	0.09
314	002233	塔牌集团	97,818	750,264.06	0.09
315	301078	孩子王	65,500	745,390.00	0.09
316	600246	万通发展	99,400	740,530.00	0.09
317	002859	洁美科技	35,500	736,625.00	0.09
318	300352	北信源	139,300	735,504.00	0.09
319	002171	楚江新材	88,600	726,520.00	0.09
320	002668	TCL 智家	55,300	725,536.00	0.09
321	600903	XD 贵州燃	91,900	716,820.00	0.09
322	300741	华宝股份	41,200	716,468.00	0.09
323	688289	圣湘生物	31,500	715,050.00	0.09
324	000597	东北制药	135,500	714,085.00	0.09
325	603678	火炬电子	23,400	713,700.00	0.09
326	002275	桂林三金	46,900	707,721.00	0.09
327	300596	利安隆	23,200	707,600.00	0.09
328	601900	南方传媒	46,500	702,615.00	0.08
329	603093	南华期货	58,400	694,960.00	0.08
330	688167	炬光科技	10,900	694,330.00	0.08
331	688050	爱博医疗	7,600	691,828.00	0.08
332	002698	博实股份	40,600	690,200.00	0.08
333	300129	泰胜风能	97,900	690,195.00	0.08
334	600100	同方股份	96,100	683,271.00	0.08
335	001308	康冠科技	24,700	679,250.00	0.08
336	002583	海能达	47,800	679,238.00	0.08

337	002833	弘亚数控	40,200	676,566.00	0.08
338	600210	紫江企业	102,300	676,203.00	0.08
339	000930	中粮科技	120,400	668,220.00	0.08
340	301487	盟固利	31,400	667,878.00	0.08
341	600388	龙净环保	52,600	665,390.00	0.08
342	688131	皓元医药	18,600	664,020.00	0.08
343	300327	中颖电子	26,900	658,243.00	0.08
344	301268	铭利达	39,700	658,226.00	0.08
345	000735	罗牛山	98,800	658,008.00	0.08
346	603026	石大胜华	18,700	654,500.00	0.08
347	600399	抚顺特钢	112,400	651,920.00	0.08
348	600961	株冶集团	82,600	650,062.00	0.08
349	600458	时代新材	50,400	645,624.00	0.08
350	300685	艾德生物	28,300	645,240.00	0.08
351	003040	楚天龙	49,300	644,351.00	0.08
352	000795	英洛华	66,200	644,126.00	0.08
353	300747	锐科激光	33,600	643,776.00	0.08
354	688107	安路科技	21,700	641,886.00	0.08
355	600894	广日股份	43,800	639,480.00	0.08
356	002545	东方铁塔	90,500	636,215.00	0.08
357	300973	立高食品	16,200	632,286.00	0.08
358	300315	掌趣科技	114,800	631,400.00	0.08
359	603337	杰克股份	20,500	624,430.00	0.08
360	605111	新洁能	18,400	623,944.00	0.08
361	600037	歌华有线	82,600	616,196.00	0.07
362	300294	博雅生物	20,300	614,684.00	0.07
363	300119	瑞普生物	32,600	598,862.00	0.07
364	002145	中核钛白	140,800	596,992.00	0.07
365	603103	横店影视	41,100	591,429.00	0.07
366	002003	伟星股份	41,700	590,889.00	0.07
367	301039	中集车辆	63,900	578,295.00	0.07
368	603219	富佳股份	40,700	576,719.00	0.07
369	000422	湖北宣化	45,600	575,472.00	0.07
370	603013	亚普股份	38,000	569,240.00	0.07
371	002077	大港股份	37,600	551,592.00	0.07
372	603919	金徽酒	28,000	548,800.00	0.07
373	300761	立华股份	28,100	546,826.00	0.07
374	002761	浙江建投	62,000	544,360.00	0.07
375	002267	陕天然气	64,000	540,800.00	0.07
376	300446	航天智造	32,700	539,877.00	0.06
377	301500	飞南资源	29,500	531,000.00	0.06
378	301087	可孚医疗	15,000	530,400.00	0.06
379	301071	力量钻石	14,600	529,250.00	0.06

