

西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资 基金 2015 年年度报告

2015 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：二〇一六年三月三十日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2015 年 4 月 15 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告	10
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.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	23
§8 投资组合报告	46
8.1 期末基金资产组合情况.....	46
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	46
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.....	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	60
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	87
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.....	87
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.....	87

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	87
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	87
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	88
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	88
8.12	投资组合报告附注	88
§9	基金份额持有人信息	89
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	89
9.2	期末上市基金前十名持有人	90
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	91
9.4	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的情况	91
§10	开放式基金份额变动	92
§11	重大事件揭示	92
11.1	基金份额持有人大会决议	92
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	92
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	93
11.4	基金投资策略的改变	93
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	93
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	93
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	93
11.8	其他重大事件	94
§12	备查文件目录	100
12.1	备查文件目录	100
12.2	存放地点	100
12.3	查阅方式	100

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金		
基金简称	西部利得中证 500 等权重指数分级		
场内简称	500 等权		
基金主代码	502000		
基金运作方式	上市契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 4 月 15 日		
基金管理人	西部利得基金管理有限公司		
基金托管人	兴业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	9,580,420.73 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所		
上市日期	2015 年 4 月 27 日		
下属分级基金的基金简称	西部利得中证 500 等权重指数分级	西部利得中证 500 等权重指数分级 A	西部利得中证 500 等权重指数分级 B
下属分级基金场内简称	500 等权	500 等权 A	500 等权 B
下属分级基金的交易代码	502000	502001	502002
报告期末下属分级基金份额总额	5,244,148.73 份	2,168,136.00 份	2,168,136.00 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，追求对中证 500 等权重指数的有效跟踪。力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内，以分享中国经济的长期增长成果，实现基金资产的长期增值。
投资策略	<p>本基金主要采用完全复制法，按照在中证 500 等权重指数中的成份股的构成及其基准权重构建股票投资组合，以拟跟踪中证 500 等权重指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，使跟踪误差控制在限定的范围之内。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金管理人主要按照中证 500 等权重指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金投资于中证 500 等权重指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%；现金以及到期日在 1 年以内</p>

	<p>的政府债券不低于基金资产净值的 5%。基金管理人将综合考虑股票市场情况、基金资产的流动性要求等因素确定各类资产的具体配置比例。在巨额申购赎回发生、成份股大比例分红等情况下，管理人将在综合考虑冲击成本因素和跟踪效果后，及时将股票配置比例调整至合理水平。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 股票组合构建原则</p> <p>本基金通过复制指数的方法，根据中证 500 等权重指数成份股组成及其基准权重构建股票投资组合。当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证 500 等权重指数的效果可能带来影响时，基金管理人将根据市场情况，采取合理措施控制基金的跟踪误差。在特殊情况下，本基金将选择其他股票或股票组合对标的指数中的股票加以适当替换，这些情况包括但不限于以下情形：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) 法律法规的限制； 2) 标的指数成份股流动性严重不足，或因受股票停牌的限制等其他市场因素，使基金管理人无法依指数权重购买某成份股； 3) 本基金资产规模过大导致本基金持有某些股票比例过高； 4) 成份股上市公司存在重大虚假陈述等违规行为、或者面临重大的不利行政处罚或司法诉讼； 5) 预期标的指数的成份股即将调整。 <p>为了减小跟踪误差，本基金按照主营业务相近、市值相近、相关性较高及β 值相近等原则来选择替代股票。</p> <p>(2) 股票组合调整方法</p> <p>本基金将采用完全复制法构建股票投资组合，根据中证 500 等权重指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。同时，本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增发等因素的变化，对股票投资组合进行适时调整，以保证基金净值增长率与中证 500 等权重指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等流动性好的债券。本基金对债券进行配置的原则是：安全性与流动性优先，且兼顾收益性。</p> <p>本基金在满足安全性与流动性的前提下，通过对国内外宏观经济形势的把握和系统分析国内财政政策与货币市场政策等因素变化对债券市场的影响，审慎研判债券市场风险收益特征的变化趋势，采取自上而下的策略构造组合，进行个券选择。</p>		
业绩比较基准	95%×中证 500 等权重指数收益率+5%×商业银行人民币活期存款利率（税后）		
下属分级基金的风险收益特征	500 等权份额为股票型指数份额，其预期风险大于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。	500 等权 A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征。	500 等权 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		西部利得基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐剑钧	张志永
	联系电话	021-38572888	021-62677777-212004
	电子邮箱	service@westleadfund.com	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		4007-007-818;021-38572666	95561
传真		021-38572750	021-62159217
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 11 层 02、03 单元	福州市湖东路 154 号
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 11 楼	上海市江宁路 168 号兴业大厦 20 楼
邮政编码		200127	200041
法定代表人		安保和	高建平

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
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——上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 11 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	西部利得基金管理有限公司	上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 11 楼

§ 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	2015 年 4 月 15 日 -2015 年 12 月 31 日	2014 年	2013 年
本期已实现收益	-23,815,032.77	-	-
本期利润	-24,002,824.02	-	-
加权平均基金份额本期利润	-0.3454	-	-
本期加权平均净值利润率	-37.83%	-	-
本期基金份额净值增长率	-31.50%	-	-

3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配利润	-7,337,868.58	-	-
期末可供分配基金份额利润	-0.7659	-	-
期末基金资产净值	11,082,924.46	-	-
期末基金份额净值	1.157	-	-
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
基金份额累计净值增长率	-31.50%	-	-

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）。

4. 本基金合同生效日为 2015 年 4 月 15 日。截至 2015 年 12 月 31 日，基金合同生效未满一年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	26.85%	1.85%	24.78%	1.94%	2.07%	-0.09%
过去六个月	-31.57%	2.67%	-12.61%	3.12%	-18.96%	-0.45%
自基金合同生效起至今	-31.50%	2.70%	-3.46%	3.06%	-28.04%	-0.36%

注：本基金的业绩比较基准为：中证 500 等权重指数收益率*95%+商业银行人民币活期存款利率（税后）*5%

其中：中证 500 等权重指数作为衡量股票投资部分的业绩基准，商业银行人民币活期存款利率作为固定收益类资产、货币资产部分的业绩基准

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$benchmark(0) = 1000;$

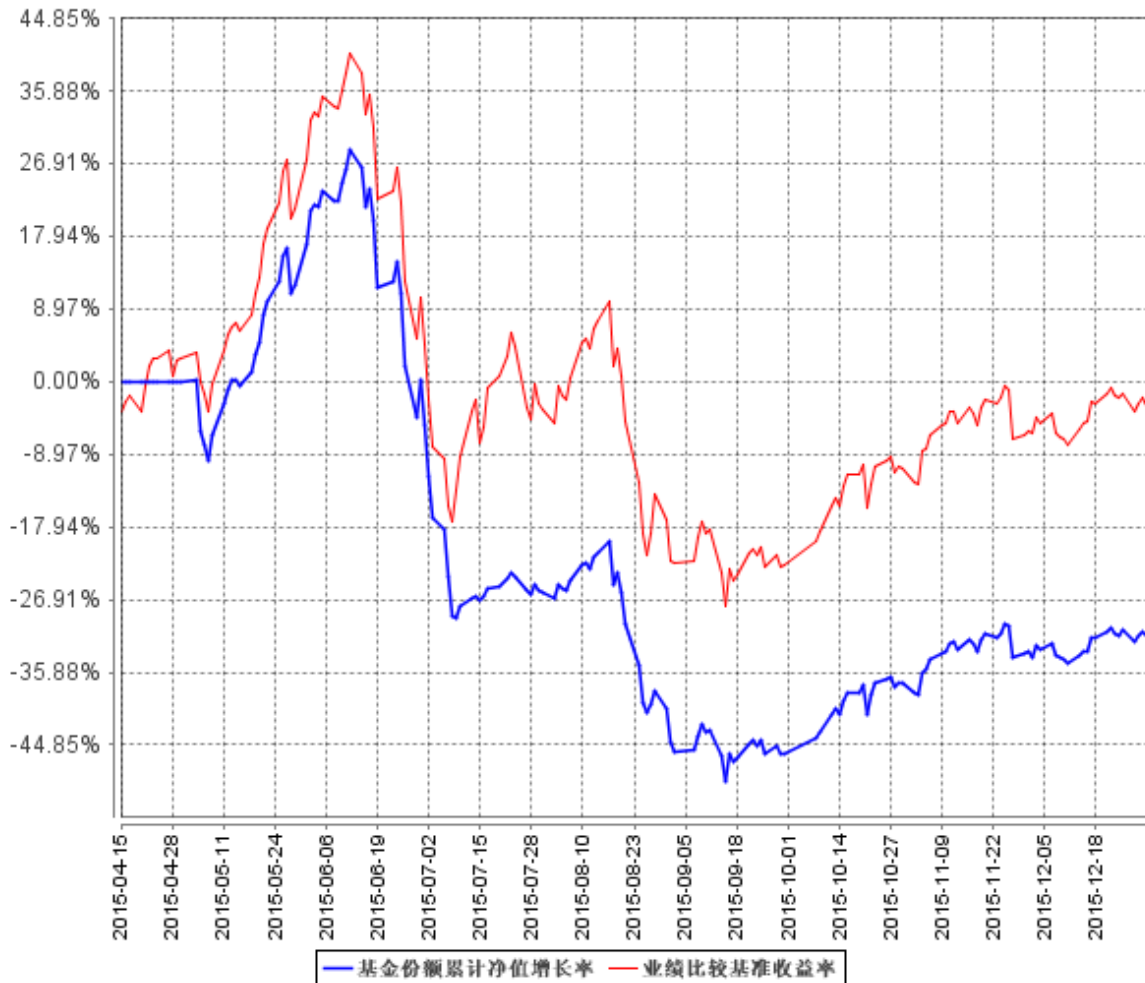
$\%benchmark(t) = 95\% * (\text{中证 500 等权重指数收益率}(t) / \text{中证 500 等权重指数收益率}(t-1) - 1) + 5\% * \text{商业银行人民币活期存款利率} / 365;$

$benchmark(t) = (1 + \%benchmark(t)) * benchmark(t-1);$

其中 $t=1, 2, 3, \dots$ 。

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

基金份额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

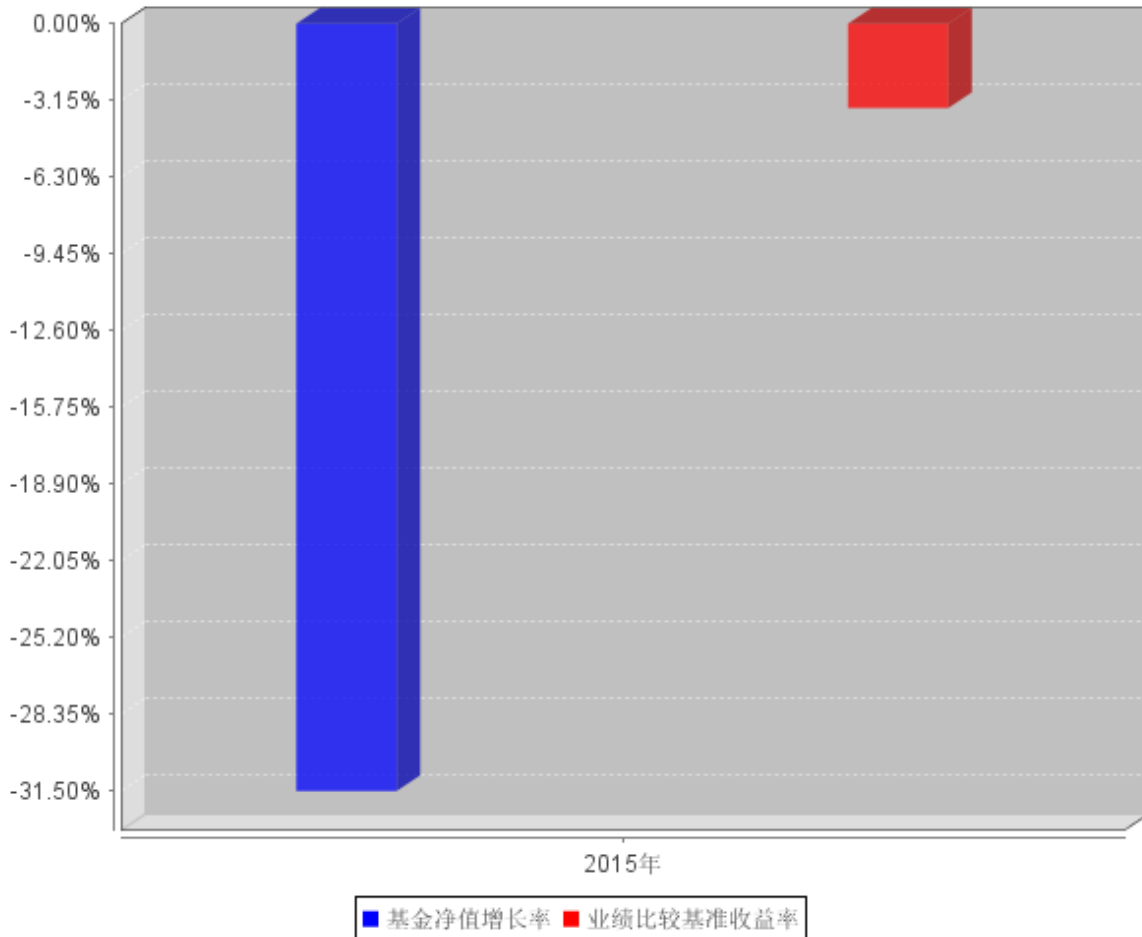


注：1. 本基金的基金合同于 2015 年 4 月 15 日生效，截至 2015 年 12 月 31 日，基金运作未满一年。图示日期为 2015 年 4 月 15 日至 2015 年 12 月 31 日。

2. 根据基金合同约定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金的建仓期为 2015 年 4 月 15 日至 2015 年 10 月 14 日，至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合合同约定。

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

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对比图



注：1. 本基金的基金合同于 2015 年 4 月 15 日生效，截至 2015 年 12 月 31 日，基金运作未满一年。
2. 本基金基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自 2015 年 4 月 15 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日未进行过利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

西部利得基金管理有限公司（简称“西部利得基金”，下同）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2010]864号）批准成立于 2010 年 7 月 20 日，公司由西部证券股份有限公司和上海利得财

富资产管理有限公司合资设立，注册资本 3 亿元人民币，其中西部证券股份有限公司出资 51%，上海利得财富资产管理有限公司出资 49%，注册地上海。

截至 2015 年 12 月 31 日，西部利得基金共管理七只开放式基金——西部利得策略优选混合型证券投资基金、西部利得新动向灵活配置混合型证券投资基金、西部利得稳健双利债券型证券投资基金、西部利得稳定增利债券型发起式证券投资基金、西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金、西部利得成长精选灵活配置混合型证券投资基金和西部利得多策略优选灵活配置混合型证券投资基金。

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		
付琦	本基金基金经理、西部利得策略优选混合型证券投资基金基金经理、西部利得新动向灵活配置混合型证券投资基金基金经理、公司总经理助理兼投资总监兼投资部总监	2015 年 4 月 15 日	-	十五年	加拿大渥太华大学工商管理硕士；曾任海通证券股份有限公司业务董事、招商基金管理有限公司研究部高级研究员。2013 年 7 月加入本公司，现任公司总经理助理兼投资总监兼投资部总监，具有基金从业资格，中国国籍。
原泉	本基金基金经理、公司产品部总监	2015 年 4 月 15 日	-	五年	复旦大学金融工程硕士；曾任万得资讯有限公

					司项目经理、日邮物流（中国）有限公司经理、太平资产管理有限公司经理、财通基金管理有限公司产品经理。2013 年 8 月加入本公司，现任公司产品设计部总监，具有基金从业资格，中国国籍。
曹祥	本基金基金经理助理、公司高级研究员	2015 年 12 月 14 日	-	五年	南京大学工学硕士；曾任南证期货有限公司研究员，国泰君安期货有限公司研究员。2015 年 8 月加入本公司，现任公司高级研究员，具有基金从业资格，中国国籍。

注：1. 基金经理的任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日；

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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《证券法》、《证券投资基金法》、《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金于 2015 年 5 月 5 日发生份额净值大幅度偏离标的指数的情形。因此，中国证券监督管理委员会上海监管局对本基金基金经理采取了行政监管措施(沪证监决[2015]63 号)，对其出具警示函以提醒其应切实履行基金经理职责。本基金管理人也将加强对基金经理投资研究行为管理，以切实保护投资者的合法权益。除上述情况外，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

本基金管理人已根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了公司《投资管理制度》、《交易部部门规章》、《公平交易管理制度》及《异常交易监控及报告制度》并遵守上述制度和流程；严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的各个环节公平对待不同投资组合，严禁直接或者间接通过与第三方的交易安排等在不同投资组合之间进行利益输送，通过系统和人工等方式在各环节严格控制公平交易执行，以公平对待投资人。

