

西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资 基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：西部利得基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：二〇一六年八月二十四日

§ 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。本半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 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	63
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	63
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	64
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	64
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	64
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	64
7.12 投资组合报告附注.....	64

§8 基金份额持有人信息	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	65
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	66
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	67
8.4 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.....	67
§9 开放式基金份额变动	67
§10 重大事件揭示	68
10.1 基金份额持有人大会决议.....	68
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	68
10.4 基金投资策略的改变.....	68
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	68
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	68
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	68
10.8 其他重大事件.....	70
§11 备查文件目录	72
11.1 备查文件目录.....	72
11.2 存放地点.....	72
11.3 查阅方式.....	72

§ 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	172,300,033.13 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	167,247,961.13 份	2,526,036.00 份	2,526,036.00 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 年以内的政府债券不</p>

	<p>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 等权重指数成分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。</p> <p>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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.westleadfund.com
基金半年度报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-601,513.62
本期利润	7,228,751.55
加权平均基金份额本期利润	0.1708
本期加权平均净值利润率	18.35%
本期基金份额净值增长率	-14.89%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-144,314,992.46
期末可供分配基金份额利润	-0.8376

期末基金资产净值	167,886,092.65
期末基金份额净值	0.974
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-41.70%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	3.74%	1.23%	2.97%	1.44%	0.77%	-0.21%
过去三个月	3.92%	1.43%	0.41%	1.56%	3.51%	-0.13%
过去六个月	-14.89%	2.34%	-17.09%	2.45%	2.20%	-0.11%
过去一年	-41.76%	2.51%	-27.54%	2.80%	-14.22%	-0.29%
自基金合同生效起至今	-41.70%	2.56%	-19.95%	2.83%	-21.75%	-0.27%

注：本基金的业绩基准为：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没交易日进行计算，计算方式如下：

$benchmark(0)=1000;$

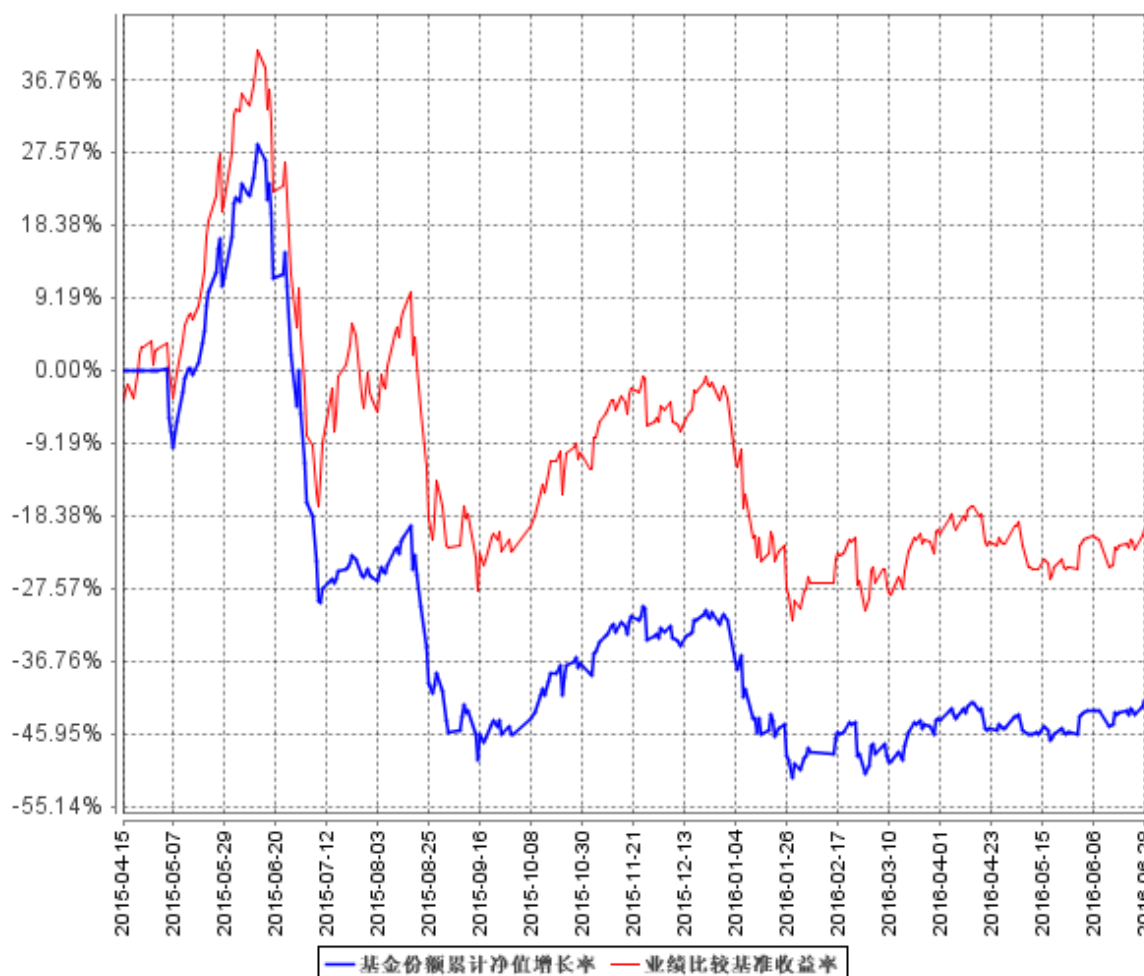
$\%benchmark(t) = 95\% * (中证 500 等权重指数收益率(t) / 中证 500 等权重指数收益率(t-1) - 1) + 5\% * 商业银行人民币活期存款利率 / 365;$

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

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：本基金建仓期为 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。