380	603733	仙鹤股份	25,600	528,128.00	0.06
381	300702	天宇股份	31,400	523,124.00	0.06
382	002126	银轮股份	27,700	518,544.00	0.06
383	601952	苏垦农发	52,100	510,059.00	0.06
384	600531	豫光金铅	77,900	500,118.00	0.06
385	600548	深高速	36,900	497,412.00	0.06
386	300319	麦捷科技	39,800	496,704.00	0.06
387	001301	尚太科技	7,200	493,560.00	0.06
388	600017	日照港	153,100	489,920.00	0.06
389	600064	南京高科	62,400	484,848.00	0.06
390	301376	致欧科技	25,200	481,824.00	0.06
391	601022	宁波远洋	59,900	480,997.00	0.06
392	688707	振华新材	43,700	478,515.00	0.06
393	603162	海通发展	51,800	476,560.00	0.06
394	301297	富乐德	11,100	471,750.00	0.06
395	301262	海看股份	18,900	470,043.00	0.06
396	603197	保隆科技	12,400	468,100.00	0.06
397	600248	陕建股份	100,700	451,136.00	0.05
398	002219	新里程	163,300	431,112.00	0.05
399	688696	极米科技	4,300	421,486.00	0.05
400	688208	道通科技	10,700	419,012.00	0.05
401	688177	百奥泰	21,415	415,022.70	0.05
402	600861	北京人力	21,400	414,090.00	0.05
403	603220	中贝通信	18,000	413,460.00	0.05
404	600072	中船科技	29,400	413,070.00	0.05
405	603530	神马电力	16,700	412,657.00	0.05
406	688389	普门科技	27,400	407,986.00	0.05
407	002605	姚记科技	15,100	402,566.00	0.05
408	603609	禾丰股份	46,600	401,692.00	0.05
409	000951	中国重汽	23,300	395,634.00	0.05
410	002978	安宁股份	13,900	395,038.00	0.05
411	000970	中科三环	37,600	389,912.00	0.05
412	600285	羚锐制药	17,400	385,584.00	0.05
413	601222	林洋能源	54,500	385,315.00	0.05
414	001337	四川黄金	18,400	384,192.00	0.05
415	600601	方正科技	86,800	381,052.00	0.05
416	603866	桃李面包	55,320	365,112.00	0.04
417	300244	迪安诊断	32,000	363,200.00	0.04
418	688372	伟测科技	6,200	362,824.00	0.04
419	002516	旷达科技	71,500	362,505.00	0.04
420	000690	宝新能源	80,800	361,984.00	0.04
421	603132	金徽股份	32,200	361,606.00	0.04
422	002100	天康生物	55,000	360,250.00	0.04



423	601279	英利汽车	93,000	356,190.00	0.04
424	688185	康希诺	5,800	354,090.00	0.04
425	603636	南威软件	33,400	350,700.00	0.04
426	000712	锦龙股份	23,100	349,272.00	0.04
427	600597	光明乳业	40,800	348,432.00	0.04
428	601069	西部黄金	30,200	345,790.00	0.04
429	002011	盾安环境	31,600	341,596.00	0.04
430	300236	上海新阳	9,100	340,067.00	0.04
431	600967	内蒙一机	39,700	337,450.00	0.04
432	002010	传化智联	74,400	337,032.00	0.04
433	000899	赣能股份	38,600	336,206.00	0.04
434	601137	博威合金	16,500	334,950.00	0.04
435	000680	山推股份	34,300	332,710.00	0.04
436	603025	大豪科技	21,800	332,450.00	0.04
437	002215	诺普信	29,600	332,408.00	0.04
438	600557	康缘药业	24,200	329,604.00	0.04
439	301216	万凯新材	32,300	329,460.00	0.04
440	603398	沐邦高科	14,300	329,043.00	0.04
441	600866	星湖科技	50,800	328,676.00	0.04
442	603383	顶点软件	8,700	326,250.00	0.04
443	600835	上海机电	18,200	326,144.00	0.04
444	002497	雅化集团	27,800	325,260.00	0.04
445	600206	有研新材	20,700	324,369.00	0.04
446	002832	比音勒芬	15,100	323,291.00	0.04
447	600120	浙江东方	69,300	322,938.00	0.04
448	002176	江特电机	43,500	322,335.00	0.04
449	600338	西藏珠峰	30,100	321,167.00	0.04
450	688007	光峰科技	21,500	317,985.00	0.04
451	000567	海德股份	46,500	317,595.00	0.04
452	603730	岱美股份	35,200	316,448.00	0.04
453	300624	万兴科技	5,000	315,750.00	0.04
454	300738	奥飞数据	21,700	314,650.00	0.04
455	301090	华润材料	44,400	308,136.00	0.04
456	300068	南都电源	18,900	305,046.00	0.04
457	600507	方大特钢	74,600	302,130.00	0.04
458	603236	移远通信	4,400	301,136.00	0.04
459	300627	华测导航	7,200	300,960.00	0.04
460	300348	长亮科技	20,700	296,010.00	0.04
461	600185	格力地产	41,100	295,509.00	0.04
462	600933	爱柯迪	17,900	291,770.00	0.04
463	603466	风语筑	31,000	288,920.00	0.03
464	600761	安徽合力	16,200	285,930.00	0.03
465	600993	马应龙	10,900	284,599.00	0.03