控制方法包括：1. 研究环节：公募基金投资和专户投资共用研究平台、共享信息。2. 投资及授权环节：公司建立不同投资组合层面的投资对象与交易对手备选库。公司建立了分层投资授权制度，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。3. 交易环节：为确保交易的公平执行，将公司投资组合的投资决策过程和交易执行过程分开，各投资组合的所有证券买卖活动须通过交易部集中统一完成。（1）所有交易所指令必须通过系统下达，通过系统方式进行公平交易。（2）对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配制度，在参与申购之前，各投资组合经理独立地确定申购价格和数量，并将申购指令下达给交易部。交易部以价格优先、比例分配原则进行分配。（3）对于银行间交易，交易部在银行间市场上按照时间优先、价格优先的原则进行分配。

此外，公司通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。公司建立异常交易监控及报告制度，通过事前监控、事中监控、事后监控三个异常交易监控体系环节，建立异常交易行为日常监控和分析评估制度、异常交易分析报告和信息披露，进

一步规范和完善投资和交易管理，以确保公司管理的不同投资组合获得公平对待。

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，本基金未参与交易所公开竞价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% 的交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金为分级基金，为不同风险偏好的投资者提供了不同风险收益特征的投资工具。报告期内，本基金运作严格按照基金合同的各项要求，依据被动化指数投资方法进行投资管理。本基金自 2015 年 4 月 15 日成立，建仓期内遇到多次大额申购赎回，遭遇了 2015 年下半的股灾，进行了一次不定期份额折算，这些都在一定程度上增大了与业绩比较基准的偏离。建仓期后我们根据对市场行情分析判断以及日常申赎情况，对股票仓位及头寸进行了合理安排，将跟踪误差控制在合理水平。

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

截至 2015 年 12 月 31 日, 本基金份额净值为 1.157 元, 本报告期份额净值增长率为-31.50%, 同期业绩比较基准增长率为-3.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015 年以来供给侧改革, 意在通过对过剩产能进行清理, 与此同时需求侧管理托底稳定经济, 2016 年 GDP 增速可能温和下行。2016 年是“十三五规划”的开局之年, 产业政策将继续引领 A 股市场的结构调整, 人口结构变化和人均可支配收入的提高将为新兴产业带来新的消费需求。

在 2016 年宏观经济可能疲弱下行的影响下, 我们可预见的和我们不可预见的风险因素的存在, 2016 年市场运行过程可能较为曲折, 震荡幅度较大。

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, 本基金管理人内部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、加强内部监察稽核工作, 对投资研究质量控制、投资管理人员通讯管理、投资交易系统风控阈值、公平交易、反洗钱、基金销售各个环节、员工行为规范、直销柜台客服录音、即时通讯监控、后台运营参数设置等重点项目进行内部检查稽核, 并继续加强对公司制度执行和风控措施落实情况的监察稽核;

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, 根据监管机构要求制定了洗钱风险自评估实施细则, 并进一步落实洗钱风险自评估工作, 继续落实反洗钱异常报告筛选并进一步完善工作流程, 开展反洗钱宣传工作及反洗钱合规培训。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、加强员工合规培训, 规范员工执业操守。同时, 进行了“新员工合规公开募集证券投资基金运作管理办法培训”、“反洗钱合规培训”等专题培训。

通过上述工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生禁止性关联交易、内幕交易及非公平交易的情形，基金运作整体合法合规。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据相关法律法规的规定，本基金管理人制订了证券投资基金估值政策和程序，并经本基金管理人总经理办公会议审议通过成立了估值委员会。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。具体职责包括对本基金管理人估值政策和程序的制订和解释；在发生影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况，以及在采用新投资策略或投资新品种时，估值委员会负责对所采用的估值模型、假设及参数的适当性进行重新评估或修订，必要时聘请会计师事务所进行审核并出具意见。针对个别投资品种的估值方法调整，均须通过托管银行复核。

估值委员会的成员包括投资部、研究部、风险管理部、基金运营部等有关人员组成。各成员平均具有 8 年以上的基金相关从业经验，且具有风控、证券研究、会计方面的专业经验并具备必要的专业知识和独立性，参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突，并按照制度规定的专业职责分工和估值流程履行估值程序。

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。

本基金管理人尚未签订任何与估值相关的定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金合同》的约定，存续期内，本基金（包括 500 等权份额，500 等权 A 份额，500 等权 B 份额）不进行收益分配。

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

截止本报告期末，本基金已出现连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，针对该情形，本基金管理人将向中国证监会提出解决方案。

§ 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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	普华永道中天审字(2016)第 20704 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 500 等权重指数分级证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金(以下简称“西部利得中证 500 指数分级基金”)的财务报表,包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

管理层对财务报表的责任段	<p>编制和公允列报财务报表是西部利得中证 500 指数分级基金的基金管理人西部利得基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：</p> <p>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；</p> <p>(2) 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>
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，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。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>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>
审计意见段	<p>我们认为，上述西部利得中证 500 指数分级基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了西部利得中证 500 指数分级基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
注册会计师的姓名	单峰 曹阳
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2016 年 3 月 25 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 500 等权重指数分级证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	829,281.87	-
结算备付金		1,873.48	-
存出保证金		51,256.84	-
交易性金融资产	7.4.7.2	10,373,589.19	-
其中：股票投资		10,373,589.19	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		219,901.82	-
应收利息	7.4.7.5	455.13	-
应收股利		-	-
应收申购款		4,104.55	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		11,480,462.88	-
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		61,085.04	-
应付赎回款		90,146.68	-
应付管理人报酬		9,679.07	-
应付托管费		1,935.81	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	14,352.10	-
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	220,339.72	-
负债合计		397,538.42	-
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	16,171,245.52	-
未分配利润	7.4.7.10	-5,088,321.06	-
所有者权益合计		11,082,924.46	-
负债和所有者权益总计		11,480,462.88	-

注：1. 报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.157 元，基金份额总额 9,580,420.73 份。其中西部利得中证 500 等权重指数分级 A 的基金份额净值 1.021 元，基金份额总额 2,168,136.00 份；西部利得中证 500 等权重指数分级 B 的基金份额净值 1.292 元，基金份额总额 2,168,136.00 份；西部利得中证 500 等权重指数分级的基金份额净值 1.157 元，基金份额总额 5,244,148.73 份。

2. 本基金为本报告期内基金合同生效的基金，无上年度末对比数据。本财务报表的实际编制期间为 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金

本报告期：2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 4 月 15 日(基 金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		-22,361,763.31	-
1.利息收入		375,973.94	-
其中：存款利息收入	7.4.7.11	245,452.82	-
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		130,521.12	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-23,215,143.56	-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-23,422,302.02	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-

衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	207,158.46	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-187,791.25	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	665,197.56	-
减：二、费用		1,641,060.71	-
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	439,513.79	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	87,902.78	-
3. 销售服务费	-	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	818,916.06	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	294,728.08	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-24,002,824.02	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-24,002,824.02	-

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间对比数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金

本报告期：2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	202,990,676.07	-	202,990,676.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-24,002,824.02	-24,002,824.02
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-186,819,430.55	18,914,502.96	-167,904,927.59

(净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	457,514,375.75	-93,271,512.96	364,242,862.79
2. 基金赎回款	-644,333,806.30	112,186,015.92	-532,147,790.38
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	16,171,245.52	-5,088,321.06	11,082,924.46
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-	-
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中: 1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	-	-	-

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金(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[2014] 1414 号批复核准，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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同》和《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金招募说明书》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 202,971,734.99 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 320 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 4 月 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 202,990,676.07 份基金份额，其中认购资金利息折合 18,941.08 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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同》和《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围是为具有良好流动性的金融工具，包括股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（不含中小企业私募债）、债券回购、资产支持证券、权证、央行票据、货币市场工具、银行存款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（但需符合中国证监会的相关规定）。其中，中证 500 等权重指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%且不低于非现金资产的 80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。业绩比较基准为：95%×中证 500 等权重指数收益率+5%×商业银行人民币活期存款利率（税后）。

本财务报表由本基金的基金管理人西部利得基金管理有限公司于 2016 年 3 月 30 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

本期财务报表的实际编制期间为 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易为目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无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。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 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；或者(3) 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。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期

权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

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

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管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。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小

的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金投资人可选择现金红利或将现金红利按除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

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并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票和债券，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[2008]38号《关于进一步规范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》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对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。

(3) 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。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市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，暂减按 25% 计入应纳税所得额。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。

(4) 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
活期存款	829,281.87	-
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	829,281.87	-

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2015 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		10,561,380.44	10,373,589.19	-187,791.25
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		10,561,380.44	10,373,589.19	-187,791.25
项目		上年度末 2014 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		-	-	-

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。本基金在本报告期成立，无上

年度可比数据。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	428.73	-
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	0.99	-
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	25.41	-
合计	455.13	-

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末均未持有其他资产。本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	14,352.10	-
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	14,352.10	-

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	339.72	-
预提费用	120,000.00	-
应付指数使用费	100,000.00	-
合计	220,339.72	-

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	202,990,676.07	202,990,676.07
本期申购	450,651,762.33	450,651,762.33
本期赎回(以“-”号填列)	-544,635,486.98	-544,635,486.98
2015 年 8 月 26 日 基金拆分/份 额折算前	109,006,951.42	109,006,951.42
基金拆分/份额折算变动份额	-44,443,440.77	-
本期申购	4,064,774.79	6,862,613.42
本期赎回(以“-”号填列)	-59,047,864.71	-99,698,319.32
本期末	9,580,420.73	16,171,245.52

注：1. 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2015 年 3 月 30 日至 2015 年 4 月 10 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 202,971,734.99 元。根据《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 18,941.08 元在本基金成立后，折算为 18,941.08 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金于 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 4 月 26 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务和赎回业务自 2015 年 4 月 27 日起开始办理。

4. 截至 2015 年 12 月 31 日止，本基金于上交所上市的基金份额为 8,203,503.00 份(其中基础份额 3,867,231.00 份，A 份额 2,168,136.00 份，B 份额 2,168,136.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 1,376,917.73 份。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。基础份额与 A 份额、B 份额之间可以按约定的规则进行场内份额配对转换，包括基金份额的分拆和合并两种转换行为。

5. 根据《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定和西部利得基金管理有限公司 2015 年 8 月 28 日发布的《关于西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复交易的公告》，本基金的基金管理人西部利得基金管理有限公司以 2015 年 8 月 26 日为份额折算基准日，对本基金实施不定期份额折算。折算前，场外基础份额和场内基础份额分别为 3,275,311.42 份和 10,336,726.00 份，根据基金份额折算公式，份额折算比例为 0.592288，折算后场外基础份额和场内基础份额分别为 1,939,927.65 份和 47,146,711.00 份，份额净值为 1.000 元。折算前，A 份额总额为 47,697,457.00 份，根据基金份额折算公式，份额折

算比例为 0.162240，折算后 A 份额为 7,738,436.00 份，份额净值为 1.000 元，新增场内基础份额为 41,024,392.00 份。折算前，B 份额总额为 47,697,457.00 份，根据基金份额折算公式，份额折算比例为 0.162240，折算后 B 份额为 7,738,436.00 份，份额净值为 1.000 元。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-23,815,032.77	-187,791.25	-24,002,824.02
本期基金份额交易产生的变动数	16,477,164.19	2,437,338.77	18,914,502.96
其中：基金申购款	-67,467,037.33	-25,804,475.63	-93,271,512.96
基金赎回款	83,944,201.52	28,241,814.40	112,186,015.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-7,337,868.58	2,249,547.52	-5,088,321.06

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	224,616.37	-
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	16,354.85	-
其他	4,481.60	-
合计	245,452.82	-

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	257,608,710.95	-
减：卖出股票成本总额	281,031,012.97	-

买卖股票差价收入	-23,422,302.02	-
----------	----------------	---

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期末未持有债券，债券投资收益为零。本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期末未持有债券，债券投资收益为零。本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未投资资产支持证券，资产支持证券投资收益为零。本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.7.14 贵金属投资收益

贵金属不在本基金投资范围内。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内未投资衍生工具，衍生工具投资收益为零。本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年4月15日(基金合同生效日)至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
股票投资产生的股利收益	207,158.46	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	207,158.46	-

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年4月15日(基金合同生效日)至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日

1. 交易性金融资产	-187,791.25	-
——股票投资	-187,791.25	-
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-187,791.25	-

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年4月15日(基金合 同生效日)至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
基金赎回费收入	665,197.56	-
合计	665,197.56	-

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年4月15日(基金合 同生效日)至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
交易所市场交易费用	818,916.06	-
银行间市场交易费用	-	-
合计	818,916.06	-

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年4月15日(基金合 同生效日)至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
审计费用	40,000.00	-
信息披露费	80,000.00	-
上市费用	70,000.00	-
银行汇划费用	155.00	-
指数使用费	104,573.08	-

合计	294,728.08	-
----	------------	---

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

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，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同》的规定，本基金对截至 2016 年 1 月 4 日止登记在册的基础份额场外份额、场内份额以及 A 份额进行定期份额折算。份额折算方式为 A 份额和 B 份额按照基金合同规定的净值计算规则进行净值计算，对 A 份额的应得收益进行定期份额折算，每 2 份基础份额将按 1 份 A 份额获得约定应得收益的新增折算份额。折算完成后，A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元，基础份额的基金份额净值相应调整。

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、基金销售机构
西部证券股份有限公司（简称“西部证券”）	基金管理人的股东
上海利得财富资产管理有限公司	基金管理人的股东
兴业银行股份有限公司（简称“兴业银行”）	基金托管人、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金于本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。本基金为本报告期内成立的基金，无上年度可比期间。

7.4.10.1.2 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。本基金为本报告期内成立的基金，无上年度可比期间。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期应支付关联方的佣金为零。本基金为本报告期内成立的基金，无上年度可比

期间。

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 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	439,513.79	-
其中：支付销售机构的客户维护费	17,913.27	-

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

日基金管理费=前一日基金资产净值×1%/当年天数。

2. 本基金为本报告期内成立的基金，无上年度可比期间。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	87,902.78	-

注：1. 支付基金托管人兴业银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.2%/当年天数。

2. 本基金为本报告期内成立的基金，无上年度可比期。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本报告期内未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易。本基金为本报告期内成立的基金，无上年度可比期间。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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末未运用固有资金投资本基金。本基金为本报告期内成立的基金，无

上年度可比期间。

7.4.10.4.2 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

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。本基金为本报告期内成立的基金，无上年度可比期间。

7.4.10.5 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 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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
兴业银行股份有限 公司	829,281.87	224,616.37	-	-

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

2. 本基金通过“兴业银行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 2015 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 1,873.48 元。

3. 本基金为本报告期内成立的基金，无上年度可比期间。

7.4.10.6 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。本基金为本报告期内成立的基金，无上年度可比期间。

7.4.11 利润分配情况

根据《基金合同》的约定，存续期内，本基金（包括 500 等权份额，500 等权 A 份额，500 等权 B 份额）不进行收益分配。

7.4.12 期末（2015 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

本基金于本报告期末未因认购新发/增发而持有流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌日期	复牌 开盘单 价	数量（股）	期末 成本总额	期末估值 总额	备注
600978	宜华木业	2015 年 6 月 18 日	重大资产	21.31	2016 年 1 月 21 日	20.10	11,000	172,741.51	234,410.00	-

			重组								
000066	长城 电脑	2015 年 6 月 18 日	重大 资产 重组	15.19	-	-	9,900	179,222.95	150,381.00	-	
002018	华信 国际	2015 年 6 月 15 日	重大 资产 重组	30.62	-	-	4,400	111,123.15	134,728.00	-	
002219	恒康 医疗	2015 年 7 月 8 日	重大 资产 重组	14.90	-	-	7,250	110,362.54	108,025.00	-	
600729	重庆 百货	2015 年 7 月 24 日	重大 资产 重组	32.39	2016 年 1 月 4 日	29.90	3,100	94,289.20	100,409.00	-	
000748	长城 信息	2015 年 6 月 18 日	重大 资产 重组	24.68	-	-	3,740	105,012.60	92,303.20	-	
002174	游族 网络	2015 年 7 月 23 日	重大 资产 重组	89.53	-	-	1,000	88,883.77	89,530.00	-	
000426	兴业 矿业	2015 年 10 月 28 日	重大 资产 重组	7.06	-	-	4,400	31,429.18	31,064.00	-	
002049	同方 国芯	2015 年 12 月 11 日	重大 资产 重组	60.15	-	-	500	22,639.68	30,075.00	-	
600429	三元 股份	2015 年 9 月 21 日	重大 资产 重组	7.29	2016 年 1 月 27 日	7.49	3,800	36,348.99	27,702.00	-	
000028	国药 一致	2015 年 10 月 21 日	重大 资产 重组	66.15	-	-	400	28,075.08	26,460.00	-	
600759	洲际 油气	2015 年 9 月 21 日	重大 资产 重组	7.85	-	-	3,340	36,630.43	26,219.00	-	
600645	中源 协和	2015 年 12 月 30 日	重大 事项	65.01	2016 年 1 月 4 日	63.90	400	21,289.00	26,004.00	-	
600219	南山 铝业	2015 年 9 月 29 日	重大 事项	6.58	2016 年 1 月 25 日	7.00	3,900	33,580.80	25,662.00	-	
002143	印纪 传媒	2015 年 12 月 9 日	重大 事项	40.55	2016 年 1 月 5 日	36.50	600	18,982.94	24,330.00	-	
300088	长信 科技	2015 年 12 月 14 日	重大 资产 重组	14.03	-	-	1,600	18,159.17	22,448.00	-	
600864	哈投	2015 年 10 月	重大	10.88	2016 年 1 月	11.97	2,000	29,535.30	21,760.00	-	