§ 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 2016 年 6 月 30 日，西部利得基金共管理九只开放式基金——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、西部利得多策略优选灵活配置混合型证券投资基金、西部利得新盈灵活配置混合型证券投资基金、西部利得行业主题优选灵活配置混合型证券投资基金和西部利得天添鑫货币市场基金。

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	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	2015 年 4 月 15 日	2016 年 5 月 5 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，曾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	2016 年 5 月 3 日	-	六年	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，现任高级研究员，具有基金从业资格，中国国籍。
曹祥	本基金基金经理助理	2015 年 12 月 14 日	2016 年 5 月 2 日	六年	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，现任高级研究员，具有基金从业资格，中国国籍。
于海松	本基金基金经理助理	2016 年 5 月 27 日	-	十九年	复旦大学理学硕士，曾担任华夏证券研究所研究员、天相投资顾问公司研究员、国元证券研究所研究员、兴业证券研究所研究员、富国基金管理有限公司产品设计员、汇添富基金管理股份有限公司产品设计员。2016 年 1 月加入本公司，

					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遵规守信情况的说明

本基金管理人旗下基金 2015 年通过申万宏源西部证券有限公司（下称“申万宏源西部”）交易单元买卖证券的年交易佣金占公司所有基金买卖证券的年交易佣金的比例超过 30%。其原因主要有：一是在部门构架及管理职责的调整过程中未及时、全面地理顺各部门之间的逻辑管控关系。二是人员配备不及时。针对此事件本基金管理人采取的整改措施有：一是适当增加其他机构的租用席位；二是对于今后在产品立项阶段增加对交易单元租用意向的配套管理措施。此外，本基金管理人逐步增加人员配备，并将进一步加强各类内部控制措施，以避免此类事件的再次发生。

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利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

当监控到疑似异常交易时，本基金管理人风险管理部及时要求相关投资组合经理给予解释，该解释经风险管理部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。

4.3.2 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。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 2016 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.974 元，本报告期份额净值增长率为-14.89%，同期业绩比较基准增长率为-17.09%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年以来经济政策进行供给侧改革，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。

2015 年下半年以来证券市场经历了三波大幅调整，预计在 2016 年宏观经济供给改革、需求托底的背景下，2016 年下半年市场运行过程相比去年将震荡幅度减小，波动平稳。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

估值委员会的成员包括投资管理部、风险管理部、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。

4.7 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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

截至本报告期初，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，本基金管理人的解决方案为：积极研究营销方案，加大营销力度。

上述方案已按《公开募集证券投资基金运作管理办法》要求向中国证监会备案并落实解决措施。

截至本报告期末，本基金基金资产净值已超过五千万元。

§ 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 托管人对本半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半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	9,636,750.86	829,281.87
结算备付金		734,233.81	1,873.48
存出保证金		37,517.54	51,256.84
交易性金融资产	6.4.7.2	158,014,560.66	10,373,589.19
其中：股票投资		158,014,560.66	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	219,901.82
应收利息	6.4.7.5	5,923.83	455.13
应收股利		-	-
应收申购款		105,548.63	4,104.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		168,534,535.33	11,480,462.88
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		104,184.20	61,085.04
应付赎回款		170,201.48	90,146.68
应付管理人报酬		101,096.38	9,679.07
应付托管费		20,219.26	1,935.81
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	107,618.26	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	6.4.7.8	145,123.10	220,339.72
负债合计		648,442.68	397,538.42
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	288,128,747.07	16,171,245.52
未分配利润	6.4.7.10	-120,242,654.42	-5,088,321.06
所有者权益合计		167,886,092.65	11,082,924.46
负债和所有者权益总计		168,534,535.33	11,480,462.88

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.974 元，基金份额总额 167,886,092.65 份。

6.2 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 4 月 15 日(基金 合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		7,793,034.56	1,421,544.12
1.利息收入		39,315.54	209,258.14
其中：存款利息收入	6.4.7.11	39,315.54	78,737.02
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）		-121,410.55	1,281,717.62
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-707,690.19	1,121,228.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益		-	-

股利收益	6.4.7.15	586,279.64	160,489.18
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	7,830,265.17	-387,351.91
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	44,864.40	317,920.27
减：二、费用		564,283.01	941,214.66
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	186,882.23	228,652.22
2. 托管费	6.4.10.2.2	37,376.44	45,730.48
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	145,402.68	624,595.29
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	194,621.66	42,236.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,228,751.55	480,329.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,228,751.55	480,329.46

6.3 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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）	16,171,245.52	-5,088,321.06	11,082,924.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,228,751.55	7,228,751.55
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）	271,957,501.55	-122,383,084.91	149,574,416.64
其中：1.基金申购款	281,833,230.31	-126,847,704.95	154,985,525.36
2.基金赎回款	-9,875,728.76	4,464,620.04	-5,411,108.72
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)	288,128,747.07	-120,242,654.42	167,886,092.65
项目	上年度可比期间 2015年4月15日(基金合同生效日)至2015年6月30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)	-	480,329.46	480,329.46
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)	-149,932,409.78	-432,629.07	-150,365,038.85
其中:1.基金申购款	102,680,914.89	1,286,229.77	103,967,144.66
2.基金赎回款	-252,613,324.67	-1,718,858.84	-254,332,183.51
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)	53,058,266.29	47,700.39	53,105,966.68

注:

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

<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

6.4 报表附注

6.4.1 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 8 月 24 日批准报出。

6.4.2 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“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”）的要求，真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况。

此外本财务报表同时符合如财务报表附注 6.4.2 所列示的其他有关规定的要求。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期内，本基金财务报告所采用的会计政策与 2015 年年度财务报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	9,636,750.86
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	9,636,750.86

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	150,372,086.74	158,014,560.66	7,642,473.92
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	150,372,086.74	158,014,560.66	7,642,473.92

6.4.7.3 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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
----	------------------------