466	600456	宝钛股份	9,800	278,810.00	0.03
467	301050	雷电微力	5,400	278,532.00	0.03
468	600559	老白干酒	13,200	277,068.00	0.03
469	002541	鸿路钢构	15,300	274,329.00	0.03
470	000968	蓝焰控股	41,100	273,315.00	0.03
471	300641	正丹股份	10,900	270,756.00	0.03
472	600409	三友化工	49,800	268,920.00	0.03
473	688123	聚辰股份	4,500	263,340.00	0.03
474	002327	富安娜	29,300	259,012.00	0.03
475	603439	贵州三力	19,900	258,700.00	0.03
476	605368	蓝天燃气	22,200	253,746.00	0.03
477	601101	昊华能源	30,660	252,331.80	0.03
478	002053	云南能投	22,000	250,800.00	0.03
479	001322	箭牌家居	31,000	250,790.00	0.03
480	601515	东峰集团	62,100	247,158.00	0.03
481	600395	盘江股份	48,500	246,865.00	0.03
482	688100	威胜信息	6,800	246,160.00	0.03
483	603027	千禾味业	20,300	245,833.00	0.03
484	603299	苏盐井神	21,900	243,966.00	0.03
485	600323	瀚蓝环境	10,300	243,286.00	0.03
486	002015	协鑫能科	31,200	242,112.00	0.03
487	000685	中山公用	26,200	241,826.00	0.03
488	688639	华恒生物	7,500	241,575.00	0.03
489	600114	东睦股份	14,800	239,316.00	0.03
490	000966	长源电力	50,100	237,975.00	0.03
491	300470	中密控股	6,300	237,510.00	0.03
492	002245	蔚蓝锂芯	22,100	236,249.00	0.03
493	002901	大博医疗	7,600	234,384.00	0.03
494	603690	至纯科技	9,300	233,523.00	0.03
495	002222	福晶科技	7,200	233,280.00	0.03
496	300226	上海钢联	10,200	233,274.00	0.03
497	688789	宏华数科	3,500	232,330.00	0.03
498	600223	福瑞达	30,600	231,336.00	0.03
499	688268	华特气体	5,000	229,600.00	0.03
500	002468	申通快递	22,600	228,938.00	0.03
501	688658	悦康药业	15,882	228,859.62	0.03
502	002312	川发龙蟒	15,800	228,626.00	0.03
503	688608	恒玄科技	700	227,759.00	0.03
504	300482	万孚生物	10,070	225,668.70	0.03
505	000061	农产品	31,900	223,619.00	0.03
506	002061	浙江交科	54,700	223,176.00	0.03
507	002006	精工科技	13,500	222,750.00	0.03
508	600403	大有能源	75,400	221,676.00	0.03