	股份	9 日	资产 重组		14 日						
600654	中安 消	2015 年 12 月 14 日	重大 事项	28.84	-	-	700	18,212.94	20,188.00	-	
002011	盾安 环境	2015 年 12 月 28 日	重大 事项	16.72	-	-	1,200	17,835.10	20,064.00	-	
600120	浙江 东方	2015 年 10 月 12 日	重大 资产 重组	19.86	-	-	1,000	26,340.84	19,860.00	-	
600200	江苏 吴中	2015 年 11 月 26 日	重大 资产 重组	27.89	-	-	700	16,570.78	19,523.00	-	
600880	博瑞 传播	2015 年 9 月 16 日	重大 资产 重组	7.50	2016 年 1 月 18 日	8.25	2,600	41,326.40	19,500.00	-	
600122	宏图 高科	2015 年 12 月 25 日	重大 事项	19.42	-	-	1,000	15,096.26	19,420.00	-	
002340	格林 美	2015 年 12 月 29 日	重大 事项	15.20	2016 年 1 月 6 日	14.35	1,270	18,670.40	19,304.00	-	
600851	海欣 股份	2015 年 12 月 21 日	重大 资产 重组	14.70	2016 年 1 月 19 日	13.23	1,300	14,399.02	19,110.00	-	
601000	唐山 港	2015 年 10 月 29 日	重大 资产 重组	8.25	-	-	2,300	24,644.70	18,975.00	-	
601717	郑煤 机	2015 年 12 月 18 日	重大 资产 重组	7.52	-	-	2,500	19,457.67	18,800.00	-	
600699	均胜 电子	2015 年 11 月 4 日	重大 资产 重组	31.25	-	-	600	21,876.21	18,750.00	-	
600572	康恩 贝	2015 年 12 月 28 日	重大 事项	13.36	2016 年 1 月 4 日	13.18	1,400	21,890.40	18,704.00	-	
600859	王府 井	2015 年 12 月 21 日	重大 事项	27.22	2016 年 1 月 4 日	27.22	687	17,878.45	18,700.14	-	
601678	滨化 股份	2015 年 12 月 31 日	重大 事项	8.02	2016 年 1 月 5 日	7.22	2,300	18,742.57	18,446.00	-	
000973	佛塑 科技	2015 年 12 月 18 日	重大 事项	13.00	-	-	1,400	13,125.48	18,200.00	-	
002242	九阳 股份	2015 年 12 月 24 日	重大 事项	22.68	2016 年 1 月 11 日	20.41	800	18,147.52	18,144.00	-	
600584	长电 科技	2015 年 11 月 30 日	重大 资产	22.02	-	-	800	15,381.81	17,616.00	-	

			重组							
300043	互动娱乐	2015 年 12 月 17 日	重大事项	15.80	-	-	1,100	19,629.19	17,380.00	-
002698	博实股份	2015 年 12 月 28 日	重大事项	29.33	2016 年 1 月 5 日	26.40	590	19,957.93	17,304.70	-
002678	珠江钢琴	2015 年 12 月 21 日	重大事项	17.21	2016 年 1 月 19 日	15.49	1,000	16,778.98	17,210.00	-
002568	百润股份	2015 年 12 月 21 日	重大事项	42.69	2016 年 1 月 18 日	38.42	400	16,332.00	17,076.00	-
000829	天音控股	2015 年 11 月 9 日	重大资产重组	12.22	-	-	1,300	16,904.60	15,886.00	-
600282	南钢股份	2015 年 12 月 30 日	重大事项	3.17	2016 年 1 月 12 日	3.24	4,900	14,947.62	15,533.00	-
002371	七星电子	2015 年 10 月 8 日	重大事项	19.28	2016 年 1 月 11 日	21.21	800	23,589.89	15,424.00	-
002048	宁波华翔	2015 年 11 月 19 日	重大资产重组	17.40	-	-	828	15,455.49	14,407.20	-

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。本基金为本报告期内成立的基金，无上年度可比期间。

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。本基金为本报告期内成立的基金，无上年度可比期间。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（不含中小企业私募债）、债券回购、资产支持证券、权证、央行票据、货币市场工具、银行存款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。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人力争在严格控制风险的情况下实现基金资产长期增值，对以上风险采取的风险管理政策如下所述：

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只股票型指数分级证券投资基金，采用指数化投资策略，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，追求对中证 500 等权重指数的有效跟踪。本基金预期风险大于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额看，西部利得中证 500 等权重 A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；西部利得中证 500 等权重 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心，由督察长、风险控制委员会、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规审核委员会，负责对公司经营的合法合规性进行监督检查，对经营活动进行审计；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面，由风险管理部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理，由投资风险管理人员负责投资风险管理及绩效评估。

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人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本基金的托管行兴业银行，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等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资。

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。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，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。

于 2015 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、存出保证金和结算备付金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	829,281.87	-	-	-	829,281.87
结算备付金	1,873.48	-	-	-	1,873.48
存出保证金	51,256.84	-	-	-	51,256.84
交易性金融资产	-	-	-	10,373,589.19	10,373,589.19
应收证券清算款	-	-	-	219,901.82	219,901.82
应收利息	-	-	-	455.13	455.13
应收申购款	-	-	-	4,104.55	4,104.55
资产总计	882,412.19	-	-	10,598,050.69	11,480,462.88
负债					
应付证券清算款	-	-	-	61,085.04	61,085.04
应付赎回款	-	-	-	90,146.68	90,146.68
应付管理人报酬	-	-	-	9,679.07	9,679.07
应付托管费	-	-	-	1,935.81	1,935.81
应付交易费用	-	-	-	14,352.10	14,352.10
其他负债	-	-	-	220,339.72	220,339.72
负债总计	-	-	-	397,538.42	397,538.42
利率敏感度缺口	882,412.19	-	-	10,200,512.27	11,082,924.46
上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
负债					

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。本基金主要投资于交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用完全复制法构建股票组合，根据中证 500 等权重指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。债券投资方面，本基金在满足安全性与流动性的前提下，通过对国内外宏观经济形势的把握和系统分析国内财政政策与货币政策等因素变化对债券市场的影响，审慎研判债券市场风险收益特征的变化趋势，采取“自上而下”的策略选择个券，构造组合。此外，本基金的基金管理人还定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：投资于中证 500 等权重指数成分股及备选成分股的资产不低于基金资产净值的 90%且不低于非现金资产的 80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 2015 年 12 月 31 日		上年度末 2014 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	10,373,589.19	93.60	-	-
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	10,373,589.19	93.60	-

注：本基金投资于标的指数成分股及备选成分股的比例不低于基金资产净值的 90%且不低于非现金资产的 80%。

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（附注 7.4.1）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（2015 年 12 月 31 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准（附注 7.4.1）上升 5%	502,000.00	-
业绩比较基准（附注 7.4.1）下降 5%	-502,000.00	-	

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为 9,360,376.15 元，属于第二层级的余额为 1,013,213.04 元，无属于第三层级的余额。

(ii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具 不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	10,373,589.19	90.36
	其中：股票	10,373,589.19	90.36
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	831,155.35	7.24
7	其他各项资产	275,718.34	2.40
8	合计	11,480,462.88	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	153,104.00	1.38
B	采矿业	412,516.00	3.72
C	制造业	6,367,159.97	57.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	352,420.70	3.18

E	建筑业	283,437.09	2.56
F	批发和零售业	703,433.89	6.35
G	交通运输、仓储和邮政业	288,948.60	2.61
H	住宿和餐饮业	20,528.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	524,911.24	4.74
J	金融业	72,573.30	0.65
K	房地产业	584,171.90	5.27
L	租赁和商务服务业	171,336.20	1.55
M	科学研究和技术服务业	63,136.50	0.57
N	水利、环境和公共设施管理业	70,082.80	0.63
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	20,862.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	167,851.00	1.51
S	综合	117,116.00	1.06
	合计	10,373,589.19	93.60

8.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	占基金资产净值比例（%）
1	600978	宜华木业	11,000	234,410.00	2.12
2	000066	长城电脑	9,900	150,381.00	1.36
3	002018	华信国际	4,400	134,728.00	1.22
4	002219	恒康医疗	7,250	108,025.00	0.97
5	600729	重庆百货	3,100	100,409.00	0.91
6	000748	长城信息	3,740	92,303.20	0.83
7	002174	游族网络	1,000	89,530.00	0.81
8	000563	陕国投 A	2,100	31,752.00	0.29
9	000426	兴业矿业	4,400	31,064.00	0.28

10	002049	同方国芯	500	30,075.00	0.27
11	600429	三元股份	3,800	27,702.00	0.25
12	000028	国药一致	400	26,460.00	0.24
13	000078	海王生物	1,100	26,356.00	0.24
14	600759	洲际油气	3,340	26,219.00	0.24
15	600645	中源协和	400	26,004.00	0.23
16	600219	南山铝业	3,900	25,662.00	0.23
17	600736	苏州高新	2,300	25,300.00	0.23
18	603005	晶方科技	500	25,150.00	0.23
19	300257	开山股份	800	24,680.00	0.22
20	000511	烯碳新材	2,100	24,591.00	0.22
21	600161	天坛生物	700	24,451.00	0.22
22	002143	印纪传媒	600	24,330.00	0.22
23	300134	大富科技	800	24,080.00	0.22
24	000012	南玻 A	1,800	24,030.00	0.22
25	600422	昆药集团	595	23,692.90	0.21
26	600816	安信信托	1,040	23,680.80	0.21
27	000513	丽珠集团	410	23,546.30	0.21
28	600884	杉杉股份	600	23,544.00	0.21
29	600482	风帆股份	500	23,525.00	0.21
30	600195	中牧股份	1,100	23,518.00	0.21
31	600618	氯碱化工	1,449	23,386.86	0.21
32	000988	华工科技	1,100	23,298.00	0.21
33	002642	荣之联	400	23,156.00	0.21
34	002180	艾派克	500	23,075.00	0.21
35	600528	中铁二局	1,600	22,928.00	0.21
36	002373	千方科技	500	22,875.00	0.21
37	002444	巨星科技	1,100	22,770.00	0.21
38	300088	长信科技	1,600	22,448.00	0.20
39	002428	云南锗业	1,100	22,308.00	0.20
40	600216	浙江医药	1,800	22,266.00	0.20
41	600198	大唐电信	900	22,203.00	0.20
42	000680	山推股份	2,900	22,185.00	0.20
43	002551	尚荣医疗	672	22,155.84	0.20
44	600651	飞乐音响	1,500	22,125.00	0.20
45	000671	阳光城	2,450	22,123.50	0.20
46	002233	塔牌集团	1,500	21,975.00	0.20
47	600770	综艺股份	1,200	21,924.00	0.20
48	000596	古井贡酒	600	21,900.00	0.20

49	002190	成飞集成	500	21,880.00	0.20
50	002681	奋达科技	500	21,850.00	0.20
51	600864	哈投股份	2,000	21,760.00	0.20
52	000603	盛达矿业	1,200	21,660.00	0.20
53	600536	中国软件	600	21,648.00	0.20
54	600812	华北制药	2,500	21,525.00	0.19
55	600487	亨通光电	1,350	21,519.00	0.19
56	002431	棕榈园林	800	21,472.00	0.19
57	603589	口子窖	500	21,470.00	0.19
58	000030	富奥股份	2,100	21,420.00	0.19
59	000933	神火股份	4,300	21,414.00	0.19
60	000501	鄂武商 A	1,000	21,400.00	0.19
61	600673	东阳光科	2,100	21,399.00	0.19
62	000998	隆平高科	900	21,375.00	0.19
63	000860	顺鑫农业	1,000	21,300.00	0.19
64	600298	安琪酵母	700	21,294.00	0.19
65	603883	老百姓	300	21,291.00	0.19
66	000587	金叶珠宝	1,000	21,250.00	0.19
67	000718	苏宁环球	1,610	21,235.90	0.19
68	600073	上海梅林	1,500	21,225.00	0.19
69	002249	大洋电机	1,600	21,216.00	0.19
70	002332	仙琚制药	1,400	21,210.00	0.19
71	000541	佛山照明	1,270	21,209.00	0.19
72	600410	华胜天成	800	21,208.00	0.19
73	600594	益佰制药	1,000	21,200.00	0.19
74	600809	山西汾酒	1,100	21,197.00	0.19
75	600160	巨化股份	900	21,123.00	0.19
76	600787	中储股份	2,100	21,084.00	0.19
77	600088	中视传媒	700	21,077.00	0.19
78	603899	晨光文具	500	21,030.00	0.19
79	300147	香雪制药	840	21,008.40	0.19
80	000550	江铃汽车	700	20,986.00	0.19
81	600175	美都能源	2,900	20,967.00	0.19
82	600694	大商股份	405	20,910.15	0.19
83	000418	小天鹅 A	870	20,880.00	0.19
84	600158	中体产业	800	20,864.00	0.19
85	300244	迪安诊断	300	20,862.00	0.19
86	002093	国脉科技	1,400	20,832.00	0.19
87	600300	维维股份	2,900	20,793.00	0.19

88	000417	合肥百货	1,900	20,767.00	0.19
89	600416	湘电股份	1,000	20,730.00	0.19
90	000652	泰达股份	2,900	20,677.00	0.19
91	600826	兰生股份	600	20,664.00	0.19
92	600850	华东电脑	400	20,660.00	0.19
93	600436	片仔癀	300	20,637.00	0.19
94	600803	新奥股份	1,301	20,633.86	0.19
95	600483	福能股份	1,200	20,628.00	0.19
96	600522	中天科技	900	20,610.00	0.19
97	600267	海正药业	1,300	20,605.00	0.19
98	000612	焦作万方	2,700	20,601.00	0.19
99	002503	搜于特	1,300	20,592.00	0.19
100	002648	卫星石化	1,900	20,539.00	0.19
101	600754	锦江股份	400	20,528.00	0.19
102	600395	盘江股份	2,500	20,525.00	0.19
103	002029	七匹狼	1,500	20,505.00	0.19
104	600500	中化国际	1,600	20,496.00	0.18
105	600187	国中水务	3,300	20,493.00	0.18
106	002745	木林森	500	20,465.00	0.18
107	002505	大康牧业	2,400	20,376.00	0.18
108	600499	科达洁能	900	20,367.00	0.18
109	600176	中国巨石	800	20,328.00	0.18
110	600521	华海药业	800	20,312.00	0.18
111	600351	亚宝药业	1,300	20,306.00	0.18
112	002273	水晶光电	500	20,300.00	0.18
113	002358	森源电气	1,100	20,295.00	0.18
114	002181	粤传媒	1,280	20,288.00	0.18
115	002005	德豪润达	2,000	20,280.00	0.18
116	002051	中工国际	800	20,264.00	0.18
117	000582	北部湾港	900	20,259.00	0.18
118	002345	潮宏基	1,200	20,256.00	0.18
119	002419	天虹商场	1,500	20,250.00	0.18
120	002050	三花股份	1,900	20,235.00	0.18
121	002508	老板电器	450	20,227.50	0.18
122	000926	福星股份	1,200	20,208.00	0.18
123	600654	中安消	700	20,188.00	0.18
124	002672	东江环保	1,000	20,170.00	0.18
125	000939	凯迪生态	1,400	20,160.00	0.18
126	000552	靖远煤电	2,000	20,160.00	0.18