应收活期存款利息	4,676.67
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	330.40
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	899.96
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	16.80
合计	5,923.83

6.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	107,618.26
银行间市场应付交易费用	-
合计	107,618.26

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	641.44
预提费用	94,481.66
应付指数使用费	50,000.00
合计	145,123.10

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	9,580,420.73	16,171,245.52
本期申购	13,124.30	22,156.36
本期赎回(以“-”号填列)	-51,827.27	-87,494.51
2016年1月4日 基金拆分/份额折算前	9,541,717.76	16,105,907.37
基金拆分/份额折算变动份额	88,737.40	-

本期申购	168,522,236.19	281,811,073.95
本期赎回(以“-”号填列)	-5,852,658.22	-9,788,234.25
本期末	172,300,033.13	288,128,747.07

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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
上年度末	-7,337,868.58	2,249,547.52	-5,088,321.06
本期利润	-601,513.62	7,830,265.17	7,228,751.55
本期基金份额交易产生的变动数	-136,375,610.26	13,992,525.35	-122,383,084.91
其中：基金申购款	-141,181,500.31	14,333,795.36	-126,847,704.95
基金赎回款	4,805,890.05	-341,270.01	4,464,620.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-144,314,992.46	24,072,338.04	-120,242,654.42

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	31,323.79
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,046.90
其他	6,944.85
合计	39,315.54

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	19,907,331.39
减：卖出股票成本总额	20,615,021.58
买卖股票差价收入	-707,690.19

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 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。

6.4.7.13.2 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末未持有债券，债券投资收益为零。

6.4.7.13.3 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。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

贵金属不在本基金投资范围内。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	586,279.64
基金投资产生的股利收益	-
合计	586,279.64

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	7,830,265.17
——股票投资	7,830,265.17
——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	7,830,265.17

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	6,684.52
其他	38,179.88
合计	44,864.40

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。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	145,402.68
银行间市场交易费用	-
合计	145,402.68

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	19,890.78
信息披露费	39,781.56
上市费用	34,809.32
银行汇划费用	140.00
指数使用费	100,000.00
合计	194,621.66

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至 2016 年 6 月 30 日止，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至 2016 年 6 月 30 日止，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
西部利得基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构
西部证券股份有限公司（简称“西部证券”）	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
上海利得财富资产管理有限公司	基金管理人的股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年4月15日(基金合同生效日)至 2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
西部证券	75,040,056.30	41.61%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
西部证券	39,869.40	36.41%	39,288.52	36.51%
关联方名称	上年度可比期间 2015年4月15日(基金合同生效日)至2015年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
-	-	-	-	-

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年4月15日(基金合同生效日) 至2015年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	186,882.23
其中：支付销售机构的客户维护费	2,205.18	10,272.39

注：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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	37,376.44	45,730.48

注：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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 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	9,636,750.86	31,323.79	997,581.51	60,308.22

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 2016 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 734,233.81 元。

6.4.10.6 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的情况。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

根据本基金基金合同，本基金不进行利润分配。

6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

6.4.12.2 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
600166	福田汽车	-	临时停牌	5.52	-	-	57,900	310,880.00	319,608.00	-
600773	西藏城投	-	临时停牌	15.67	-	-	19,500	290,579.93	305,565.00	-
300032	金龙机电	-	临时停牌	20.10	-	-	15,200	255,431.00	305,520.00	-
002512	达华智能	-	临时停牌	20.28	-	-	14,100	269,075.00	285,948.00	-
600759	洲际油气	-	临时停牌	7.58	-	-	35,040	276,943.65	265,603.20	-
002249	大洋电机	-	临时停牌	11.97	-	-	19,600	178,817.95	234,612.00	-
002672	东江环保	-	临时停牌	17.33	-	-	11,800	194,910.05	204,494.00	-
601005	重庆钢铁	-	临时停牌	2.52	-	-	73,900	193,918.10	186,228.00	-
600497	驰宏锌锗	-	临时停牌	9.97	-	-	17,700	162,317.06	176,469.00	-
002266	浙富控股	-	临时停牌	5.35	-	-	25,920	147,173.01	138,672.00	-
600545	新疆城建	-	临时停牌	6.91	-	-	19,600	145,677.65	135,436.00	-
600654	中安消	-	临时停牌	18.54	-	-	7,200	143,535.94	133,488.00	-
002373	千方科技	-	临时停牌	14.94	-	-	5,000	81,252.55	74,700.00	-
000975	银泰资源	-	临时停牌	15.00	-	-	1,700	23,539.98	25,500.00	-

000511	*ST 烯碳	-	临时停牌	8.92	-	-	2,600	24,202.96	23,192.00	-
002190	成飞集成	-	临时停牌	35.44	-	-	600	23,179.47	21,264.00	-
000718	苏宁环球	-	临时停牌	13.09	-	-	1,610	17,704.54	21,074.90	-
002663	普邦园林	-	临时停牌	7.36	-	-	2,726	20,877.11	20,063.36	-
600640	号百控股	-	临时停牌	16.79	-	-	1,100	21,235.88	18,469.00	-
601168	西部矿业	-	临时停牌	5.93	-	-	3,000	21,476.63	17,790.00	-
000547	航天发展	-	临时停牌	15.36	-	-	1,100	23,727.25	16,896.00	-
000636	风华高科	-	临时停牌	8.84	-	-	1,900	21,066.52	16,796.00	-
600511	国药股份	-	临时停牌	27.42	-	-	600	21,913.55	16,452.00	-
000582	北部湾港	-	临时停牌	16.32	-	-	1,000	20,041.11	16,320.00	-
600614	鼎立股份	-	临时停牌	8.14	-	-	1,800	20,358.31	14,652.00	-
600751	天海投资	-	临时停牌	6.11	-	-	2,100	19,321.84	12,831.00	-
000693	ST 华泽	-	临时停牌	12.50	-	-	1,000	18,518.72	12,500.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.13 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：