509	600869	远东股份	46,300	219,925.00	0.03
510	300475	香农芯创	7,700	219,373.00	0.03
511	688088	虹软科技	5,600	215,936.00	0.03
512	600116	三峡水利	30,600	213,894.00	0.03
513	300827	上能电气	4,800	210,720.00	0.03
514	301219	腾远钴业	4,500	203,445.00	0.02
515	301155	海力风电	3,800	202,578.00	0.02
516	603920	世运电路	6,800	199,920.00	0.02
517	300623	捷捷微电	5,800	198,128.00	0.02
518	605222	起帆电缆	12,200	187,880.00	0.02
519	600331	宏达股份	24,200	184,404.00	0.02
520	603567	珍宝岛	14,800	171,680.00	0.02
521	301381	赛维时代	6,200	141,112.00	0.02
522	000935	四川双马	7,900	114,392.00	0.01
523	601827	三峰环境	12,300	105,534.00	0.01
524	600729	重庆百货	3,400	99,450.00	0.01
525	601609	金田股份	16,000	94,400.00	0.01
526	601208	东材科技	3,900	29,406.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603998	方盛制药	121,600	1,267,072.00	0.15
2	002444	巨星科技	33,200	1,074,020.00	0.13
3	002920	德赛西威	9,300	1,024,023.00	0.12
4	002970	锐明技术	21,400	1,019,282.00	0.12
5	300054	鼎龙股份	38,800	1,009,576.00	0.12
6	002138	顺络电子	32,000	1,007,360.00	0.12
7	603508	思维列控	41,800	994,004.00	0.12
8	002001	新和成	44,800	984,256.00	0.12
9	001283	豪鹏科技	17,000	984,130.00	0.12
10	603558	健盛集团	90,800	977,008.00	0.12
11	300360	炬华科技	57,700	967,629.00	0.12
12	600031	三一重工	58,400	962,432.00	0.12
13	688550	瑞联新材	30,700	960,603.00	0.12
14	300433	蓝思科技	43,500	952,650.00	0.11
15	002241	歌尔股份	36,700	947,227.00	0.11
16	601179	中国西电	124,600	945,714.00	0.11
17	603697	有友食品	91,600	932,488.00	0.11
18	603707	健友股份	70,200	931,554.00	0.11
19	600096	云天化	41,500	925,450.00	0.11
20	600378	昊华科技	31,700	916,447.00	0.11
21	601899	紫金矿业	60,600	916,272.00	0.11

22	688379	华光新材	44,700	912,774.00	0.11
23	603173	福斯达	38,500	887,425.00	0.11
24	300986	志特新材	72,800	883,792.00	0.11
25	000807	云铝股份	65,100	880,803.00	0.11
26	002273	水晶光电	38,700	859,914.00	0.10
27	301187	欧圣电气	25,200	859,320.00	0.10
28	600310	广西能源	187,000	852,720.00	0.10
29	000655	金岭矿业	138,300	850,545.00	0.10
30	301033	迈普医学	20,200	849,410.00	0.10
31	300016	北陆药业	134,600	834,520.00	0.10
32	301499	维科精密	17,300	456,547.00	0.05
33	688148	芳源股份	91,500	452,925.00	0.05
34	002164	宁波东力	89,500	448,395.00	0.05
35	301349	信德新材	13,900	447,302.00	0.05
36	300519	新光药业	33,500	444,545.00	0.05
37	301248	杰创智能	27,500	436,700.00	0.05
38	301507	民生健康	34,400	436,536.00	0.05
39	300314	戴维医疗	38,400	432,384.00	0.05
40	002909	集泰股份	86,900	431,893.00	0.05
41	301277	新天地	31,000	428,730.00	0.05
42	002367	康力电梯	62,400	428,688.00	0.05
43	300922	天秦装备	29,800	427,630.00	0.05
44	300967	晓鸣股份	36,300	426,525.00	0.05
45	300696	爱乐达	27,400	425,522.00	0.05
46	300771	智莱科技	40,200	422,904.00	0.05
47	002903	宇环数控	25,900	420,875.00	0.05
48	301083	百胜智能	29,800	419,286.00	0.05
49	301311	昆船智能	23,100	417,879.00	0.05
50	301025	读客文化	43,200	411,696.00	0.05
51	000593	德龙汇能	75,400	410,930.00	0.05
52	300745	欣锐科技	25,600	407,552.00	0.05
53	301292	海科新源	30,600	400,248.00	0.05
54	300636	同和药业	50,200	400,094.00	0.05
55	300812	易天股份	17,900	394,516.00	0.05
56	300283	温州宏丰	71,100	390,339.00	0.05
57	300317	珈伟新能	105,900	388,653.00	0.05
58	000529	广弘控股	65,000	383,500.00	0.05
59	000633	合金投资	85,800	380,094.00	0.05
60	300057	万顺新材	78,700	379,334.00	0.05
61	301319	唯特偶	12,900	376,164.00	0.05
62	603291	联合水务	32,200	374,486.00	0.05
63	000919	金陵药业	55,500	365,190.00	0.04
64	603916	苏博特	48,600	362,556.00	0.04