127	002493	荣盛石化	1,300	20,150.00	0.18
128	603188	亚邦股份	900	20,142.00	0.18
129	300115	长盈精密	600	20,142.00	0.18
130	600797	浙大网新	1,400	20,132.00	0.18
131	002269	美邦服饰	3,000	20,130.00	0.18
132	002400	省广股份	800	20,120.00	0.18
133	002168	深圳惠程	1,700	20,111.00	0.18
134	002390	信邦制药	1,400	20,090.00	0.18
135	601005	重庆钢铁	6,100	20,069.00	0.18
136	002011	盾安环境	1,200	20,064.00	0.18
137	002293	罗莱生活	1,100	20,064.00	0.18
138	600580	卧龙电气	1,300	20,046.00	0.18
139	600079	人福医药	900	20,034.00	0.18
140	600557	康缘药业	800	20,016.00	0.18
141	603806	福斯特	400	19,996.00	0.18
142	002122	天马股份	2,400	19,992.00	0.18
143	002237	恒邦股份	2,000	19,960.00	0.18
144	600498	烽火通信	700	19,957.00	0.18
145	600056	中国医药	1,200	19,956.00	0.18
146	000897	津滨发展	3,500	19,950.00	0.18
147	002603	以岭药业	1,100	19,943.00	0.18
148	000951	中国重汽	1,101	19,928.10	0.18
149	002281	光迅科技	307	19,902.81	0.18
150	600628	新世界	1,100	19,899.00	0.18
151	600497	驰宏锌锗	1,800	19,872.00	0.18
152	600120	浙江东方	1,000	19,860.00	0.18
153	002317	众生药业	1,500	19,860.00	0.18
154	600425	青松建化	3,400	19,856.00	0.18
155	002461	珠江啤酒	1,300	19,851.00	0.18
156	000631	顺发恒业	2,000	19,840.00	0.18
157	000088	盐田港	2,300	19,826.00	0.18
158	002299	圣农发展	900	19,791.00	0.18
159	002701	奥瑞金	700	19,782.00	0.18
160	600059	古越龙山	1,800	19,782.00	0.18
161	600143	金发科技	2,300	19,780.00	0.18
162	002155	湖南黄金	2,200	19,778.00	0.18
163	600614	鼎立股份	1,700	19,771.00	0.18
164	600074	保千里	1,200	19,764.00	0.18
165	000997	新大陆	780	19,749.60	0.18

166	600917	重庆燃气	1,300	19,747.00	0.18
167	002308	威创股份	800	19,720.00	0.18
168	600289	亿阳信通	1,000	19,700.00	0.18
169	002056	横店东磁	700	19,677.00	0.18
170	600879	航天电子	1,100	19,657.00	0.18
171	600366	宁波韵升	900	19,656.00	0.18
172	603699	纽威股份	900	19,638.00	0.18
173	000488	晨鸣纸业	2,200	19,624.00	0.18
174	601801	皖新传媒	600	19,608.00	0.18
175	601226	华电重工	1,550	19,607.50	0.18
176	000732	泰禾集团	800	19,600.00	0.18
177	600755	厦门国贸	2,100	19,572.00	0.18
178	600823	世茂股份	1,600	19,568.00	0.18
179	600325	华发股份	1,200	19,560.00	0.18
180	002430	杭氧股份	1,700	19,550.00	0.18
181	600200	江苏吴中	700	19,523.00	0.18
182	002588	史丹利	600	19,518.00	0.18
183	600220	江苏阳光	3,400	19,516.00	0.18
184	600880	博瑞传播	2,600	19,500.00	0.18
185	600312	平高电气	1,000	19,500.00	0.18
186	600971	恒源煤电	3,100	19,499.00	0.18
187	600468	百利电气	1,100	19,492.00	0.18
188	600006	东风汽车	2,200	19,492.00	0.18
189	000697	炼石有色	700	19,474.00	0.18
190	600496	精工钢构	3,240	19,472.40	0.18
191	002635	安洁科技	700	19,460.00	0.18
192	002277	友阿股份	1,400	19,446.00	0.18
193	600122	宏图高科	1,000	19,420.00	0.18
194	300039	上海凯宝	1,400	19,404.00	0.18
195	002405	四维图新	500	19,400.00	0.18
196	000636	风华高科	1,700	19,397.00	0.18
197	600039	四川路桥	3,800	19,380.00	0.17
198	600566	济川药业	700	19,362.00	0.17
199	600380	健康元	1,400	19,348.00	0.17
200	300202	聚龙股份	600	19,314.00	0.17
201	002340	格林美	1,270	19,304.00	0.17
202	000900	现代投资	2,300	19,297.00	0.17
203	000650	仁和药业	1,825	19,290.25	0.17
204	600478	科力远	880	19,289.60	0.17

205	600022	山东钢铁	6,200	19,282.00	0.17
206	002013	中航机电	850	19,261.00	0.17
207	601965	中国汽研	2,050	19,249.50	0.17
208	002327	富安娜	1,600	19,248.00	0.17
209	600510	黑牡丹	1,600	19,248.00	0.17
210	002025	航天电器	740	19,232.60	0.17
211	000852	石化机械	900	19,224.00	0.17
212	002267	陕天然气	1,525	19,215.00	0.17
213	601168	西部矿业	2,600	19,214.00	0.17
214	002315	焦点科技	200	19,202.00	0.17
215	300182	捷成股份	800	19,200.00	0.17
216	002439	启明星辰	600	19,200.00	0.17
217	000572	海马汽车	3,000	19,200.00	0.17
218	300274	阳光电源	700	19,194.00	0.17
219	000600	建投能源	1,800	19,188.00	0.17
220	600132	重庆啤酒	1,200	19,188.00	0.17
221	002001	新和成	1,100	19,184.00	0.17
222	002140	东华科技	900	19,170.00	0.17
223	600284	浦东建设	1,400	19,166.00	0.17
224	600993	马应龙	870	19,157.40	0.17
225	002078	太阳纸业	3,400	19,142.00	0.17
226	600970	中材国际	1,600	19,120.00	0.17
227	600851	海欣股份	1,300	19,110.00	0.17
228	601139	深圳燃气	2,100	19,110.00	0.17
229	601012	隆基股份	1,400	19,110.00	0.17
230	600597	光明乳业	1,200	19,104.00	0.17
231	002004	华邦健康	1,350	19,102.50	0.17
232	600811	东方集团	2,200	19,096.00	0.17
233	600640	号百控股	900	19,089.00	0.17
234	600664	哈药股份	1,600	19,088.00	0.17
235	603366	日出东方	1,800	19,080.00	0.17
236	601777	力帆股份	1,100	19,074.00	0.17
237	002028	思源电气	1,200	19,068.00	0.17
238	000528	柳工	2,300	19,067.00	0.17
239	600329	中新药业	900	19,062.00	0.17
240	000931	中关村	1,500	19,050.00	0.17
241	002440	闰土股份	1,000	19,050.00	0.17
242	000786	北新建材	1,600	19,040.00	0.17
243	002342	巨力索具	2,500	19,025.00	0.17

244	000681	视觉中国	500	19,005.00	0.17
245	600280	中央商场	1,700	18,989.00	0.17
246	603766	隆鑫通用	800	18,984.00	0.17
247	601000	唐山港	2,300	18,975.00	0.17
248	000848	承德露露	1,150	18,975.00	0.17
249	600831	广电网络	1,200	18,972.00	0.17
250	600997	开滦股份	3,400	18,972.00	0.17
251	600418	江淮汽车	1,300	18,967.00	0.17
252	600511	国药股份	500	18,960.00	0.17
253	600586	金晶科技	3,100	18,941.00	0.17
254	000726	鲁泰 A	1,400	18,928.00	0.17
255	000919	金陵药业	1,100	18,920.00	0.17
256	600507	方大特钢	3,100	18,910.00	0.17
257	601908	京运通	2,300	18,906.00	0.17
258	000703	恒逸石化	1,700	18,887.00	0.17
259	000887	中鼎股份	800	18,880.00	0.17
260	002250	联化科技	1,000	18,870.00	0.17
261	000777	中核科技	600	18,834.00	0.17
262	600525	长园集团	1,000	18,830.00	0.17
263	002714	牧原股份	400	18,828.00	0.17
264	002064	华峰氨纶	2,900	18,821.00	0.17
265	601717	郑煤机	2,500	18,800.00	0.17
266	600183	生益科技	1,900	18,791.00	0.17
267	600748	上实发展	1,400	18,788.00	0.17
268	002309	中利科技	1,000	18,780.00	0.17
269	000975	银泰资源	1,500	18,780.00	0.17
270	600657	信达地产	2,700	18,765.00	0.17
271	600426	华鲁恒升	1,300	18,759.00	0.17
272	002254	泰和新材	1,180	18,750.20	0.17
273	600376	首开股份	1,500	18,750.00	0.17
274	600699	均胜电子	600	18,750.00	0.17
275	600801	华新水泥	2,300	18,745.00	0.17
276	600337	美克家居	1,200	18,744.00	0.17
277	002396	星网锐捷	776	18,740.40	0.17
278	600335	国机汽车	1,000	18,740.00	0.17
279	000090	天健集团	1,100	18,722.00	0.17
280	002311	海大集团	1,340	18,719.80	0.17
281	000830	鲁西化工	2,700	18,711.00	0.17
282	600572	康恩贝	1,400	18,704.00	0.17

283	002221	东华能源	800	18,704.00	0.17
284	600859	王府井	687	18,700.14	0.17
285	002194	武汉凡谷	1,100	18,700.00	0.17
286	600761	安徽合力	1,400	18,690.00	0.17
287	600397	安源煤业	3,200	18,688.00	0.17
288	603355	莱克电气	400	18,680.00	0.17
289	002106	莱宝高科	1,400	18,676.00	0.17
290	600316	洪都航空	800	18,672.00	0.17
291	002392	北京利尔	2,400	18,672.00	0.17
292	600757	长江传媒	1,700	18,666.00	0.17
293	600138	中青旅	800	18,648.00	0.17
294	002251	步步高	1,144	18,647.20	0.17
295	002217	合力泰	1,100	18,645.00	0.17
296	600509	天富能源	1,900	18,639.00	0.17
297	000525	红太阳	1,100	18,634.00	0.17
298	002477	雏鹰农牧	1,100	18,601.00	0.17
299	002073	软控股份	1,100	18,590.00	0.17
300	600460	士兰微	2,100	18,585.00	0.17
301	600720	祁连山	2,100	18,543.00	0.17
302	600151	航天机电	1,500	18,540.00	0.17
303	002041	登海种业	1,100	18,535.00	0.17
304	600320	振华重工	3,100	18,507.00	0.17
305	600004	白云机场	1,300	18,499.00	0.17
306	600201	生物股份	500	18,485.00	0.17
307	000877	天山股份	2,300	18,469.00	0.17
308	002663	普邦园林	2,326	18,468.44	0.17
309	601002	晋亿实业	1,600	18,448.00	0.17
310	601678	滨化股份	2,300	18,446.00	0.17
311	600780	通宝能源	2,600	18,434.00	0.17
312	600611	大众交通	1,200	18,420.00	0.17
313	000006	深振业 A	1,600	18,416.00	0.17
314	000762	西藏矿业	700	18,410.00	0.17
315	600617	国新能源	1,200	18,396.00	0.17
316	300273	和佳股份	880	18,392.00	0.17
317	600125	铁龙物流	2,000	18,380.00	0.17
318	002325	洪涛股份	1,175	18,365.25	0.17
319	000719	大地传媒	900	18,360.00	0.17
320	601369	陕鼓动力	2,100	18,354.00	0.17
321	600067	冠城大通	2,100	18,354.00	0.17

322	000667	美好集团	3,700	18,352.00	0.17
323	000816	智慧农业	2,200	18,348.00	0.17
324	601001	大同煤业	3,300	18,315.00	0.17
325	000869	张裕A	400	18,312.00	0.17
326	600743	华远地产	2,700	18,306.00	0.17
327	600776	东方通信	1,600	18,304.00	0.17
328	000062	深圳华强	500	18,300.00	0.17
329	002665	首航节能	600	18,300.00	0.17
330	600790	轻纺城	2,250	18,292.50	0.17
331	002408	齐翔腾达	1,374	18,287.94	0.17
332	002414	高德红外	600	18,282.00	0.16
333	600456	宝钛股份	900	18,270.00	0.16
334	600808	马钢股份	5,800	18,270.00	0.16
335	000031	中粮地产	1,300	18,265.00	0.16
336	002646	青青稞酒	800	18,256.00	0.16
337	603169	兰石重装	1,000	18,250.00	0.16
338	600062	华润双鹤	800	18,248.00	0.16
339	000970	中科三环	1,300	18,239.00	0.16
340	601515	东风股份	1,100	18,238.00	0.16
341	603019	中科曙光	200	18,234.00	0.16
342	002216	三全食品	1,600	18,224.00	0.16
343	000973	佛塑科技	1,400	18,200.00	0.16
344	000620	新华联	1,800	18,198.00	0.16
345	300122	智飞生物	500	18,190.00	0.16
346	600835	上海机电	600	18,186.00	0.16
347	601010	文峰股份	2,500	18,175.00	0.16
348	601666	平煤股份	3,900	18,174.00	0.16
349	000969	安泰科技	1,400	18,172.00	0.16
350	600587	新华医疗	500	18,165.00	0.16
351	600546	山煤国际	4,100	18,163.00	0.16
352	002595	豪迈科技	800	18,152.00	0.16
353	002437	誉衡药业	600	18,150.00	0.16
354	600869	智慧能源	1,900	18,145.00	0.16
355	002242	九阳股份	800	18,144.00	0.16
356	600881	亚泰集团	2,500	18,100.00	0.16
357	600348	阳泉煤业	2,800	18,088.00	0.16
358	002463	沪电股份	2,800	18,088.00	0.16
359	600251	冠农股份	1,600	18,080.00	0.16
360	601101	昊华能源	2,300	18,078.00	0.16

361	000616	海航投资	2,300	18,078.00	0.16
362	002223	鱼跃医疗	470	18,071.50	0.16
363	002276	万马股份	600	18,060.00	0.16
364	600240	华业资本	1,200	18,060.00	0.16
365	002384	东山精密	900	18,018.00	0.16
366	600064	南京高科	950	18,002.50	0.16
367	600894	广日股份	900	17,991.00	0.16
368	002238	天威视讯	810	17,982.00	0.16
369	000592	平潭发展	900	17,982.00	0.16
370	001696	宗申动力	1,300	17,966.00	0.16
371	002573	清新环境	800	17,952.00	0.16
372	600874	创业环保	1,700	17,935.00	0.16
373	600885	宏发股份	600	17,934.00	0.16
374	600260	凯乐科技	1,200	17,928.00	0.16
375	601929	吉视传媒	2,900	17,922.00	0.16
376	600601	方正科技	2,900	17,922.00	0.16
377	600639	浦东金桥	800	17,912.00	0.16
378	600825	新华传媒	1,500	17,910.00	0.16
379	601880	大连港	3,000	17,880.00	0.16
380	000543	皖能电力	2,110	17,871.70	0.16
381	000669	金鸿能源	800	17,864.00	0.16
382	600270	外运发展	660	17,859.60	0.16
383	000758	中色股份	1,200	17,856.00	0.16
384	600392	盛和资源	1,450	17,849.50	0.16
385	000685	中山公用	1,260	17,829.00	0.16
386	600409	三友化工	2,300	17,825.00	0.16
387	600503	华丽家族	1,300	17,810.00	0.16
388	300291	华录百纳	500	17,800.00	0.16
389	600169	太原重工	3,100	17,794.00	0.16
390	600655	豫园商城	1,100	17,776.00	0.16
391	600967	北方创业	1,000	17,750.00	0.16
392	000930	中粮生化	1,200	17,736.00	0.16
393	000099	中信海直	1,200	17,736.00	0.16
394	600805	悦达投资	1,400	17,724.00	0.16
395	603555	贵人鸟	500	17,715.00	0.16
396	600545	新疆城建	1,600	17,712.00	0.16
397	603328	依顿电子	600	17,706.00	0.16
398	600458	时代新材	1,000	17,700.00	0.16
399	600765	中航重机	900	17,676.00	0.16