6.4.13.1 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，建立了以风险管理委员会为核心，由督察长、风险管理委员会、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管理委员会，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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人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较低。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。

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 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金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 6.4.12 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 2016 年 6 月 30 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。

6.4.13.4 市场风险

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

本基金管理人通过监测组合久期、Beta 值等指标来衡量市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 个月 以内	1-3 个 月	3 个月 -1 年	1 年以内	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产								
银行存款	-	-	-	9,636,750.86	-	-	-	9,636,750.86
结算备付金	-	-	-	734,233.81	-	-	-	734,233.81
存出保证金	-	-	-	37,517.54	-	-	-	37,517.54
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	158,014,560.66	158,014,560.66
应收利息	-	-	-	-	-	-	5,923.83	5,923.83
应收申购款	-	-	-	-	-	-	105,548.63	105,548.63
资产总计	-	-	-	10,408,502.21	-	-	158,126,033.12	168,534,535.33
负债								
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	104,184.20	104,184.20
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	170,201.48	170,201.48
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	101,096.38	101,096.38
应付托管费	-	-	-	-	-	-	20,219.26	20,219.26
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	107,618.26	107,618.26
其他负债	-	-	-	-	-	-	145,123.10	145,123.10
负债总计	-	-	-	-	-	-	648,442.68	648,442.68
利率敏感度缺口	-	-	-	10,408,502.21	-	-	157,477,590.44	167,886,092.65
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 个月 以内	1-3 个 月	3 个月 -1 年	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

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2015 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2015 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	158,014,560.66	94.12	10,373,589.19	93.60
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	158,014,560.66	94.12	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%。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准（附注 6.4.1）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（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准（附注 6.4.1）上升 5%	7,950,000.00	502,000.00
业绩比较基准（附注 6.4.1）下降 5%	-7,950,000.00	-502,000.00	

6.4.14 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 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为 154,994,417.20 元，第二层次余额为 3,020,143.46 元，无属于第三层次的余额（2015 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为 9,360,376.15 元，属于第二层次的余额为 1,013,213.04 元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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) 第三层次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 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2015 年 12 月 31 日：同）。

(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。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	158,014,560.66	93.76
	其中：股票	158,014,560.66	93.76
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	10,370,984.67	6.15
7	其他各项资产	148,990.00	0.09
8	合计	168,534,535.33	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,306,504.00	1.37
B	采矿业	6,039,570.20	3.60
C	制造业	94,454,616.54	56.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,809,120.20	3.46
E	建筑业	4,692,284.06	2.79
F	批发和零售业	9,369,380.62	5.58
G	交通运输、仓储和邮政业	4,752,964.40	2.83
H	住宿和餐饮业	284,410.00	0.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,896,349.94	5.30
J	金融业	646,891.90	0.39
K	房地产业	10,687,940.96	6.37
L	租赁和商务服务业	2,250,297.60	1.34
M	科学研究和技术服务业	938,983.50	0.56
N	水利、环境和公共设施管理业	1,147,912.70	0.68
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	327,821.20	0.20
R	文化、体育和娱乐业	3,355,892.84	2.00
S	综合	2,053,620.00	1.22
	合计	158,014,560.66	94.12

7.2.2 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 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	603806	福斯特	8,600	448,834.00	0.27
2	600006	XD 东风汽	48,800	432,856.00	0.26
3	002371	七星电子	9,800	409,836.00	0.24
4	002482	广田集团	53,950	408,941.00	0.24
5	000620	新华联	43,800	400,770.00	0.24
6	002340	格林美	44,640	391,492.80	0.23
7	600458	时代新材	25,100	391,058.00	0.23
8	300026	红日药业	22,400	389,536.00	0.23
9	000021	深科技	35,300	388,653.00	0.23
10	002074	国轩高科	9,800	386,806.00	0.23
11	000997	新大陆	19,280	386,371.20	0.23
12	600298	安琪酵母	21,500	383,560.00	0.23
13	000426	兴业矿业	50,900	382,768.00	0.23
14	300273	和佳股份	19,980	382,617.00	0.23
15	600435	北方导航	28,700	381,997.00	0.23
16	000066	长城电脑	29,900	381,225.00	0.23
17	300257	开山股份	23,000	379,960.00	0.23
18	600729	重庆百货	15,300	379,440.00	0.23
19	600869	智慧能源	36,700	378,010.00	0.23
20	002025	航天电器	15,240	376,275.60	0.22
21	600456	宝钛股份	18,700	376,244.00	0.22
22	002414	高德红外	13,900	374,883.00	0.22
23	600418	江淮汽车	29,500	374,060.00	0.22
24	600175	美都能源	79,400	373,180.00	0.22
25	300202	聚龙股份	15,300	370,413.00	0.22
26	000939	凯迪生态	41,300	369,635.00	0.22