65	000531	穗恒运 A	60,900	350,784.00	0.04
66	002082	万邦德	53,600	344,648.00	0.04
67	601566	九牧王	39,800	334,718.00	0.04
68	300048	合康新能	65,800	331,632.00	0.04
69	600191	华资实业	47,200	326,624.00	0.04
70	002787	华源控股	40,200	316,776.00	0.04
71	002492	恒基达鑫	60,700	291,967.00	0.04
72	002634	棒杰股份	77,000	289,520.00	0.03
73	603280	南方路机	13,600	283,968.00	0.03
74	002574	明牌珠宝	60,400	278,444.00	0.03
75	300943	春晖智控	21,400	275,846.00	0.03
76	603230	内蒙新华	21,400	270,924.00	0.03
77	600860	京城股份	26,800	270,144.00	0.03
78	603617	君禾股份	36,400	266,812.00	0.03
79	000798	中水渔业	35,900	266,019.00	0.03
80	002546	新联电子	61,400	265,862.00	0.03
81	300218	安利股份	17,200	264,880.00	0.03
81	300471	厚普股份	28,000	264,880.00	0.03
82	000419	通程控股	46,300	264,373.00	0.03
83	002956	西麦食品	15,800	263,386.00	0.03
84	000790	华神科技	67,200	262,080.00	0.03
85	000153	丰原药业	42,700	261,751.00	0.03
86	002905	金逸影视	33,200	261,616.00	0.03
87	300160	秀强股份	48,000	261,120.00	0.03
88	002448	中原内配	41,700	261,042.00	0.03
89	300389	艾比森	21,900	260,829.00	0.03
90	300215	电科院	43,700	259,141.00	0.03
91	002795	永和智控	63,500	259,080.00	0.03
92	002483	润邦股份	49,700	258,937.00	0.03
93	603336	宏辉果蔬	60,600	258,762.00	0.03
94	600468	百利电气	55,000	258,500.00	0.03
95	001219	青岛食品	18,800	258,124.00	0.03
96	300021	大禹节水	63,300	257,631.00	0.03
97	300200	高盟新材	31,100	257,508.00	0.03
98	603289	泰瑞机器	31,200	257,400.00	0.03
99	300697	电工合金	20,400	257,244.00	0.03
100	002169	智光电气	41,800	257,070.00	0.03
100	603999	读者传媒	41,800	257,070.00	0.03
101	301215	中汽股份	43,200	257,040.00	0.03
102	300940	南极光	19,000	256,500.00	0.03
103	600249	两面针	50,300	256,027.00	0.03
104	300439	美康生物	24,500	256,025.00	0.03
105	300404	博济医药	29,300	255,789.00	0.03

106	300645	正元智慧	17,400	255,606.00	0.03
107	000521	长虹美菱	31,300	255,408.00	0.03
108	000607	华媒控股	68,800	255,248.00	0.03
109	002805	丰元股份	21,400	254,660.00	0.03
110	001208	华菱线缆	28,000	254,240.00	0.03
111	600152	维科技术	42,200	253,622.00	0.03
112	300359	全通教育	48,100	253,006.00	0.03
113	002441	众业达	32,500	252,850.00	0.03
114	300514	友讯达	17,500	252,700.00	0.03
115	300341	麦克奥迪	14,400	252,144.00	0.03
116	301378	通达海	8,800	252,032.00	0.03
117	300241	瑞丰光电	45,900	251,991.00	0.03
118	300011	鼎汉技术	34,600	251,888.00	0.03
119	301120	新特电气	25,400	251,714.00	0.03
120	002540	亚太科技	40,800	251,328.00	0.03
121	300193	佳士科技	28,100	249,809.00	0.03
122	002852	道道全	30,200	249,452.00	0.03
123	300414	中光防雷	31,300	249,148.00	0.03
124	300975	商络电子	22,100	248,625.00	0.03
125	300996	普联软件	13,600	246,432.00	0.03
126	002790	瑞尔特	33,700	246,010.00	0.03
127	300619	金银河	10,200	245,310.00	0.03
128	301132	满坤科技	8,900	244,750.00	0.03
129	301386	未来电器	11,600	244,644.00	0.03
130	688238	和元生物	49,300	243,542.00	0.03
131	300306	远方信息	20,600	238,960.00	0.03
132	603330	天洋新材	37,100	235,214.00	0.03
133	603158	腾龙股份	28,800	232,704.00	0.03
134	603618	杭电股份	42,100	228,603.00	0.03
135	603111	康尼机电	37,900	228,537.00	0.03
136	601956	东贝集团	47,200	227,976.00	0.03
137	301126	达嘉维康	21,700	226,548.00	0.03
138	603768	常青股份	18,800	225,976.00	0.03
139	000931	中关村	47,300	225,148.00	0.03
140	003038	鑫铂股份	13,500	223,830.00	0.03
141	002363	隆基机械	33,800	222,066.00	0.03
142	300018	中元股份	32,700	221,379.00	0.03
143	300375	鹏翎股份	47,900	220,819.00	0.03
144	301149	隆华新材	22,300	220,547.00	0.03
145	600558	大西洋	54,000	219,780.00	0.03
146	300187	永清环保	43,500	219,675.00	0.03
147	002337	赛象科技	44,200	219,674.00	0.03
148	300733	西菱动力	18,800	219,396.00	0.03