400	002022	科华生物	607	17,663.70	0.16
401	600017	日照港	2,700	17,658.00	0.16
402	600750	江中药业	500	17,645.00	0.16
403	600704	物产中大	1,000	17,620.00	0.16
404	600584	长电科技	800	17,616.00	0.16
405	600108	亚盛集团	2,400	17,616.00	0.16
406	000690	宝新能源	1,800	17,604.00	0.16
407	002203	海亮股份	1,600	17,600.00	0.16
408	002271	东方雨虹	900	17,577.00	0.16
409	600481	双良节能	1,940	17,576.40	0.16
410	002118	紫鑫药业	900	17,559.00	0.16
411	002482	广田股份	600	17,550.00	0.16
412	600141	兴发集团	1,200	17,544.00	0.16
413	603698	航天工程	500	17,525.00	0.16
414	600516	方大炭素	1,400	17,514.00	0.16
415	002653	海思科	800	17,512.00	0.16
416	002244	滨江集团	2,200	17,512.00	0.16
417	601311	骆驼股份	800	17,464.00	0.16
418	002063	远光软件	826	17,461.64	0.16
419	002179	中航光电	460	17,461.60	0.16
420	000401	冀东水泥	1,600	17,440.00	0.16
421	000656	金科股份	3,300	17,424.00	0.16
422	300043	互动娱乐	1,100	17,380.00	0.16
423	300055	万邦达	800	17,368.00	0.16
424	002727	一心堂	300	17,349.00	0.16
425	600184	光电股份	600	17,346.00	0.16
426	600751	天海投资	1,800	17,316.00	0.16
427	002698	博实股份	590	17,304.70	0.16
428	002030	达安基因	420	17,295.60	0.16
429	600388	龙净环保	1,000	17,280.00	0.16
430	601126	四方股份	1,300	17,264.00	0.16
431	002266	浙富控股	2,120	17,256.80	0.16
432	600635	大众公用	1,750	17,255.00	0.16
433	300199	翰宇药业	700	17,241.00	0.16
434	600086	东方金钰	1,400	17,234.00	0.16
435	600435	北方导航	600	17,220.00	0.16
436	600872	中炬高新	1,100	17,215.00	0.16
437	002678	珠江钢琴	1,000	17,210.00	0.16
438	600171	上海贝岭	810	17,163.90	0.15

439	000921	海信科龙	1,801	17,163.53	0.15
440	000547	航天发展	900	17,145.00	0.15
441	600643	爱建集团	1,170	17,140.50	0.15
442	002498	汉缆股份	2,300	17,112.00	0.15
443	601233	桐昆股份	1,300	17,095.00	0.15
444	002568	百润股份	400	17,076.00	0.15
445	000049	德赛电池	300	17,034.00	0.15
446	000961	中南建设	1,100	17,006.00	0.15
447	002204	大连重工	1,700	17,000.00	0.15
448	600094	大名城	1,600	16,992.00	0.15
449	300072	三聚环保	500	16,985.00	0.15
450	000050	深天马 A	800	16,968.00	0.15
451	000861	海印股份	2,190	16,928.70	0.15
452	002489	浙江永强	1,560	16,910.40	0.15
453	000021	深科技	1,400	16,884.00	0.15
454	300026	红日药业	800	16,880.00	0.15
455	603001	奥康国际	500	16,810.00	0.15
456	300267	尔康制药	500	16,800.00	0.15
457	002368	太极股份	250	16,775.00	0.15
458	300085	银之杰	300	16,770.00	0.15
459	000693	华泽钴镍	900	16,767.00	0.15
460	603369	今世缘	500	16,765.00	0.15
461	600112	天成控股	1,000	16,760.00	0.15
462	300253	卫宁软件	400	16,752.00	0.15
463	600292	中电远达	810	16,750.80	0.15
464	002092	中泰化学	1,900	16,720.00	0.15
465	600575	皖江物流	2,700	16,713.00	0.15
466	600563	法拉电子	400	16,644.00	0.15
467	600537	亿晶光电	1,111	16,642.78	0.15
468	600517	置信电气	1,300	16,458.00	0.15
469	601886	江河创建	1,300	16,393.00	0.15
470	600773	西藏城投	900	16,380.00	0.15
471	603025	大豪科技	400	16,364.00	0.15
472	600596	新安股份	1,600	16,320.00	0.15
473	000519	江南红箭	960	16,300.80	0.15
474	002285	世联行	1,000	16,230.00	0.15
475	603077	和邦生物	2,400	16,152.00	0.15
476	002085	万丰奥威	500	16,090.00	0.15
477	000979	中弘股份	4,020	16,080.00	0.15

478	002479	富春环保	1,200	16,080.00	0.15
479	002128	露天煤业	1,900	16,055.00	0.14
480	600433	冠豪高新	1,400	16,044.00	0.14
481	002657	中科金财	200	15,998.00	0.14
482	600551	时代出版	700	15,925.00	0.14
483	600058	五矿发展	700	15,890.00	0.14
484	000829	天音控股	1,300	15,886.00	0.14
485	600259	广晟有色	400	15,840.00	0.14
486	600026	中海发展	1,700	15,708.00	0.14
487	002161	远望谷	700	15,610.00	0.14
488	000566	海南海药	400	15,544.00	0.14
489	603567	珍宝岛	300	15,540.00	0.14
490	600282	南钢股份	4,900	15,533.00	0.14
491	600180	瑞茂通	700	15,456.00	0.14
492	002371	七星电子	800	15,424.00	0.14
493	002191	劲嘉股份	1,000	15,360.00	0.14
494	002344	海宁皮城	1,000	15,340.00	0.14
495	603568	伟明环保	300	15,210.00	0.14
496	002048	宁波华翔	828	14,407.20	0.13
497	600236	桂冠电力	1,900	14,212.00	0.13
498	002466	天齐锂业	100	14,075.00	0.13
499	600428	中远航运	1,300	13,338.00	0.12
500	000661	长春高新	100	12,045.00	0.11
501	002354	天神娱乐	100	9,598.00	0.09

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	601519	大智慧	1,858,060.00	16.77
2	601010	文峰股份	1,432,612.00	12.93
3	600026	中海发展	1,386,494.00	12.51
4	600021	上海电力	1,337,792.00	12.07

5	300059	东方财富	1,238,591.00	11.18
6	601012	隆基股份	1,215,604.00	10.97
7	000540	中天城投	1,099,368.57	9.92
8	600380	健康元	1,042,478.00	9.41
9	600528	中铁二局	1,040,452.00	9.39
10	300168	万达信息	1,032,668.00	9.32
11	002183	怡亚通	1,000,033.00	9.02
12	000566	海南海药	989,772.00	8.93
13	600219	南山铝业	960,312.90	8.66
14	300144	宋城演艺	933,307.00	8.42
15	300253	卫宁软件	917,212.00	8.28
16	000930	中粮生化	911,477.00	8.22
17	000066	长城电脑	898,417.59	8.11
18	603555	贵人鸟	886,669.00	8.00
19	600869	智慧能源	880,795.00	7.95
20	600240	华业资本	876,147.65	7.91
21	600737	中粮屯河	868,315.25	7.83
22	000718	苏宁环球	862,705.00	7.78
23	600895	张江高科	857,383.21	7.74
24	600978	宜华木业	852,087.00	7.69
25	600037	歌华有线	849,716.00	7.67
26	001696	宗申动力	842,180.00	7.60
27	600704	物产中大	832,751.00	7.51
28	600428	中远航运	826,107.00	7.45
29	000732	泰禾集团	823,517.00	7.43
30	600180	瑞茂通	808,199.00	7.29
31	601718	际华集团	802,319.00	7.24
32	600601	方正科技	799,401.00	7.21
33	002489	浙江永强	794,322.00	7.17
34	000829	天音控股	785,951.00	7.09
35	600510	黑牡丹	784,662.00	7.08
36	000031	中粮地产	784,148.00	7.08
37	002332	仙琚制药	782,479.00	7.06
38	002293	罗莱生活	780,771.00	7.04
39	600122	宏图高科	779,412.00	7.03
40	002244	滨江集团	777,544.00	7.02

41	002285	世联行	772,846.00	6.97
42	600507	方大特钢	772,253.00	6.97
43	600064	南京高科	767,342.00	6.92
44	000078	海王生物	765,176.00	6.90
45	002595	豪迈科技	757,624.01	6.84
46	002276	万马股份	754,970.00	6.81
47	002311	海大集团	747,299.00	6.74
48	002004	华邦健康	744,185.00	6.71
49	002269	美邦服饰	743,215.00	6.71
50	600820	隧道股份	742,948.00	6.70
51	000667	美好集团	742,922.00	6.70
52	601872	招商轮船	742,085.00	6.70
53	000690	宝新能源	740,715.25	6.68
54	300115	长盈精密	739,858.00	6.68
55	600220	江苏阳光	739,061.99	6.67
56	000703	恒逸石化	728,978.00	6.58
57	002663	普邦园林	723,733.00	6.53
58	000418	小天鹅 A	721,335.30	6.51
59	000680	山推股份	720,611.00	6.50
60	600171	上海贝岭	719,878.70	6.50
61	002242	九阳股份	717,115.00	6.47
62	000012	南玻 A	716,046.00	6.46
63	000631	顺发恒业	714,537.00	6.45
64	600743	华远地产	712,011.00	6.42
65	600582	天地科技	709,414.00	6.40
66	600545	新疆城建	704,107.00	6.35
67	600831	广电网络	703,590.00	6.35
68	002266	浙富控股	699,427.00	6.31
69	600270	外运发展	696,174.00	6.28
70	002191	劲嘉股份	692,740.00	6.25
71	002588	史丹利	688,921.56	6.22
72	600835	上海机电	688,855.52	6.22
73	600496	精工钢构	687,403.00	6.20
74	000006	深振业 A	687,006.00	6.20
75	601801	皖新传媒	686,530.02	6.19
76	600894	广日股份	686,297.00	6.19

77	600823	世茂股份	683,769.00	6.17
78	601880	大连港	681,980.00	6.15
79	600376	首开股份	679,600.00	6.13
80	002237	恒邦股份	677,823.00	6.12
81	600458	时代新材	677,227.00	6.11
82	600200	江苏吴中	676,855.00	6.11
83	600826	兰生股份	676,684.00	6.11
84	000030	富奥股份	675,846.00	6.10
85	600017	日照港	673,188.00	6.07
86	000681	视觉中国	672,964.32	6.07
87	000758	中色股份	668,893.00	6.04
88	600635	大众公用	666,594.50	6.01
89	002396	星网锐捷	663,520.00	5.99
90	000830	鲁西化工	662,419.00	5.98
91	000488	晨鸣纸业	661,927.00	5.97
92	600320	振华重工	661,473.00	5.97
93	002030	达安基因	661,427.00	5.97
94	600409	三友化工	661,096.00	5.96
95	002250	联化科技	660,815.00	5.96
96	000021	深科技	660,489.00	5.96
97	600618	氯碱化工	659,848.29	5.95
98	002444	巨星科技	659,052.00	5.95
99	600429	三元股份	655,982.00	5.92
100	002440	闰土股份	654,684.00	5.91
101	002701	奥瑞金	654,128.00	5.90
102	600158	中体产业	653,713.00	5.90
103	000656	金科股份	652,914.00	5.89
104	600198	大唐电信	652,773.00	5.89
105	601000	唐山港	652,214.12	5.88
106	002063	远光软件	651,189.00	5.88
107	600586	金晶科技	650,458.00	5.87
108	002064	华峰氨纶	650,272.00	5.87
109	000816	智慧农业	650,003.00	5.86
110	002226	江南化工	649,907.95	5.86
111	600885	宏发股份	648,662.00	5.85
112	000090	天健集团	648,545.00	5.85

113	002123	荣信股份	648,229.00	5.85
114	600298	安琪酵母	645,849.00	5.83
115	600874	创业环保	645,095.00	5.82
116	002223	鱼跃医疗	644,491.00	5.82
117	002503	搜于特	644,295.00	5.81
118	600685	中船防务	644,108.48	5.81
119	000977	浪潮信息	643,102.00	5.80
120	002482	广田股份	640,773.00	5.78
121	600088	中视传媒	640,751.20	5.78
122	002678	珠江钢琴	639,532.00	5.77
123	600521	华海药业	639,127.00	5.77
124	600397	安源煤业	638,462.00	5.76
125	600750	江中药业	637,657.34	5.75
126	600736	苏州高新	637,555.00	5.75
127	600864	哈投股份	636,100.00	5.74
128	002573	清新环境	635,518.00	5.73
129	600639	浦东金桥	635,033.05	5.73
130	600184	光电股份	634,903.00	5.73
131	600748	上实发展	634,041.00	5.72
132	601886	江河创建	633,113.99	5.71
133	000620	新华联	632,405.92	5.71
134	600803	新奥股份	632,199.67	5.70
135	000028	国药一致	631,443.65	5.70
136	600426	华鲁恒升	631,375.19	5.70
137	002078	太阳纸业	631,085.00	5.69
138	600770	综艺股份	629,493.00	5.68
139	000671	阳光城	629,296.24	5.68
140	601908	京运通	628,553.00	5.67
141	600039	四川路桥	626,862.40	5.66
142	601965	中国汽研	624,277.00	5.63
143	002028	思源电气	624,215.00	5.63
144	002048	宁波华翔	623,758.00	5.63
145	000877	天山股份	623,394.82	5.62
146	600776	东方通信	622,968.00	5.62
147	600284	浦东建设	622,828.00	5.62
148	600138	中青旅	621,967.00	5.61

149	000900	现代投资	621,404.79	5.61
150	600790	轻纺城	621,401.00	5.61
151	600525	长园集团	620,339.00	5.60
152	002179	中航光电	620,007.02	5.59
153	000861	海印股份	618,992.00	5.59
154	603077	和邦生物	617,334.00	5.57
155	600120	浙江东方	617,273.00	5.57
156	000541	佛山照明	616,132.00	5.56
157	600151	航天机电	615,885.00	5.56
158	300273	和佳股份	615,164.00	5.55
159	000572	海马汽车	615,124.00	5.55
160	600125	铁龙物流	614,776.00	5.55
161	600351	亚宝药业	614,722.41	5.55
162	600289	亿阳信通	614,569.00	5.55
163	600067	冠城大通	613,605.60	5.54
164	002254	泰和新材	612,910.95	5.53
165	600183	生益科技	612,760.30	5.53
166	600640	号百控股	611,613.00	5.52
167	002050	三花股份	611,347.00	5.52
168	600757	长江传媒	611,031.82	5.51
169	601369	陕鼓动力	609,846.98	5.50
170	002690	美亚光电	608,665.00	5.49
171	000501	鄂武商 A	607,982.00	5.49
172	600059	古越龙山	607,589.00	5.48
173	600329	中新药业	607,174.00	5.48
174	600195	中牧股份	606,535.00	5.47
175	002011	盾安环境	606,444.00	5.47
176	600859	王府井	605,605.41	5.46
177	600780	通宝能源	605,352.00	5.46
178	002168	深圳惠程	604,956.00	5.46
179	002073	软控股份	604,331.44	5.45
180	600337	美克家居	603,761.00	5.45
181	002029	七匹狼	603,474.00	5.45
182	002646	青青稞酒	603,434.00	5.44
183	000528	柳工	603,323.00	5.44
184	002424	贵州百灵	601,899.94	5.43

185	002327	富安娜	600,573.00	5.42
186	600201	生物股份	599,358.00	5.41
187	600657	信达地产	599,267.00	5.41
188	000997	新大陆	599,221.00	5.41
189	002251	步步高	597,315.20	5.39
190	000661	长春高新	596,401.00	5.38
191	601678	滨化股份	596,313.50	5.38
192	600112	天成控股	593,731.00	5.36
193	000587	金叶珠宝	593,498.00	5.36
194	600004	白云机场	592,643.00	5.35
195	600169	太原重工	591,714.00	5.34
196	600851	海欣股份	591,617.99	5.34
197	300147	香雪制药	589,788.40	5.32
198	000998	隆平高科	589,384.00	5.32
199	600161	天坛生物	588,588.00	5.31
200	000860	顺鑫农业	588,090.00	5.31
201	601126	四方股份	588,000.00	5.31
202	002479	富春环保	587,854.72	5.30
203	000596	古井贡酒	586,514.00	5.29
204	002408	齐翔腾达	586,116.00	5.29
205	600416	湘电股份	585,385.39	5.28
206	600773	西藏城投	585,242.00	5.28
207	002342	巨力索具	584,540.00	5.27
208	002273	水晶光电	584,133.00	5.27
209	600261	阳光照明	583,860.00	5.27
210	002419	天虹商场	583,714.00	5.27
211	002025	航天电器	582,844.00	5.26
212	002430	杭氧股份	582,410.00	5.26
213	600694	大商股份	581,954.00	5.25
214	000652	泰达股份	581,850.00	5.25
215	600587	新华医疗	581,657.00	5.25
216	600675	中华企业	581,230.78	5.24
217	600366	宁波韵升	580,832.00	5.24
218	600481	双良节能	580,490.00	5.24
219	600699	均胜电子	580,369.00	5.24
220	002308	威创股份	580,160.00	5.23