27	000661	长春高新	3,460	369,112.80	0.22
28	601908	京运通	48,100	368,927.00	0.22
29	002191	劲嘉股份	31,800	368,562.00	0.22
30	000612	焦作万方	51,600	368,424.00	0.22
31	002221	东华能源	30,200	368,138.00	0.22
32	000848	承德露露	30,775	367,761.25	0.22
33	601965	中国汽研	38,150	366,621.50	0.22
34	600884	杉杉股份	21,200	364,852.00	0.22
35	000596	古井贡酒	7,600	364,420.00	0.22
36	000973	佛塑科技	34,800	363,312.00	0.22
37	002508	老板电器	9,875	363,103.75	0.22
38	002366	台海核电	6,800	362,508.00	0.22
39	002271	东方雨虹	21,000	361,830.00	0.22
40	002194	武汉凡谷	28,300	361,674.00	0.22
41	601777	力帆股份	30,700	361,339.00	0.22
42	002223	鱼跃医疗	11,370	360,656.40	0.21
43	002056	横店东磁	21,200	360,400.00	0.21
44	002727	一心堂	14,400	360,000.00	0.21
45	603005	晶方科技	9,500	359,765.00	0.21
46	002640	跨境通	20,400	359,448.00	0.21
47	600086	东方金钰	37,100	359,128.00	0.21
48	300287	飞利信	26,800	359,120.00	0.21
49	002428	云南锗业	20,900	359,062.00	0.21
50	600260	凯乐科技	21,900	358,284.00	0.21
51	603766	隆鑫通用	17,700	357,894.00	0.21
52	600499	科达洁能	21,100	356,801.00	0.21
53	600200	江苏吴中	18,400	356,408.00	0.21
54	600557	康缘药业	21,780	355,667.40	0.21
55	002063	远光软件	23,018	355,628.10	0.21
56	002155	湖南黄金	27,000	355,590.00	0.21
57	601001	大同煤业	66,200	355,494.00	0.21
58	002073	软控股份	29,500	355,475.00	0.21
59	601002	晋亿实业	40,800	354,960.00	0.21
60	000581	威孚高科	17,600	354,816.00	0.21
61	000418	小天鹅A	10,870	354,579.40	0.21
62	300274	阳光电源	14,500	353,800.00	0.21
63	000543	皖能电力	49,510	353,501.40	0.21
64	600436	片仔癀	7,850	353,328.50	0.21
65	600067	冠城大通	49,000	353,290.00	0.21

66	002013	中航机电	26,175	352,839.00	0.21
67	002317	众生药业	29,400	352,506.00	0.21
68	600312	平高电气	22,500	352,350.00	0.21
69	600198	大唐电信	17,700	351,876.00	0.21
70	600510	黑牡丹	40,300	351,416.00	0.21
71	600171	上海贝岭	20,210	351,047.70	0.21
72	300253	卫宁健康	14,200	350,740.00	0.21
73	601126	四方股份	33,300	350,649.00	0.21
74	300010	立思辰	16,700	350,366.00	0.21
75	600141	兴发集团	30,400	350,208.00	0.21
76	600639	浦东金桥	14,000	349,720.00	0.21
77	002354	天神娱乐	4,000	349,120.00	0.21
78	600879	航天电子	22,400	348,992.00	0.21
79	002325	洪涛股份	37,950	348,760.50	0.21
80	002293	罗莱生活	25,430	348,391.00	0.21
81	002048	宁波华翔	15,228	348,264.36	0.21
82	600522	DR 中天科	35,500	347,900.00	0.21
83	002572	索菲亚	6,200	347,324.00	0.21
84	000983	西山煤电	42,600	347,190.00	0.21
85	000860	顺鑫农业	14,600	347,188.00	0.21
86	002281	光迅科技	5,407	347,129.40	0.21
87	002251	步步高	26,744	346,869.68	0.21
88	000988	华工科技	17,300	346,865.00	0.21
89	603019	中科曙光	8,700	346,434.00	0.21
90	603077	和邦生物	70,100	344,892.00	0.21
91	002179	中航光电	7,960	344,827.20	0.21
92	601012	隆基股份	26,400	344,520.00	0.21
93	002277	友阿股份	29,900	344,448.00	0.21
94	002315	焦点科技	5,100	344,046.00	0.20
95	002216	三全食品	40,000	344,000.00	0.20
96	002093	国脉科技	27,700	343,757.00	0.20
97	002064	华峰氨纶	71,600	343,680.00	0.20
98	002022	科华生物	16,107	343,240.17	0.20
99	600584	长电科技	16,900	342,901.00	0.20
100	002368	太极股份	9,650	342,864.50	0.20
101	002050	三花股份	35,500	342,575.00	0.20
102	000587	金洲慈航	22,200	342,546.00	0.20
103	600597	光明乳业	27,000	342,360.00	0.20
104	600416	湘电股份	27,400	341,678.00	0.20

105	000513	丽珠集团	7,410	341,675.10	0.20
106	600776	东方通信	40,700	341,473.00	0.20
107	600736	苏州高新	37,400	341,462.00	0.20
108	601515	东风股份	30,200	341,260.00	0.20
109	600151	航天机电	30,200	341,260.00	0.20
110	000400	许继电气	22,100	341,224.00	0.20
111	600219	南山铝业	46,100	341,140.00	0.20
112	002698	博实股份	17,690	340,709.40	0.20
113	600466	蓝光发展	39,800	340,688.00	0.20
114	002011	盾安环境	30,200	340,656.00	0.20
115	002589	瑞康医药	11,092	340,635.32	0.20
116	603699	纽威股份	19,200	340,608.00	0.20
117	002332	仙琚制药	30,400	340,480.00	0.20
118	002085	万丰奥威	19,800	340,362.00	0.20
119	600580	卧龙电气	30,300	339,663.00	0.20
120	002405	四维图新	13,800	339,480.00	0.20
121	600850	华东电脑	11,830	339,402.70	0.20
122	600805	悦达投资	39,100	339,388.00	0.20
123	600220	江苏阳光	74,400	339,264.00	0.20
124	600536	中国软件	13,600	338,912.00	0.20
125	600517	置信电气	35,600	338,556.00	0.20
126	600180	瑞茂通	22,400	338,464.00	0.20
127	002308	威创股份	20,600	338,458.00	0.20
128	000697	炼石有色	14,800	338,180.00	0.20
129	000656	金科股份	88,500	338,070.00	0.20
130	600316	洪都航空	17,300	337,523.00	0.20
131	000869	张裕A	8,400	337,512.00	0.20
132	600809	山西汾酒	15,200	337,136.00	0.20
133	600699	均胜电子	8,800	337,040.00	0.20
134	002327	富安娜	39,600	336,996.00	0.20
135	600478	科力远	27,920	336,994.40	0.20
136	601678	滨化股份	66,060	336,245.40	0.20
137	600143	金发科技	52,200	336,168.00	0.20
138	002028	思源电气	30,700	336,165.00	0.20
139	002400	省广股份	23,790	336,152.70	0.20
140	002410	广联达	23,500	336,050.00	0.20
141	600682	南京新百	11,800	335,946.00	0.20
142	300199	翰宇药业	16,500	335,775.00	0.20
143	600409	三友化工	49,800	335,652.00	0.20