149	688468	科美诊断	31,700	217,145.00	0.03
150	300539	横河精密	20,300	215,586.00	0.03
151	000014	沙河股份	19,600	215,404.00	0.03
152	301566	达利凯普	13,000	213,720.00	0.03
153	002887	绿茵生态	30,500	212,585.00	0.03
154	300423	昇辉科技	30,600	211,752.00	0.03
155	688373	盟科药业	42,300	208,962.00	0.03
156	002376	新北洋	31,600	206,032.00	0.02
157	300466	赛摩智能	27,400	204,130.00	0.02
158	301329	信音电子	9,600	202,080.00	0.02
159	301320	豪江智能	13,400	199,794.00	0.02
160	301396	宏景科技	7,100	199,368.00	0.02
161	002331	皖通科技	27,000	199,260.00	0.02
162	603811	诚意药业	25,500	196,860.00	0.02
163	000534	万泽股份	15,200	195,624.00	0.02
164	301388	欣灵电气	8,500	195,415.00	0.02
165	301389	隆扬电子	11,600	193,952.00	0.02
166	002688	金河生物	42,800	191,316.00	0.02
167	300062	中能电气	32,300	189,924.00	0.02
168	301285	鸿日达	6,600	189,288.00	0.02
169	300447	全信股份	13,300	188,461.00	0.02
170	002972	科安达	18,000	187,200.00	0.02
171	002017	东信和平	18,000	186,660.00	0.02
172	300569	天能重工	37,400	186,252.00	0.02
173	300401	花园生物	12,700	186,182.00	0.02
174	300758	七彩化学	15,500	185,690.00	0.02
175	300752	隆利科技	10,900	185,300.00	0.02
176	603982	泉峰汽车	23,100	183,876.00	0.02
177	301282	金禄电子	8,700	182,265.00	0.02
178	300650	太龙股份	15,700	180,550.00	0.02
179	000411	英特集团	16,900	179,985.00	0.02
180	002300	太阳电缆	33,700	179,958.00	0.02
181	600488	津药药业	42,300	179,352.00	0.02
182	600222	太龙药业	34,900	177,641.00	0.02
183	300326	凯利泰	27,300	177,450.00	0.02
184	300164	通源石油	41,500	176,790.00	0.02
185	300434	金石亚药	21,300	175,725.00	0.02
186	301332	德尔玛	17,500	175,350.00	0.02
187	301041	金百泽	7,300	175,200.00	0.02
188	002641	公元股份	39,800	175,120.00	0.02
189	300639	凯普生物	29,500	174,935.00	0.02
190	002982	湘佳股份	9,800	174,930.00	0.02
191	600854	春兰股份	37,900	173,582.00	0.02