221	600160	巨化股份	579,367.00	5.23
222	000726	鲁泰 A	578,376.68	5.22
223	000417	合肥百货	577,746.00	5.21
224	600425	青松建化	577,334.00	5.21
225	002238	天威视讯	576,262.00	5.20
226	002672	东江环保	576,134.00	5.20
227	603366	日出东方	573,307.99	5.17
228	600536	中国软件	572,859.80	5.17
229	600132	重庆啤酒	572,705.81	5.17
230	000636	风华高科	571,974.00	5.16
231	002140	东华科技	571,628.20	5.16
232	002384	东山精密	571,162.65	5.15
233	000748	长城信息	570,806.00	5.15
234	002204	大连重工	570,595.00	5.15
235	002340	格林美	570,493.00	5.15
236	002405	四维图新	570,275.00	5.15
237	600993	马应龙	569,380.00	5.14
238	002490	山东墨龙	566,836.00	5.11
239	000550	江铃汽车	566,719.00	5.11
240	002277	友阿股份	566,414.00	5.11
241	000931	中关村	565,104.00	5.10
242	000961	中南建设	564,290.30	5.09
243	002155	湖南黄金	563,519.22	5.08
244	601717	郑煤机	563,453.00	5.08
245	600062	华润双鹤	562,371.00	5.07
246	002267	陕天然气	561,802.71	5.07
247	000969	安泰科技	559,899.00	5.05
248	002271	东方雨虹	559,753.00	5.05
249	600881	亚泰集团	559,474.85	5.05
250	600551	时代出版	559,161.00	5.05
251	600056	中国医药	558,294.00	5.04
252	002018	华信国际	558,072.26	5.04
253	002508	老板电器	557,946.00	5.03
254	000603	盛达矿业	555,957.00	5.02
255	002041	登海种业	555,302.00	5.01
256	600292	中电远达	554,093.00	5.00

257	600812	华北制药	553,086.00	4.99
258	002225	濮耐股份	552,947.00	4.99
259	600850	华东电脑	552,579.00	4.99
260	002325	洪涛股份	552,117.00	4.98
261	600801	华新水泥	551,902.00	4.98
262	002022	科华生物	551,586.12	4.98
263	600460	士兰微	551,430.00	4.98
264	601311	骆驼股份	550,807.00	4.97
265	600216	浙江医药	549,693.00	4.96
266	600563	法拉电子	549,173.00	4.96
267	002665	首航节能	548,944.50	4.95
268	000951	中国重汽	548,764.23	4.95
269	002463	沪电股份	548,266.00	4.95
270	002480	新筑股份	548,072.00	4.95
271	600422	昆药集团	547,769.85	4.94
272	000921	海信科龙	547,196.30	4.94
273	603001	奥康国际	546,808.00	4.93
274	000543	皖能电力	546,267.00	4.93
275	600654	中安消	545,883.00	4.93
276	600825	新华传媒	545,866.00	4.93
277	000919	金陵药业	545,184.00	4.92
278	601666	平煤股份	544,076.98	4.91
279	000513	丽珠集团	544,056.00	4.91
280	000979	中弘股份	543,928.00	4.91
281	600387	海越股份	541,857.00	4.89
282	601388	怡球资源	541,538.00	4.89
283	600239	云南城投	541,145.00	4.88
284	000049	德赛电池	541,108.12	4.88
285	600511	国药股份	540,195.00	4.87
286	002216	三全食品	540,158.00	4.87
287	002371	七星电子	539,686.16	4.87
288	000777	中核科技	537,786.00	4.85
289	600187	国中水务	537,262.00	4.85
290	000650	仁和药业	537,081.00	4.85
291	000422	湖北宜化	536,410.00	4.84
292	600720	祁连山	536,308.00	4.84

293	002662	京威股份	535,810.00	4.83
294	002013	中航机电	535,372.99	4.83
295	600702	沱牌舍得	533,959.00	4.82
296	300039	上海凯宝	533,774.60	4.82
297	601101	昊华能源	533,534.00	4.81
298	000823	超声电子	532,579.00	4.81
299	002551	尚荣医疗	531,962.74	4.80
300	002393	力生制药	531,347.00	4.79
301	600468	百利电气	531,290.80	4.79
302	600335	国机汽车	530,763.00	4.79
303	600509	天富能源	530,499.00	4.79
304	002275	桂林三金	529,974.26	4.78
305	600636	三爱富	529,966.00	4.78
306	002705	新宝股份	529,513.00	4.78
307	000939	凯迪生态	528,852.00	4.77
308	600488	天药股份	528,441.50	4.77
309	000088	盐田港	527,816.00	4.76
310	603005	晶方科技	527,131.00	4.76
311	000697	炼石有色	526,831.00	4.75
312	002174	游族网络	526,321.00	4.75
313	002122	天马股份	525,383.00	4.74
314	000762	西藏矿业	524,572.00	4.73
315	000973	佛塑科技	524,523.00	4.73
316	000099	中信海直	523,320.00	4.72
317	300202	聚龙股份	523,279.00	4.72
318	600971	恒源煤电	522,923.00	4.72
319	002128	露天煤业	522,639.00	4.72
320	002052	同洲电子	522,607.00	4.72
321	600761	安徽合力	522,505.44	4.71
322	600580	卧龙电气	521,819.00	4.71
323	002368	太极股份	521,229.00	4.70
324	002281	光迅科技	521,012.00	4.70
325	000511	烯碳新材	520,974.00	4.70
326	600787	中储股份	519,048.00	4.68
327	600433	冠豪高新	518,804.00	4.68
328	002299	圣农发展	517,512.60	4.67

329	600141	兴发集团	516,903.00	4.66
330	600175	美都能源	516,642.00	4.66
331	000780	平庄能源	515,741.00	4.65
332	002317	众生药业	514,629.00	4.64
333	600478	科力远	514,162.40	4.64
334	002219	恒康医疗	514,124.00	4.64
335	000685	中山公用	513,927.00	4.64
336	000525	红太阳	513,464.00	4.63
337	600755	厦门国贸	513,159.00	4.63
338	002392	北京利尔	513,090.00	4.63
339	002194	武汉凡谷	511,666.00	4.62
340	600805	悦达投资	511,549.00	4.62
341	000848	承德露露	511,277.00	4.61
342	600729	重庆百货	509,874.00	4.60
343	601515	东风股份	509,514.00	4.60
344	600517	置信电气	507,650.00	4.58
345	600162	香江控股	507,444.00	4.58
346	600811	东方集团	507,260.00	4.58
347	600389	江山股份	506,613.00	4.57
348	002320	海峡股份	506,314.00	4.57
349	600546	山煤国际	505,903.00	4.56
350	000975	银泰资源	505,450.00	4.56
351	601208	东材科技	504,858.00	4.56
352	000563	陕国投 A	504,810.00	4.55
353	600765	中航重机	504,788.00	4.55
354	000735	罗牛山	504,742.00	4.55
355	002005	德豪润达	504,543.00	4.55
356	002635	安洁科技	504,229.00	4.55
357	002092	中泰化学	503,402.42	4.54
358	600456	宝钛股份	503,396.91	4.54
359	600073	上海梅林	503,056.00	4.54
360	000887	中鼎股份	502,787.00	4.54
361	002309	中利科技	502,194.00	4.53
362	002315	焦点科技	501,067.00	4.52
363	002437	誉衡药业	500,475.00	4.52
364	601999	出版传媒	499,511.00	4.51

365	603766	隆鑫通用	498,656.00	4.50
366	300088	长信科技	497,652.00	4.49
367	000988	华工科技	497,427.00	4.49
368	600612	老凤祥	497,034.00	4.48
369	000415	渤海租赁	495,971.00	4.48
370	600816	安信信托	495,728.87	4.47
371	600300	维维股份	494,904.00	4.47
372	600997	开滦股份	493,840.00	4.46
373	600199	金种子酒	493,369.00	4.45
374	002056	横店东磁	489,558.00	4.42
375	000926	福星股份	488,516.00	4.41
376	600325	华发股份	487,613.00	4.40
377	601001	大同煤业	485,822.00	4.38
378	600418	江淮汽车	484,731.00	4.37
379	000897	津滨发展	483,917.00	4.37
380	002648	卫星石化	483,274.00	4.36
381	002233	塔牌集团	482,702.00	4.36
382	603328	依顿电子	482,520.00	4.35
383	600651	飞乐音响	482,291.00	4.35
384	600611	大众交通	481,720.00	4.35
385	600616	金枫酒业	480,368.00	4.33
386	002181	粤传媒	479,272.00	4.32
387	000927	*ST 夏利	478,682.00	4.32
388	600251	冠农股份	477,851.00	4.31
389	000788	北大医药	476,077.00	4.30
390	000933	神火股份	475,954.44	4.29
391	002118	紫鑫药业	474,366.00	4.28
392	000852	石化机械	474,142.00	4.28
393	600759	洲际油气	473,790.00	4.27
394	600392	盛和资源	473,372.99	4.27
395	000552	靖远煤电	472,361.00	4.26
396	600410	华胜天成	472,172.00	4.26
397	002428	云南锗业	471,781.00	4.26
398	600557	康缘药业	471,181.00	4.25
399	600673	东阳光科	468,801.00	4.23
400	600098	广州发展	467,729.00	4.22

401	000962	东方钽业	466,915.00	4.21
402	002714	牧原股份	465,749.00	4.20
403	601002	晋亿实业	465,013.00	4.20
404	002431	棕榈园林	464,570.12	4.19
405	600482	风帆股份	462,095.00	4.17
406	600596	新安股份	460,990.20	4.16
407	002461	珠江啤酒	457,176.00	4.13
408	002083	孚日股份	456,626.00	4.12
409	601011	宝泰隆	455,967.00	4.11
410	000712	锦龙股份	455,921.00	4.11
411	000886	海南高速	454,810.00	4.10
412	600439	瑞贝卡	453,394.00	4.09
413	000850	华茂股份	450,650.00	4.07
414	600435	北方导航	448,888.00	4.05
415	600537	亿晶光电	445,189.82	4.02
416	600312	平高电气	443,621.00	4.00
417	600401	*ST 海润	442,886.00	4.00
418	002414	高德红外	442,409.00	3.99
419	600754	锦江股份	440,385.00	3.97
420	600317	营口港	436,626.00	3.94
421	002557	洽洽食品	432,320.81	3.90
422	600844	丹化科技	431,059.00	3.89
423	600467	好当家	430,745.00	3.89
424	002574	明牌珠宝	427,095.00	3.85
425	600830	香溢融通	423,417.00	3.82
426	300134	大富科技	421,777.00	3.81
427	600110	中科英华	418,402.00	3.78
428	002505	大康牧业	417,366.00	3.77
429	002358	森源电气	412,870.00	3.73
430	600879	航天电子	411,434.00	3.71
431	600333	长春燃气	410,374.00	3.70
432	002091	江苏国泰	404,057.00	3.65
433	600197	伊力特	402,102.00	3.63
434	002069	獐子岛	400,683.30	3.62
435	600499	科达洁能	400,590.00	3.61
436	000050	深天马 A	399,114.00	3.60

437	600983	惠而浦	394,495.15	3.56
438	600740	山西焦化	389,003.00	3.51
439	600266	北京城建	380,318.00	3.43
440	600643	爱建集团	378,033.00	3.41
441	002498	汉缆股份	377,142.81	3.40
442	601608	中信重工	375,952.00	3.39
443	600432	吉恩镍业	374,503.00	3.38
444	000426	兴业矿业	373,760.00	3.37
445	002093	国脉科技	373,347.00	3.37
446	000688	建新矿业	369,703.36	3.34
447	002221	东华能源	358,458.00	3.23
448	600078	澄星股份	355,273.00	3.21
449	000519	江南红箭	348,456.00	3.14
450	603369	今世缘	343,487.00	3.10
451	600490	鹏欣资源	340,442.26	3.07
452	600584	长电科技	328,185.00	2.96
453	002698	博实股份	324,621.00	2.93
454	601099	太平洋	323,430.00	2.92
455	600176	中国巨石	317,066.00	2.86
456	601233	桐昆股份	316,656.00	2.86
457	002249	大洋电机	314,881.00	2.84
458	000616	海航投资	308,637.00	2.78
459	000693	华泽钴镍	307,986.76	2.78
460	600086	东方金钰	307,018.00	2.77
461	600664	哈药股份	302,063.00	2.73
462	600614	鼎立股份	295,609.00	2.67
463	300072	三聚环保	295,108.00	2.66
464	600970	中材国际	294,163.00	2.65
465	000062	深圳华强	284,726.00	2.57
466	600280	中央商场	284,407.00	2.57
467	600006	东风汽车	283,012.00	2.55
468	002681	奋达科技	276,602.00	2.50
469	002390	信邦制药	274,250.00	2.47
470	000809	铁岭新城	274,160.00	2.47
471	002161	远望谷	271,722.00	2.45
472	600617	国新能源	271,583.00	2.45

473	600628	新世界	270,142.80	2.44
474	600487	亨通光电	269,588.00	2.43
475	601777	力帆股份	264,637.00	2.39
476	600522	中天科技	263,148.00	2.37
477	002240	威华股份	262,457.00	2.37
478	600058	五矿发展	255,473.00	2.31
479	000719	大地传媒	255,031.34	2.30
480	600655	豫园商城	253,256.00	2.29
481	002466	天齐锂业	250,925.00	2.26
482	000600	建投能源	250,059.00	2.26
483	600500	中化国际	249,416.00	2.25
484	603169	兰石重装	248,592.00	2.24
485	300291	华录百纳	247,855.00	2.24
486	600747	大连控股	243,189.00	2.19
487	603899	晨光文具	242,748.00	2.19
488	300267	尔康制药	241,984.00	2.18
489	002143	印纪传媒	241,573.00	2.18
490	300043	互动娱乐	241,521.00	2.18
491	000582	北部湾港	241,359.00	2.18
492	600403	大有能源	240,561.00	2.17
493	603699	纽威股份	238,891.10	2.16
494	600572	康恩贝	238,623.00	2.15
495	002049	同方国芯	238,001.00	2.15
496	002190	成飞集成	234,107.00	2.11
497	000547	航天发展	232,201.00	2.10
498	000869	张裕 A	231,634.00	2.09
499	600917	重庆燃气	231,195.00	2.09
500	002477	雏鹰农牧	230,032.00	2.08
501	603188	亚邦股份	229,514.00	2.07
502	000401	冀东水泥	229,302.00	2.07
503	601226	华电重工	226,323.00	2.04
504	600079	人福医药	225,817.00	2.04
505	600797	浙大网新	224,947.00	2.03
506	600260	凯乐科技	224,160.91	2.02
507	600143	金发科技	222,803.42	2.01
508	002612	朗姿股份	222,714.00	2.01

509	603698	航天工程	222,154.00	2.00
510	600267	海正药业	222,088.00	2.00

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。

8.4.2 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	601519	大智慧	1,708,048.00	15.41
2	600026	中海发展	1,250,500.10	11.28
3	600021	上海电力	1,237,016.94	11.16
4	601010	文峰股份	1,233,470.00	11.13
5	300059	东方财富	1,222,443.00	11.03
6	002183	怡亚通	1,118,144.00	10.09
7	300168	万达信息	1,098,581.00	9.91
8	601012	隆基股份	1,085,920.00	9.80
9	000540	中天城投	991,804.54	8.95
10	000566	海南海药	973,852.00	8.79
11	600380	健康元	962,937.00	8.69
12	600528	中铁二局	860,920.00	7.77
13	300144	宋城演艺	848,077.28	7.65
14	002276	万马股份	840,544.90	7.58
15	002489	浙江永强	836,351.80	7.55
16	603555	贵人鸟	828,732.99	7.48
17	000718	苏宁环球	827,079.00	7.46
18	600895	张江高科	815,227.00	7.36
19	300253	卫宁软件	814,249.20	7.35
20	600219	南山铝业	810,520.00	7.31
21	600737	中粮屯河	810,201.90	7.31
22	000930	中粮生化	805,620.00	7.27
23	601718	际华集团	786,728.00	7.10
24	600180	瑞茂通	783,081.00	7.07
25	600240	华业资本	768,149.00	6.93
26	600122	宏图高科	765,861.00	6.91
27	600820	隧道股份	765,715.00	6.91
28	600428	中远航运	751,065.40	6.78
29	600037	歌华有线	749,101.00	6.76