144	002384	东山精密	16,900	335,634.00	0.20
145	600528	中铁二局	28,900	335,529.00	0.20
146	000049	德赛电池	8,000	335,520.00	0.20
147	002595	豪迈科技	15,700	335,509.00	0.20
148	603355	莱克电气	8,800	335,280.00	0.20
149	600487	亨通光电	26,650	335,257.00	0.20
150	000926	福星股份	28,576	335,196.48	0.20
151	600176	中国巨石	34,980	334,758.60	0.20
152	300039	上海凯宝	32,900	334,593.00	0.20
153	000777	中核科技	14,200	334,552.00	0.20
154	002041	登海种业	21,500	334,110.00	0.20
155	002299	圣农发展	12,900	334,110.00	0.20
156	002049	紫光国芯	7,600	334,020.00	0.20
157	600468	百利电气	23,600	333,940.00	0.20
158	600410	华胜天成	29,760	333,907.20	0.20
159	002635	安洁科技	8,700	333,906.00	0.20
160	600503	华丽家族	36,400	333,788.00	0.20
161	002551	尚荣医疗	14,272	333,679.36	0.20
162	600251	XD 冠农股	41,700	333,600.00	0.20
163	601311	骆驼股份	16,800	333,480.00	0.20
164	001696	宗申动力	30,500	333,060.00	0.20
165	600761	安徽合力	33,000	332,970.00	0.20
166	600643	爱建集团	34,070	332,863.90	0.20
167	600160	巨化股份	31,300	332,719.00	0.20
168	603025	大豪科技	9,900	332,343.00	0.20
169	600563	法拉电子	7,300	332,296.00	0.20
170	002250	联化科技	23,200	332,224.00	0.20
171	600039	四川路桥	84,300	332,142.00	0.20
172	000062	深圳华强	12,300	332,100.00	0.20
173	603698	航天工程	12,100	332,024.00	0.20
174	000028	国药一致	5,100	332,010.00	0.20
175	300001	特锐德	15,300	331,857.00	0.20
176	600329	中新药业	19,200	331,584.00	0.20
177	000786	北新建材	36,500	331,420.00	0.20
178	600059	古越龙山	32,200	331,338.00	0.20
179	000550	江铃汽车	13,600	331,296.00	0.20
180	603328	依顿电子	11,200	330,848.00	0.20
181	600750	江中药业	10,400	330,720.00	0.20
182	002439	启明星辰	12,800	330,624.00	0.20

183	002161	远望谷	22,200	330,558.00	0.20
184	002396	星网锐捷	16,776	330,487.20	0.20
185	600267	海正药业	27,200	330,480.00	0.20
186	002128	露天煤业	44,000	330,440.00	0.20
187	600289	亿阳信通	23,600	330,164.00	0.20
188	600509	天富能源	44,900	330,015.00	0.20
189	002267	陕天然气	31,425	329,962.50	0.20
190	002390	信邦制药	35,700	329,868.00	0.20
191	000030	富奥股份	46,000	329,820.00	0.20
192	601880	大连港	55,800	329,778.00	0.20
193	002051	中工国际	16,740	329,275.80	0.20
194	603568	伟明环保	14,250	329,175.00	0.20
195	002479	富春环保	29,300	329,039.00	0.20
196	002276	万马股份	16,600	328,846.00	0.20
197	600325	华发股份	29,700	328,779.00	0.20
198	002678	珠江钢琴	26,795	328,774.65	0.20
199	002005	德豪润达	55,600	328,596.00	0.20
200	002426	胜利精密	33,350	328,497.50	0.20
201	002030	达安基因	11,812	328,373.60	0.20
202	600056	中国医药	20,700	328,302.00	0.20
203	600348	阳泉煤业	51,500	328,055.00	0.20
204	300244	迪安诊断	9,940	327,821.20	0.20
205	002118	紫鑫药业	22,300	327,810.00	0.20
206	600498	烽火通信	13,500	327,780.00	0.20
207	000417	合肥百货	40,500	327,645.00	0.20
208	603001	奥康国际	15,400	327,404.00	0.20
209	600422	昆药集团	23,990	327,223.60	0.19
210	002701	奥瑞金	37,020	326,886.60	0.19
211	600483	福能股份	28,800	326,880.00	0.19
212	600765	中航重机	22,400	326,592.00	0.19
213	600280	中央商场	48,300	326,508.00	0.19
214	000572	海马汽车	62,900	326,451.00	0.19
215	002131	利欧股份	19,100	326,419.00	0.19
216	600993	马应龙	15,670	326,406.10	0.19
217	002745	木林森	9,600	326,304.00	0.19
218	002285	世联行	41,880	326,245.20	0.19
219	000816	智慧农业	55,200	326,232.00	0.19
220	600004	白云机场	26,600	326,116.00	0.19
221	002588	史丹利	26,400	326,040.00	0.19