192	300584	海辰药业	8,600	173,376.00	0.02
193	300272	开能健康	28,100	172,815.00	0.02
194	301370	国科恒泰	16,000	172,800.00	0.02
195	600644	乐山电力	28,100	171,972.00	0.02
196	600379	宝光股份	17,900	169,513.00	0.02
197	300721	怡达股份	13,900	169,302.00	0.02
198	002451	摩恩电气	26,900	168,932.00	0.02
199	300507	苏奥传感	25,200	168,840.00	0.02
200	000978	桂林旅游	27,800	167,912.00	0.02
201	603122	合富中国	23,900	167,539.00	0.02
202	603787	新日股份	16,000	166,720.00	0.02
203	603386	骏亚科技	14,900	165,688.00	0.02
204	301408	华人健康	14,900	164,347.00	0.02
205	300615	欣天科技	14,200	163,158.00	0.02
206	300998	宁波方正	10,900	162,519.00	0.02
207	603917	合力科技	13,800	162,150.00	0.02
208	688488	艾迪药业	20,600	161,916.00	0.02
209	002412	汉森制药	26,900	161,669.00	0.02
210	300485	赛升药业	23,000	161,230.00	0.02
211	001318	阳光乳业	13,900	158,043.00	0.02
212	603135	中重科技	17,800	157,708.00	0.02
213	000701	厦门信达	34,200	156,294.00	0.02
214	002858	力盛体育	13,400	153,296.00	0.02
215	002022	科华生物	24,000	151,440.00	0.02
216	603681	永冠新材	11,700	150,813.00	0.02
217	002731	萃华珠宝	15,800	148,362.00	0.02
218	300025	华星创业	13,700	147,275.00	0.02
219	605068	明新旭腾	10,900	146,605.00	0.02
220	002282	博深股份	19,400	143,754.00	0.02
221	300453	三鑫医疗	19,000	141,740.00	0.02
222	601999	出版传媒	22,100	138,567.00	0.02
223	603081	大丰实业	12,100	136,730.00	0.02
224	600858	银座股份	24,300	134,865.00	0.02
225	002566	益盛药业	19,700	134,354.00	0.02
226	300966	共同药业	8,200	132,266.00	0.02
227	300512	中亚股份	19,000	129,390.00	0.02
228	002462	嘉事堂	10,000	129,200.00	0.02
229	600184	光电股份	11,200	115,584.00	0.01
230	603937	丽岛新材	11,800	106,908.00	0.01
231	600774	汉商集团	13,800	103,362.00	0.01
232	001331	胜通能源	9,300	102,393.00	0.01
233	300616	尚品宅配	7,800	95,550.00	0.01
234	301611	珂玛科技	804	45,104.40	0.01



235	688449	联芸科技	1,406	41,392.64	0.00
236	688605	先锋精科	744	39,937.92	0.00
237	688708	佳驰科技	780	38,181.00	0.00
238	001391	国货航	4,686	31,864.80	0.00
239	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.00
240	002365	永安药业	3,400	27,166.00	0.00
241	688750	金天钛业	1,685	26,016.40	0.00
242	301522	上大股份	816	20,269.44	0.00
243	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.00
244	301556	托普云农	267	15,766.35	0.00
245	301631	壹连科技	153	15,599.88	0.00
246	301571	国科天成	350	14,290.50	0.00
247	301622	英思特	306	13,745.52	0.00
248	301608	博实结	184	12,029.92	0.00
249	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
250	688710	益诺思	332	11,148.56	0.00
251	301617	博苑股份	253	10,066.87	0.00
252	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
253	301607	富特科技	257	9,287.98	0.00
254	301585	蓝宇股份	210	7,528.50	0.00
255	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.00
256	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
257	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
258	603310	巍华新材	254	4,559.30	0.00
259	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
260	603205	健尔康	128	3,500.80	0.00
261	603285	键邦股份	129	2,916.69	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	300303	聚飞光电	20,093,286.02	1.28
2	600480	凌云股份	19,465,154.00	1.24
3	300035	中科电气	18,424,845.00	1.18
4	300679	电连技术	17,796,244.00	1.14
5	603328	依顿电子	17,061,950.50	1.09
6	600531	豫光金铅	16,834,787.66	1.08
7	000528	柳工	16,433,219.00	1.05
8	601311	骆驼股份	16,420,498.00	1.05
9	300065	海兰信	16,398,091.84	1.05
10	603936	博敏电子	16,357,468.00	1.04

11	002036	联创电子	16,275,295.00	1.04
12	002068	黑猫股份	16,144,981.00	1.03
13	300123	亚光科技	16,049,443.00	1.03
14	002550	千红制药	15,764,895.00	1.01
15	002249	大洋电机	15,186,610.00	0.97
16	002745	木林森	15,144,075.00	0.97
17	000600	建投能源	15,093,922.03	0.96
18	300323	华灿光电	15,002,165.14	0.96
19	601886	江河集团	14,962,723.81	0.96
20	000543	皖能电力	14,588,344.20	0.93

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	603328	依顿电子	30,600,280.57	1.95
2	600480	凌云股份	26,627,429.98	1.70
3	300323	华灿光电	23,812,714.23	1.52
4	603936	博敏电子	23,359,503.24	1.49
5	601019	山东出版	23,060,758.00	1.47
6	300671	富满微	21,929,956.72	1.40
7	600710	苏美达	21,709,822.72	1.39
8	002214	大立科技	21,281,117.82	1.36
9	300623	捷捷微电	21,077,363.00	1.35
10	601921	浙版传媒	21,052,092.00	1.34
11	002815	崇达技术	20,777,174.00	1.33
12	002651	利君股份	20,230,123.78	1.29
13	601163	三角轮胎	20,037,419.90	1.28
14	601801	皖新传媒	19,974,313.02	1.28
15	300768	迪普科技	19,329,327.32	1.23
16	300183	东软载波	19,214,820.68	1.23
17	300303	聚飞光电	18,703,013.12	1.19
18	601126	四方股份	18,236,330.84	1.16
19	300035	中科电气	18,231,335.32	1.16
20	600531	豫光金铅	17,524,363.00	1.12