30	000066	长城电脑	737,929.64	6.66
31	000078	海王生物	737,400.00	6.65
32	600869	智慧能源	733,844.84	6.62
33	001696	宗申动力	726,875.83	6.56
34	002293	罗莱生活	726,257.00	6.55
35	000732	泰禾集团	726,166.00	6.55
36	000031	中粮地产	725,338.15	6.54
37	000829	天音控股	724,373.00	6.54
38	002004	华邦健康	717,717.00	6.48
39	600704	物产中大	714,112.00	6.44
40	002285	世联行	713,182.92	6.43
41	601872	招商轮船	711,240.00	6.42
42	002595	豪迈科技	694,699.73	6.27
43	600582	天地科技	693,917.42	6.26
44	002244	滨江集团	693,816.00	6.26
45	002123	荣信股份	690,318.00	6.23
46	600978	宜华木业	688,834.00	6.22
47	002332	仙琚制药	687,009.56	6.20
48	600601	方正科技	683,442.00	6.17
49	002308	威创股份	677,178.60	6.11
50	600510	黑牡丹	676,638.50	6.11
51	002191	劲嘉股份	674,043.00	6.08
52	000690	宝新能源	673,404.00	6.08
53	600064	南京高科	672,070.00	6.06
54	000667	美好集团	672,057.00	6.06
55	002266	浙富控股	671,539.00	6.06
56	600507	方大特钢	669,816.81	6.04
57	002311	海大集团	669,130.68	6.04
58	002242	九阳股份	668,513.00	6.03
59	600220	江苏阳光	666,185.00	6.01
60	600200	江苏吴中	659,060.00	5.95
61	002690	美亚光电	658,648.22	5.94
62	002269	美邦服饰	658,013.00	5.94
63	300115	长盈精密	654,013.10	5.90
64	600736	苏州高新	651,227.00	5.88
65	002663	普邦园林	648,672.00	5.85
66	600635	大众公用	646,331.00	5.83
67	000418	小天鹅 A	645,714.62	5.83

68	600743	华远地产	643,960.00	5.81
69	600171	上海贝岭	638,440.00	5.76
70	000977	浪潮信息	637,869.00	5.76
71	002588	史丹利	630,841.00	5.69
72	000006	深振业 A	629,193.00	5.68
73	600654	中安消	628,104.00	5.67
74	600750	江中药业	627,684.00	5.66
75	601801	皖新传媒	627,144.92	5.66
76	000703	恒逸石化	624,093.00	5.63
77	002701	奥瑞金	624,017.20	5.63
78	000012	南玻 A	622,271.00	5.61
79	002273	水晶光电	620,446.00	5.60
80	002030	达安基因	620,415.00	5.60
81	000681	视觉中国	619,073.00	5.59
82	002063	远光软件	618,981.00	5.58
83	600831	广电网络	612,809.00	5.53
84	600835	上海机电	612,790.00	5.53
85	600545	新疆城建	611,539.00	5.52
86	601880	大连港	609,446.00	5.50
87	600289	亿阳信通	609,277.00	5.50
88	600496	精工钢构	608,998.00	5.49
89	600458	时代新材	608,981.46	5.49
90	600885	宏发股份	606,243.27	5.47
91	000631	顺发恒业	605,098.96	5.46
92	600158	中体产业	601,360.00	5.43
93	600017	日照港	600,493.00	5.42
94	000021	深科技	599,274.00	5.41
95	002384	东山精密	598,885.75	5.40
96	002223	鱼跃医疗	598,003.00	5.40
97	002396	星网锐捷	596,628.80	5.38
98	002238	天威视讯	596,152.00	5.38
99	002226	江南化工	594,737.00	5.37
100	600525	长园集团	594,590.72	5.36
101	600270	外运发展	593,990.40	5.36
102	000488	晨鸣纸业	593,872.00	5.36
103	000680	山推股份	593,277.65	5.35
104	002424	贵州百灵	589,075.00	5.32
105	002482	广田股份	587,940.00	5.30

106	600521	华海药业	587,664.00	5.30
107	002678	珠江钢琴	587,646.00	5.30
108	600298	安琪酵母	587,179.00	5.30
109	600160	巨化股份	586,548.00	5.29
110	601388	怡球资源	586,093.00	5.29
111	002237	恒邦股份	585,934.00	5.29
112	600894	广日股份	584,431.17	5.27
113	002064	华峰氨纶	584,424.00	5.27
114	000816	智慧农业	583,094.00	5.26
115	600198	大唐电信	582,290.00	5.25
116	002573	清新环境	582,284.00	5.25
117	002327	富安娜	582,274.00	5.25
118	600586	金晶科技	579,822.00	5.23
119	603077	和邦生物	578,885.00	5.22
120	002320	海峡股份	578,388.92	5.22
121	000830	鲁西化工	577,589.00	5.21
122	002250	联化科技	576,809.00	5.20
123	600823	世茂股份	576,766.00	5.20
124	600481	双良节能	576,727.20	5.20
125	600201	生物股份	576,437.65	5.20
126	000030	富奥股份	576,072.00	5.20
127	600639	浦东金桥	573,588.00	5.18
128	600376	首开股份	572,622.00	5.17
129	002029	七匹狼	571,668.00	5.16
130	600826	兰生股份	570,628.00	5.15
131	600618	氯碱化工	569,778.67	5.14
132	600426	华鲁恒升	568,772.17	5.13
133	002503	搜于特	567,814.00	5.12
134	002444	巨星科技	567,462.00	5.12
135	600429	三元股份	564,465.80	5.09
136	002179	中航光电	563,793.00	5.09
137	600337	美克家居	562,824.00	5.08
138	002368	太极股份	562,796.00	5.08
139	601908	京运通	562,715.00	5.08
140	000656	金科股份	562,219.00	5.07
141	600088	中视传媒	560,686.00	5.06
142	000090	天健集团	560,667.00	5.06
143	000758	中色股份	559,607.00	5.05

144	000620	新华联	558,440.51	5.04
145	600320	振华重工	557,108.00	5.03
146	600239	云南城投	557,035.00	5.03
147	600184	光电股份	554,218.00	5.00
148	600183	生益科技	554,151.00	5.00
149	600169	太原重工	553,456.00	4.99
150	000541	佛山照明	553,407.00	4.99
151	002508	老板电器	553,231.00	4.99
152	002052	同洲电子	552,550.00	4.99
153	600685	中船防务	552,008.00	4.98
154	600161	天坛生物	551,519.00	4.98
155	600409	三友化工	551,253.00	4.97
156	002325	洪涛股份	550,644.00	4.97
157	600770	综艺股份	549,323.00	4.96
158	600261	阳光照明	548,550.50	4.95
159	002251	步步高	548,033.00	4.94
160	300147	香雪制药	546,847.48	4.93
161	002048	宁波华翔	546,604.99	4.93
162	002078	太阳纸业	546,532.00	4.93
163	600675	中华企业	546,505.00	4.93
164	600329	中新药业	546,221.00	4.93
165	002440	闰土股份	546,149.00	4.93
166	600803	新奥股份	545,449.00	4.92
167	000587	金叶珠宝	545,359.00	4.92
168	600874	创业环保	545,002.00	4.92
169	600125	铁龙物流	544,765.00	4.92
170	300039	上海凯宝	544,474.00	4.91
171	300273	和佳股份	544,058.20	4.91
172	600640	号百控股	543,690.00	4.91
173	600138	中青旅	543,132.00	4.90
174	000028	国药一致	541,462.00	4.89
175	600067	冠城大通	540,544.00	4.88
176	600397	安源煤业	539,924.00	4.87
177	600864	哈投股份	539,667.00	4.87
178	002480	新筑股份	538,854.00	4.86
179	000900	现代投资	537,718.23	4.85
180	000861	海印股份	537,487.00	4.85
181	002028	思源电气	536,909.47	4.84

182	600993	马应龙	536,833.00	4.84
183	002254	泰和新材	536,285.40	4.84
184	000997	新大陆	536,199.00	4.84
185	002479	富春环保	536,057.30	4.84
186	600790	轻纺城	535,612.00	4.83
187	002405	四维图新	534,572.00	4.82
188	600120	浙江东方	534,078.00	4.82
189	600776	东方通信	533,508.00	4.81
190	601126	四方股份	533,398.00	4.81
191	002011	盾安环境	533,263.00	4.81
192	000572	海马汽车	533,227.00	4.81
193	000501	鄂武商 A	533,137.02	4.81
194	600059	古越龙山	532,705.99	4.81
195	002050	三花股份	531,605.00	4.80
196	002073	软控股份	530,607.00	4.79
197	600773	西藏城投	530,536.71	4.79
198	600351	亚宝药业	530,160.00	4.78
199	600284	浦东建设	529,804.00	4.78
200	000998	隆平高科	529,501.00	4.78
201	000671	阳光城	529,386.00	4.78
202	601965	中国汽研	528,879.00	4.77
203	600748	上实发展	528,840.00	4.77
204	601886	江河创建	527,556.48	4.76
205	002168	深圳惠程	527,333.00	4.76
206	600416	湘电股份	527,321.00	4.76
207	601369	陕鼓动力	526,905.00	4.75
208	600699	均胜电子	526,233.00	4.75
209	600195	中牧股份	525,622.00	4.74
210	600004	白云机场	525,532.00	4.74
211	002672	东江环保	525,501.00	4.74
212	002646	青青稞酒	524,553.00	4.73
213	600132	重庆啤酒	524,502.00	4.73
214	600859	王府井	523,762.83	4.73
215	603001	奥康国际	523,702.00	4.73
216	000877	天山股份	523,421.00	4.72
217	002025	航天电器	523,307.00	4.72
218	600439	瑞贝卡	523,066.00	4.72
219	000417	合肥百货	522,598.00	4.72

220	000636	风华高科	519,826.00	4.69
221	601678	滨化股份	518,984.00	4.68
222	600757	长江传媒	515,229.00	4.65
223	000931	中关村	515,085.00	4.65
224	600536	中国软件	514,926.60	4.65
225	600482	风帆股份	514,811.00	4.65
226	600780	通宝能源	514,440.00	4.64
227	000650	仁和药业	513,317.00	4.63
228	603366	日出东方	512,490.00	4.62
229	601311	骆驼股份	512,457.32	4.62
230	000513	丽珠集团	512,297.00	4.62
231	600616	金枫酒业	511,734.00	4.62
232	000979	中弘股份	510,823.60	4.61
233	600112	天成控股	510,679.00	4.61
234	600851	海欣股份	510,292.00	4.60
235	000726	鲁泰A	508,791.00	4.59
236	600657	信达地产	508,419.00	4.59
237	002216	三全食品	507,158.60	4.58
238	600039	四川路桥	505,794.00	4.56
239	600366	宁波韵升	505,296.50	4.56
240	002490	山东墨龙	504,030.94	4.55
241	000661	长春高新	502,934.76	4.54
242	000748	长城信息	502,862.20	4.54
243	600580	卧龙电气	502,352.00	4.53
244	600850	华东电脑	502,031.55	4.53
245	000887	中鼎股份	501,592.00	4.53
246	002267	陕天然气	500,613.00	4.52
247	002083	孚日股份	499,574.00	4.51
248	002140	东华科技	499,256.00	4.50
249	000969	安泰科技	498,706.00	4.50
250	002392	北京利尔	498,661.00	4.50
251	000049	德赛电池	498,183.00	4.50
252	002022	科华生物	497,456.00	4.49
253	600612	老凤祥	496,637.00	4.48
254	002225	濮耐股份	495,898.00	4.47
255	600387	海越股份	494,397.00	4.46
256	600335	国机汽车	493,657.00	4.45
257	002340	格林美	493,608.00	4.45

258	600422	昆药集团	493,476.00	4.45
259	000961	中南建设	493,431.40	4.45
260	600551	时代出版	493,178.00	4.45
261	000596	古井贡酒	493,143.97	4.45
262	000528	柳 工	492,817.23	4.45
263	600587	新华医疗	492,769.76	4.45
264	600162	香江控股	491,864.00	4.44
265	600073	上海梅林	491,500.00	4.43
266	601000	唐山港	490,846.00	4.43
267	600825	新华传媒	489,933.00	4.42
268	000886	海南高速	489,730.00	4.42
269	600098	广州发展	489,729.00	4.42
270	600563	法拉电子	489,424.00	4.42
271	000973	佛塑科技	487,988.00	4.40
272	600702	沱牌舍得	487,841.00	4.40
273	002430	杭氧股份	487,345.99	4.40
274	000511	烯碳新材	486,852.00	4.39
275	000860	顺鑫农业	486,765.00	4.39
276	600694	大商股份	486,519.35	4.39
277	000422	湖北宜化	485,752.00	4.38
278	002393	力生制药	485,177.00	4.38
279	002018	华信国际	484,044.00	4.37
280	000603	盛达矿业	483,314.00	4.36
281	600062	华润双鹤	483,196.51	4.36
282	002271	东方雨虹	482,732.24	4.36
283	002041	登海种业	482,051.98	4.35
284	600511	国药股份	481,893.00	4.35
285	002419	天虹商场	481,227.00	4.34
286	600460	士兰微	481,017.00	4.34
287	600401	*ST 海润	480,648.00	4.34
288	002275	桂林三金	479,459.00	4.33
289	600478	科力远	479,377.00	4.33
290	600425	青松建化	479,284.00	4.32
291	002705	新宝股份	478,792.99	4.32
292	002342	巨力索具	477,432.00	4.31
293	601717	郑煤机	477,424.00	4.31
294	002635	安洁科技	477,390.01	4.31
295	002665	首航节能	477,314.68	4.31

296	002005	德豪润达	476,031.00	4.30
297	600812	华北制药	475,993.00	4.29
298	000927	*ST 夏利	475,270.00	4.29
299	601515	东风股份	474,210.00	4.28
300	000652	泰达股份	473,887.00	4.28
301	002277	友阿股份	473,595.00	4.27
302	600881	亚泰集团	472,536.00	4.26
303	002155	湖南黄金	472,457.00	4.26
304	000921	海信科龙	472,407.90	4.26
305	000762	西藏矿业	471,756.00	4.26
306	000777	中核科技	471,753.00	4.26
307	000939	凯迪生态	471,239.00	4.25
308	600488	天药股份	470,009.00	4.24
309	000988	华工科技	469,662.00	4.24
310	600636	三爱富	469,576.20	4.24
311	002714	牧原股份	469,048.00	4.23
312	002317	众生药业	467,941.00	4.22
313	600292	中电远达	467,739.06	4.22
314	600216	浙江医药	467,651.00	4.22
315	600151	航天机电	467,527.00	4.22
316	002174	游族网络	467,188.00	4.22
317	002408	齐翔腾达	466,205.31	4.21
318	002194	武汉凡谷	466,076.00	4.21
319	600816	安信信托	465,315.30	4.20
320	000543	皖能电力	464,597.00	4.19
321	600468	百利电气	464,546.09	4.19
322	601011	宝泰隆	463,706.70	4.18
323	600056	中国医药	462,879.00	4.18
324	000919	金陵药业	461,993.52	4.17
325	002662	京威股份	461,896.76	4.17
326	002092	中泰化学	461,599.00	4.16
327	600801	华新水泥	461,431.82	4.16
328	600392	盛和资源	460,621.30	4.16
329	002463	沪电股份	460,163.00	4.15
330	002122	天马股份	459,369.00	4.14
331	600754	锦江股份	459,166.00	4.14
332	000550	江铃汽车	458,856.87	4.14
333	002013	中航机电	458,688.00	4.14

334	601666	平煤股份	458,461.00	4.14
335	600651	飞乐音响	457,178.70	4.13
336	600765	中航重机	456,807.00	4.12
337	300088	长信科技	456,727.00	4.12
338	600467	好当家	456,319.00	4.12
339	600433	冠豪高新	455,947.28	4.11
340	000823	超声电子	454,810.00	4.10
341	002299	圣农发展	454,766.29	4.10
342	002281	光迅科技	454,547.42	4.10
343	002118	紫鑫药业	453,931.00	4.10
344	600251	冠农股份	453,685.00	4.09
345	000951	中国重汽	453,579.87	4.09
346	600300	维维股份	453,425.00	4.09
347	002315	焦点科技	452,690.00	4.08
348	002371	七星电子	452,662.00	4.08
349	000415	渤海租赁	452,613.00	4.08
350	600720	祁连山	451,153.00	4.07
351	002437	誉衡药业	450,688.00	4.07
352	002204	大连重工	450,354.00	4.06
353	000099	中信海直	449,963.00	4.06
354	601208	东材科技	449,625.96	4.06
355	002551	尚荣医疗	449,590.00	4.06
356	603005	晶方科技	449,242.00	4.05
357	600389	江山股份	449,181.98	4.05
358	000780	平庄能源	448,731.50	4.05
359	600509	天富能源	448,317.00	4.05
360	600761	安徽合力	446,666.98	4.03
361	601101	昊华能源	446,567.72	4.03
362	600611	大众交通	445,745.00	4.02
363	600844	丹化科技	445,059.00	4.02
364	000685	中山公用	444,417.98	4.01
365	600141	兴发集团	443,959.00	4.01
366	000697	炼石有色	443,884.00	4.01
367	000848	承德露露	443,604.00	4.00
368	000712	锦龙股份	442,216.00	3.99
369	002431	棕榈园林	441,755.00	3.99
370	600456	宝钛股份	439,879.00	3.97
371	600805	悦达投资	439,196.00	3.96