222	600184	光电股份	14,400	326,016.00	0.19
223	600266	北京城建	26,100	325,989.00	0.19
224	002309	中利科技	18,200	325,962.00	0.19
225	300055	万邦达	17,900	325,959.00	0.19
226	002038	双鹭药业	10,800	325,944.00	0.19
227	002353	杰瑞股份	16,900	325,832.00	0.19
228	002344	海宁皮城	33,400	325,650.00	0.19
229	002646	青青稞酒	15,800	325,638.00	0.19
230	002078	太阳纸业	66,700	325,496.00	0.19
231	002238	天威视讯	22,492	325,459.24	0.19
232	600720	祁连山	48,500	325,435.00	0.19
233	002001	新和成	15,400	325,402.00	0.19
234	002002	鸿达兴业	17,300	325,240.00	0.19
235	600201	生物股份	11,900	325,227.00	0.19
236	600655	豫园商城	30,000	325,200.00	0.19
237	600064	南京高科	21,750	325,162.50	0.19
238	000877	天山股份	52,600	325,068.00	0.19
239	000900	现代投资	48,200	324,868.00	0.19
240	002092	中泰化学	38,400	324,864.00	0.19
241	002029	七匹狼	32,000	324,800.00	0.19
242	600537	亿晶光电	42,122	324,760.62	0.19
243	600112	天成控股	29,100	324,756.00	0.19
244	601666	平煤股份	79,400	324,746.00	0.19
245	300147	香雪制药	22,040	324,649.20	0.19
246	600270	外运发展	18,560	324,614.40	0.19
247	002603	以岭药业	20,400	324,564.00	0.19
248	000998	隆平高科	17,100	324,558.00	0.19
249	600872	中炬高新	26,300	324,542.00	0.19
250	600482	中国动力	9,900	324,423.00	0.19
251	600594	益佰制药	20,300	324,394.00	0.19
252	002342	巨力索具	55,900	324,220.00	0.19
253	600108	亚盛集团	64,200	324,210.00	0.19
254	601155	新城控股	35,000	324,100.00	0.19
255	600572	康恩贝	50,000	324,000.00	0.19
256	600079	人福医药	19,300	323,661.00	0.19
257	600125	铁龙物流	50,800	323,596.00	0.19
258	600426	华鲁恒升	36,720	323,503.20	0.19
259	000671	阳光城	54,450	323,433.00	0.19
260	600551	时代出版	16,200	323,352.00	0.19

261	600874	创业环保	41,600	323,232.00	0.19
262	600094	大名城	34,000	323,000.00	0.19
263	000566	海南海药	29,600	322,936.00	0.19
264	002310	东方园林	13,500	322,920.00	0.19
265	600651	飞乐音响	25,500	322,830.00	0.19
266	600831	广电网络	24,900	322,704.00	0.19
267	600320	振华重工	75,900	322,575.00	0.19
268	002168	深圳惠程	22,900	322,432.00	0.19
269	601226	华电重工	35,150	322,325.50	0.19
270	000669	金鸿能源	19,300	322,310.00	0.19
271	603589	口子窖	8,900	322,269.00	0.19
272	600664	哈药股份	38,870	322,232.30	0.19
273	600687	刚泰控股	19,800	321,948.00	0.19
274	600496	精工钢构	75,540	321,800.40	0.19
275	601699	潞安环能	49,200	321,768.00	0.19
276	002268	卫士通	9,000	321,660.00	0.19
277	000681	视觉中国	13,600	321,640.00	0.19
278	600397	安源煤业	72,700	321,334.00	0.19
279	600971	恒源煤电	58,200	321,264.00	0.19
280	300088	长信科技	21,600	321,192.00	0.19
281	002642	荣之联	12,200	320,982.00	0.19
282	600516	方大炭素	35,100	320,814.00	0.19
283	000541	佛山照明	31,170	320,739.30	0.19
284	000878	云南铜业	31,500	320,670.00	0.19
285	000887	中鼎股份	14,500	320,595.00	0.19
286	002477	雏鹰农牧	53,700	320,589.00	0.19
287	300072	三聚环保	11,593	320,430.52	0.19
288	603198	迎驾贡酒	13,400	320,394.00	0.19
289	600825	新华传媒	40,300	320,385.00	0.19
290	600460	士兰微	40,400	320,372.00	0.19
291	603169	兰石重装	25,700	320,222.00	0.19
292	000501	鄂武商 A	20,400	320,076.00	0.19
293	600881	亚泰集团	66,400	320,048.00	0.19
294	002004	华邦健康	35,050	320,006.50	0.19
295	601000	唐山港	82,400	319,712.00	0.19
296	601369	陕鼓动力	50,100	319,638.00	0.19
297	600166	福田汽车	57,900	319,608.00	0.19
298	002244	滨江集团	47,700	319,590.00	0.19
299	600380	健康元	34,800	319,464.00	0.19

300	600596	新安股份	43,800	319,302.00	0.19
301	000937	冀中能源	60,000	319,200.00	0.19
302	600970	中材国际	50,650	319,095.00	0.19
303	600138	中青旅	16,500	318,780.00	0.19
304	002657	中科金财	5,800	318,652.00	0.19
305	600284	浦东建设	30,500	318,420.00	0.19
306	600811	东方集团	47,800	318,348.00	0.19
307	603883	老百姓	6,400	318,336.00	0.19
308	000652	泰达股份	69,200	318,320.00	0.19
309	600169	太原重工	81,600	318,240.00	0.19
310	002242	九阳股份	17,500	318,150.00	0.19
311	600292	远达环保	25,110	318,143.70	0.19
312	601717	郑煤机	55,800	318,060.00	0.19
313	600787	中储股份	42,800	318,004.00	0.19
314	600790	轻纺城	54,150	317,860.50	0.19
315	002122	天马股份	51,100	317,842.00	0.19
316	000703	恒逸石化	32,200	317,814.00	0.19
317	600240	华业资本	31,700	317,634.00	0.19
318	000078	海王生物	42,750	317,632.50	0.19
319	600743	华远地产	67,100	317,383.00	0.19
320	002489	浙江永强	40,060	317,275.20	0.19
321	002461	珠江啤酒	27,300	317,226.00	0.19
322	000685	中山公用	30,560	317,212.80	0.19
323	002392	北京利尔	64,200	317,148.00	0.19
324	002665	首航节能	40,190	317,099.10	0.19
325	000667	美好集团	88,800	317,016.00	0.19
326	000598	兴蓉环境	60,000	316,800.00	0.19
327	600826	兰生股份	12,100	316,778.00	0.19
328	000726	鲁泰 A	28,500	316,635.00	0.19
329	600236	桂冠电力	47,100	316,512.00	0.19
330	002503	搜于特	25,480	316,461.60	0.19
331	600525	长园集团	22,840	316,334.00	0.19
332	002273	水晶光电	11,300	316,287.00	0.19
333	000088	盐田港	49,100	316,204.00	0.19
334	000919	金陵药业	24,153	316,162.77	0.19
335	000552	靖远煤电	89,800	316,096.00	0.19
336	600694	大商股份	8,205	316,056.60	0.19
337	002311	海大集团	20,040	316,030.80	0.19
338	000488	晨鸣纸业	39,800	316,012.00	0.19