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	7,387,573,099.43
--------------	------------------

卖出股票收入（成交）总额	8,071,728,446.19
--------------	------------------

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投资。

### 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投资。

### 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。

### 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

国债期货不在本基金投资范围内。

#### 8.11.2 本期国债期货投资评价

国债期货不在本基金投资范围内。

### 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	67,924,730.06
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,090,979.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	69,015,709.13

## 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

## 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

## 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

## 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（%）
西部利得中证 1000 指数增强 A	3,023	114,749.34	89,111,877.13	25.69	257,775,391.77	74.31
西部利得中证 1000	4,429	112,384.78	68,393,310.16	13.74	429,358,900.34	86.26

指数增强 C						
合计	7,346	114,979.51	157,505,187.29	18.65	687,134,292.11	81.35

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

本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

## 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

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。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	西部利得中证 1000 指数增强 A	西部利得中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日 (2023 年 4 月 25 日) 基金份额总额	590,354,759.18	696,121,534.46
本报告期期初基金份额总额	632,658,599.07	982,489,601.19
本报告期基金总申购份额	233,953,465.22	508,210,870.50
减：本报告期基金总赎回份额	519,724,795.39	992,948,261.19
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	346,887,268.90	497,752,210.50

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的重大人事变动如下：

根据基金管理人第二届董事会第三十九次会议决议，自 2024 年 10 月 24 日起总经理贺燕萍代为履行首席信息官职责，免去艾书萃首席信息官职务。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

2024 年 12 月 9 日，根据工作安排，宋菁女士不再担任平安银行股份有限公司资产托管部副总经理。

## 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 48,000.00 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 (%)	
恒泰证券	3	10,402,564,084.81	67.30	1,712,494.58	66.81	-
国泰君安	2	2,883,891,668.67	18.66	420,778.96	16.42	-
广发证券	1	1,695,448,830.48	10.97	247,386.68	9.65	-
西部证券	2	224,684,307	1.45	100,188.97	3.91	-

		. 73				
中信证券	1	153, 281, 480 . 83	0. 99	68, 338. 53	2. 67	-
国盛证券	2	96, 150, 635. 48	0. 62	14, 024. 26	0. 55	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

注：1. 本基金交易单元的选择标准主要包括：(1) 主体指标，包括证券公司的财务状况评估、经营规范评估、合规内控评估；(2) 交易服务指标，包括证券公司的交易服务评估、经纪业务评估、协作满意度评估等。选择程序主要如下：基于上述评估指标，公司定期进行券商准入评估，结合负面剔除情形，形成交易服务准入白名单，对于进入交易服务准入白名单且达到分佣要求的券商可根据业务需要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. 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 2024 年 1 月 1 日-2024 年 12 月 31 日。

### 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 (%)
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
光大证	-	-	-	-	-	-

券						
国投证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-

### 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喜鹊财富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	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	2024 年 7 月 31 日
2	西部利得基金管理有限公司关于客户服务中心（含直销中心）变更办公地址的公告	同上	2024 年 8 月 9 日
3	西部利得基金管理有限公司关于深圳分公司地址变更的公告	同上	2024 年 8 月 12 日
4	西部利得基金管理有限公司关于北京分公司负责人变更的公告	同上	2024 年 8 月 24 日
5	西部利得基金管理有限公司关于提醒投资者注意防范不法分子冒用西部利得基金名义进行诈骗活动的提示性公告	同上	2024 年 8 月 29 日
6	西部利得基金管理有限公司关于即将终止上海凯石财富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	2024 年 9 月 30 日
7	西部利得基金管理有限公司关于即将终止海银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	2024 年 10 月 23 日
8	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	同上	2024 年 10 月 26 日
9	西部利得基金管理有限公司关于旗下部分基金的销售机构由北京中植基金销售有限公司变更为华源证券股份有限公司的公告	同上	2024 年 12 月 12 日



## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准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。

### 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

2025 年 3 月 28 日