372	603766	隆鑫通用	438,417.00	3.96
373	600187	国中水务	438,359.00	3.96
374	002574	明牌珠宝	437,997.00	3.95
375	601999	出版传媒	436,778.96	3.94
376	300202	聚龙股份	436,511.00	3.94
377	600517	置信电气	435,692.00	3.93
378	600110	中科英华	434,356.00	3.92
379	000735	罗牛山	434,102.00	3.92
380	600175	美都能源	433,233.00	3.91
381	603328	依顿电子	432,921.00	3.91
382	600787	中储股份	431,424.00	3.89
383	600811	东方集团	431,099.00	3.89
384	000525	红太阳	430,009.15	3.88
385	300134	大富科技	429,576.00	3.88
386	600317	营口港	428,382.00	3.87
387	000926	福星股份	427,757.00	3.86
388	000088	盐田港	427,319.00	3.86
389	002056	横店东磁	427,081.00	3.85
390	002498	汉缆股份	425,948.50	3.84
391	600333	长春燃气	425,414.22	3.84
392	002128	露天煤业	424,913.00	3.83
393	600557	康缘药业	423,899.00	3.82
394	600199	金种子酒	423,725.00	3.82
395	002233	塔牌集团	423,134.00	3.82
396	600830	香溢融通	422,255.00	3.81
397	600673	东阳光科	422,111.00	3.81
398	002091	江苏国泰	421,738.70	3.81
399	002181	粤传媒	420,007.00	3.79
400	600546	山煤国际	418,882.00	3.78
401	002309	中利科技	418,737.00	3.78
402	600971	恒源煤电	416,621.90	3.76
403	600418	江淮汽车	414,917.99	3.74
404	600759	洲际油气	413,460.00	3.73
405	000962	东方钨业	413,059.00	3.73
406	000852	石化机械	411,969.00	3.72
407	002505	大康牧业	410,534.00	3.70
408	600312	平高电气	410,447.78	3.70
409	000850	华茂股份	407,321.00	3.68

410	002219	恒康医疗	406,627.32	3.67
411	002557	洽洽食品	406,405.50	3.67
412	600197	伊力特	406,284.00	3.67
413	000552	靖远煤电	403,937.19	3.64
414	002428	云南锗业	403,447.00	3.64
415	000975	银泰资源	401,988.00	3.63
416	000050	深天马 A	401,376.00	3.62
417	600755	厦门国贸	401,127.00	3.62
418	600997	开滦股份	400,812.55	3.62
419	000688	建新矿业	400,350.00	3.61
420	002461	珠江啤酒	400,057.00	3.61
421	600740	山西焦化	399,777.00	3.61
422	000563	陕国投 A	399,533.00	3.60
423	600410	华胜天成	397,106.00	3.58
424	600325	华发股份	396,544.00	3.58
425	000933	神火股份	395,189.79	3.57
426	000788	北大医药	392,719.00	3.54
427	002648	卫星石化	392,344.00	3.54
428	600596	新安股份	390,993.00	3.53
429	601001	大同煤业	388,140.00	3.50
430	600729	重庆百货	387,701.00	3.50
431	600879	航天电子	386,292.00	3.49
432	600432	吉恩镍业	377,387.00	3.41
433	600537	亿晶光电	377,116.00	3.40
434	002069	獐子岛	374,167.00	3.38
435	000897	津滨发展	373,801.00	3.37
436	600435	北方导航	370,795.00	3.35
437	600499	科达洁能	370,422.00	3.34
438	002358	森源电气	369,211.00	3.33
439	600266	北京城建	365,255.00	3.30
440	600983	惠而浦	363,197.20	3.28
441	002414	高德红外	362,885.00	3.27
442	601002	晋亿实业	359,626.00	3.24
443	600643	爱建集团	355,811.00	3.21
444	600078	澄星股份	355,624.00	3.21
445	600490	鹏欣资源	355,467.72	3.21
446	000519	江南红箭	352,966.00	3.18
447	601099	太平洋	329,345.00	2.97

448	000426	兴业矿业	326,580.00	2.95
449	603369	今世缘	288,758.00	2.61
450	600628	新世界	278,078.00	2.51
451	000809	铁岭新城	275,665.00	2.49
452	600006	东风汽车	255,247.00	2.30
453	002249	大洋电机	241,478.00	2.18
454	002240	威华股份	239,723.00	2.16
455	002221	东华能源	236,752.00	2.14
456	000693	华泽钴镍	235,419.64	2.12
457	002698	博实股份	232,339.00	2.10
458	600086	东方金钰	226,335.00	2.04

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	291,580,469.01
卖出股票收入（成交）总额	257,608,710.95

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金于本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金于本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

贵金属不在本基金投资范围内。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金于本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金于本报告期末未持有股指期货合约。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金于本报告期末未持有股指期货合约。

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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

国债期货不在本基金投资范围内。

8.11.3 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

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

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	51,256.84
2	应收证券清算款	219,901.82
3	应收股利	-
4	应收利息	455.13
5	应收申购款	4,104.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	275,718.34

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金于本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600978	宜华木业	234,410.00	2.12	重大事项
2	000066	长城电脑	150,381.00	1.36	重大事项
3	002018	华信国际	134,728.00	1.22	重大事项
4	002219	恒康医疗	108,025.00	0.97	重大事项
5	600729	重庆百货	100,409.00	0.91	重大事项
6	000748	长城信息	92,303.20	0.83	重大事项
7	002174	游族网络	89,530.00	0.81	重大事项
8	000426	兴业矿业	31,064.00	0.28	重大事项
9	002049	同方国芯	30,075.00	0.27	重大事项

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	205	10,576.27	1,532,705.00	70.69%	635,431.00	29.31%

500 等权重指数 分级 A						
西部利得中证 500 等权重指数 分级 B	834	2,599.68	75,819.00	3.50%	2,092,317.00	96.50%
西部利得中证 500 等权重指数 分级	662	7,921.67	975,204.00	18.60%	4,268,944.73	81.40%
合计	1,553	6,168.98	2,583,728.00	26.97%	6,996,692.73	73.03%

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 期末上市基金前十名持有人

西部利得中证 500 等权重指数分级 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	银河资本—光大银行—银河资本—青昀 5 号资产管理计划	1,210,401.00	55.83%
2	银河资本—光大银行—银河资本—昊沣 2 号资产管理计划	200,000.00	9.22%
3	陈鹤辉	126,100.00	5.82%
4	董景秋	92,477.00	4.27%
5	陈立	80,500.00	3.71%
6	洪飞展	52,929.00	2.44%
7	银河资本—邮储银行—青昀套利 3 号资产管理计划	40,000.00	1.84%
8	德邦创新资本—上海银行—德邦创新资本·泓信安盈三期专项资产管理	36,196.00	1.67%
9	游惟龙	29,800.00	1.37%
10	向顺波	23,400.00	1.08%

西部利得中证 500 等权重指数分级 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	李晔辉	135,350.00	6.24%
2	欧才	79,294.00	3.66%
3	银河资本—邮储银行—青昀套利 3 号资产管理计划	60,000.00	2.77%
4	葛加水	50,196.00	2.32%
5	李秀莲	48,672.00	2.24%
6	张国红	43,900.00	2.02%
7	巫剑飞	42,828.00	1.98%
8	陈超勤	37,656.00	1.74%
9	戈世华	34,833.00	1.61%
10	林玉琴	34,070.00	1.57%

9.3 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	西部利得中证 500 等权重指数分级 A	0.00	0.00%
	西部利得中证 500 等权重指数分级 B	0.00	0.00%
	西部利得中证 500 等权重指数分级	0.00	0.00%
	合计	0.00	0.00%

9.4 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的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	西部利得中证 500 等权重指数分级 A	0
	西部利得中证 500 等权重指数分级 B	0
	西部利得中证 500 等权重指数分级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	西部利得中证 500 等权重指数分级 A	0
	西部利得中证 500 等权重指数分级 B	0
	西部利得中证 500 等权重指数分级	0

	合计	0
--	----	---

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	西部利得中证 500 等权重指数分 级 A	西部利得中证 500 等权重指数 分级 B	西部利得中证 500 等权重指数 分级
基金合同生效日（2015 年 4 月 15 日）基金份额总额	0.00	0.00	202,990,676.07
本报告期期初基金份额总额	-	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	0.00	0.00	454,716,537.12
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	0.00	0.00	603,683,351.69
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	2,168,136.00	2,168,136.00	-48,779,712.77
本报告期期末基金份额总额	2,168,136.00	2,168,136.00	5,244,148.73

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及份额折算的份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开本基金份额持有人大会，无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人重大人事变动如下：

（1）根据基金管理人一届十六次会议董事会决议，自 2015 年 11 月 16 日起，贺燕萍女士担任本基金管理人总经理职务，同时，董事长安保和先生不再代为履行总经理职责。

（2）根据基金管理人一届三次股东会决议，自 2015 年 9 月 10 日起，贺燕萍女士担任本基金管理人董事职务。

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：

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、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

本基金聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金进行审计。本报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期应支付普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费人民币 40,000 元。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)自本基金成立以来一直提供审计服务,截至报告期末连续服务期未满 1 年。

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

本报告期内基金管理人、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	
申万宏源	2	549,189,179.96	100%	501,706.70	100.00%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申万宏源	-	-	2,074,900,000.00	100.00%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-

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旗下开放式基金 2014 年 12 月 31 日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 1 月 5 日
2	关于西部利得基金旗下基金持有的停牌股票调整估值价格的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 2 月 28 日
3	关于西部利得基金旗下基金持有的停牌股票调整估值价格的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 3 月 3 日
4	西部利得基金管理有限公司关于旗下证券投资基金参加齐鲁证券基金申购优惠费率活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 3 月 13 日
5	西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同（摘要）	证券日报、公司网站	2015 年 3 月 24 日
6	西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金份额发售公告	证券日报、公司网站	2015 年 3 月 24 日
7	西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金招募说明书	证券日报、公司网站	2015 年 3 月 24 日
8	西部利得基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 4 月 1 日
9	关于西部利得基金旗下基金持有的停牌股票调整估值价格的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 4 月 2 日
10	关于西部利得基金旗下基金	中国证券报、证券时	2015 年 4 月 3 日

	持有的停牌股票调整估值价格的公告	报、上海证券报、证券日报、公司网站	
11	西部利得基金管理有限公司关于西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金提前结束募集的公告	证券日报、公司网站	2015 年 4 月 8 日
12	西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金经理变更公告	证券日报、公司网站	2015 年 4 月 10 日
13	西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同生效公告	证券日报、公司网站	2015 年 4 月 16 日
14	关于西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	证券日报、公司网站	2015 年 4 月 22 日
15	关于西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金开通份额配对转换业务的公告	证券日报、公司网站	2015 年 4 月 22 日
16	关于西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金开通跨系统转托管业务的公告	证券日报、公司网站	2015 年 4 月 22 日
17	西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金之西部利得中证 500 等权重份额、西部利得中证 500 等权重 A 份额及西部利得中证 500 等权重 B 份额上市交易公告书	证券日报、公司网站	2015 年 4 月 22 日
18	西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金份额上市交易提示性公告	证券日报、公司网站	2015 年 4 月 27 日
19	关于西部利得基金旗下基金持有的停牌股票调整估值价格的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 5 月 6 日
20	关于西部利得基金旗下基金持有的停牌股票调整估值价格的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 5 月 19 日
21	关于西部利得基金管理有限公司旗下证券投资基金参与天天基金费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 5 月 27 日
22	关于西部利得基金旗下基金持有的停牌股票调整估值价格的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 6 月 9 日
23	关于西部利得基金管理有限	中国证券报、证券时	2015 年 6 月 30 日

	公司办公地址变更的公告	报、上海证券报、证券日报、公司网站	
24	关于西部利得基金旗下基金持有的停牌股票调整估值价格的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 7 月 1 日
25	关于西部利得基金旗下基金持有的停牌股票调整估值价格的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 7 月 7 日
26	关于西部利得基金旗下基金持有的停牌股票调整估值价格的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 7 月 9 日
27	关于西部利得基金旗下基金持有的停牌股票调整估值价格的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 7 月 10 日
28	关于西部利得基金旗下基金持有的停牌股票调整估值价格的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 7 月 11 日
29	西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金 2015 年第 2 季度报告	证券日报、公司网站	2015 年 7 月 17 日
30	关于西部利得基金旗下基金持有的停牌股票调整估值价格的公告	中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 7 月 29 日
31	西部利得中证 500 等权重指数分级基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	证券日报、公司网站	2015 年 7 月 29 日
32	西部利得基金管理有限公司新增联泰资产为代销机构并开通定投、转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 8 月 5 日
33	西部利得基金管理有限公司关于旗下证券投资基金参与数米基金费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 8 月 14 日
34	西部利得中证 500 等权重指数分级基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	证券日报、公司网站	2015 年 8 月 24 日
35	西部利得基金管理有限公司关于参加天天基金网费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 8 月 25 日
36	西部利得中证 500 等权重指数分级基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	证券日报、公司网站	2015 年 8 月 25 日
37	西部利得中证 500 等权重指	证券日报、公司网站	2015 年 8 月 25 日

	数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告		
38	西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金 2015 年半年度报告（摘要）	证券日报、公司网站	2015 年 8 月 25 日
39	西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务期间暂停申购、赎回业务的公告	证券日报、公司网站	2015 年 8 月 26 日
40	关于办理不定期份额折算期间西部利得中证 500 等权重 B 份额停牌公告	证券日报、公司网站	2015 年 8 月 26 日
41	西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金不定期份额折算公告	证券日报、公司网站	2015 年 8 月 26 日
42	西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务期间西部利得中证 500 等权重份额、西部利得中证 500 等权重 A 份额和西部利得中证 500 等权重 B 份额停牌公告	证券日报、公司网站	2015 年 8 月 27 日
43	关于西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金参加数米基金费率优惠活动公告	证券日报、公司网站	2015 年 8 月 27 日
44	西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金不定期份额折算前收盘价调整的公告	证券日报、公司网站	2015 年 8 月 28 日
45	西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复交易的公告	证券日报、公司网站	2015 年 8 月 28 日
46	关于西部利得基金旗下基金持有的停牌股票调整估值价格的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 9 月 2 日
47	关于西部利得基金旗下基金持有的停牌股票调整估值价格的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 9 月 7 日
48	关于西部利得基金旗下基金持有的停牌股票调整估值价格的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 9 月 8 日
49	关于西部利得基金旗下基金	中国证券报、证券时	2015 年 9 月 9 日

	持有的停牌股票调整估值价格的公告	报、上海证券报、证券日报、公司网站	
50	关于西部利得基金旗下基金持有的停牌股票调整估值价格的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 9 月 12 日
51	关于西部利得基金旗下基金持有的停牌股票调整估值价格的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 9 月 16 日
52	西部利得基金管理有限公司关于参加好买基金费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 9 月 28 日
53	西部利得基金管理有限公司关于调整旗下西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金场内申购费率的公告	证券时报、公司网站	2015 年 9 月 28 日
54	西部利得基金管理有限公司关于变更公司住所的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 10 月 17 日
55	西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金 2015 年第三季度报告	证券日报、公司网站	2015 年 10 月 18 日
56	西部利得基金管理有限公司关于总经理变更的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 10 月 28 日
57	西部利得基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金参与光大证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 10 月 29 日
58	西部利得基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金参与利得基金费率优惠活动的公告	证券时报、上海证券报、公司网站	2015 年 10 月 30 日
59	西部利得基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金参与申万宏源证券有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 10 月 31 日
60	西部利得基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金参与上海长量基金销售投资顾问有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 11 月 2 日
61	西部利得基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金新增上海利得基金销售有限	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 11 月 3 日

	公司为代销机构的公告		
62	西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金更新招募说明书摘要（2015 年第 1 期）	证券日报、公司网站	2015 年 11 月 4 日
63	西部利得基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金参与西部证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 11 月 5 日
64	西部利得基金管理有限公司关于新增上海陆金所资产管理有限公司为代销机构并开通申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 11 月 11 日
65	关于西部利得基金旗下基金持有的停牌股票调整估值价格的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 11 月 12 日
66	关于西部利得基金旗下基金持有的停牌股票调整估值价格的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 11 月 13 日
67	西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间暂停申购、赎回等业务的公告	证券日报、公司网站	2015 年 11 月 16 日
68	西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金定期份额折算的公告	证券日报、公司网站	2015 年 11 月 17 日
69	西部利得基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金参与农业银行定投费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 11 月 18 日
70	西部利得基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金参与深圳众禄费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 11 月 19 日
71	西部利得基金管理有限公司关于调整旗下西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金场内申购费率的公告	证券日报、公司网站	2015 年 11 月 20 日

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金设立的相关文件；
- (2) 《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同》；
- (3) 《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金托管协议》；
- (5) 基金管理人《基金管理资格证书》及《企业法人营业执照》；
- (6) 报告期内西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金公告的各项原稿。

12.2 存放地点

本基金管理人处——上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 11 楼

12.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。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
二〇一六年三月三十日