339	600808	马钢股份	131,100	315,951.00	0.19
340	000690	宝新能源	46,600	315,948.00	0.19
341	002233	塔牌集团	39,300	315,579.00	0.19
342	000528	柳工	48,700	315,576.00	0.19
343	600183	生益科技	34,000	315,180.00	0.19
344	000979	中弘股份	115,020	315,154.80	0.19
345	600300	维维股份	53,000	314,820.00	0.19
346	600835	上海机电	16,400	314,716.00	0.19
347	000748	长城信息	16,040	314,704.80	0.19
348	600967	北方创业	29,600	314,648.00	0.19
349	300134	大富科技	10,500	314,580.00	0.19
350	600864	哈投股份	28,000	314,440.00	0.19
351	603555	贵人鸟	12,600	314,118.00	0.19
352	000563	陕国投 A	57,200	314,028.00	0.19
353	600161	天坛生物	11,300	314,027.00	0.19
354	000616	海航投资	58,800	313,992.00	0.19
355	002681	奋达科技	18,600	313,968.00	0.19
356	600717	天津港	36,100	313,709.00	0.19
357	600500	中化国际	34,700	313,688.00	0.19
358	000931	中关村	39,300	313,614.00	0.19
359	601010	XD 文峰股	60,400	313,476.00	0.19
360	600062	华润双鹤	17,200	313,384.00	0.19
361	002714	牧原股份	6,200	313,286.00	0.19
362	000830	鲁西化工	69,300	313,236.00	0.19
363	600755	厦门国贸	39,400	313,230.00	0.19
364	000006	深振业 A	42,500	313,225.00	0.19
365	300291	华录百纳	13,300	312,949.00	0.19
366	600195	中牧股份	17,100	312,930.00	0.19
367	600770	综艺股份	25,100	312,746.00	0.19
368	600601	方正科技	72,700	312,610.00	0.19
369	002261	拓维信息	22,600	312,558.00	0.19
370	601929	吉视传媒	77,500	312,325.00	0.19
371	002431	棕榈股份	27,150	312,225.00	0.19
372	000519	江南红箭	24,555	312,094.05	0.19
373	600351	亚宝药业	31,100	311,933.00	0.19
374	600282	南钢股份	132,700	311,845.00	0.19
375	000930	中粮生化	28,400	311,832.00	0.19
376	600617	国新能源	27,200	311,712.00	0.19
377	002466	天齐锂业	7,300	311,637.00	0.19

378	600425	青松建化	73,300	311,525.00	0.19
379	600633	浙报传媒	20,700	311,328.00	0.19
380	600657	信达地产	62,500	311,250.00	0.19
381	002498	汉缆股份	71,700	311,178.00	0.19
382	002254	泰和新材	22,680	311,169.60	0.19
383	601801	皖新传媒	26,652	311,028.84	0.19
384	002375	亚厦股份	27,500	310,750.00	0.19
385	603188	亚邦股份	17,300	310,708.00	0.19
386	600823	世茂股份	45,740	310,574.60	0.18
387	000727	华东科技	94,100	310,530.00	0.18
388	600812	华北制药	50,000	310,500.00	0.18
389	600801	华新水泥	49,200	310,452.00	0.18
390	600748	上实发展	32,200	310,408.00	0.18
391	002440	闰土股份	20,900	310,365.00	0.18
392	000031	中粮地产	32,900	310,247.00	0.18
393	600388	龙净环保	24,700	310,232.00	0.18
394	000158	常山股份	22,300	309,747.00	0.18
395	600587	新华医疗	13,400	309,406.00	0.18
396	000897	津滨发展	79,900	309,213.00	0.18
397	600628	新世界	26,200	309,160.00	0.18
398	600017	日照港	76,300	309,015.00	0.18
399	000762	西藏矿业	12,500	309,000.00	0.18
400	000680	山推股份	62,652	308,874.36	0.18
401	600565	迪马股份	47,800	308,788.00	0.18
402	600507	方大特钢	64,300	308,640.00	0.18
403	600917	重庆燃气	31,000	308,450.00	0.18
404	600635	大众公用	51,150	308,434.50	0.18
405	600088	中视传媒	13,000	308,360.00	0.18
406	600586	金晶科技	71,600	307,880.00	0.18
407	600187	国中水务	69,000	307,740.00	0.18
408	000600	建投能源	35,200	307,296.00	0.18
409	002345	潮宏基	31,400	307,092.00	0.18
410	600618	氯碱化工	23,349	306,572.37	0.18
411	600277	亿利洁能	51,500	306,425.00	0.18
412	600880	博瑞传播	36,000	306,360.00	0.18
413	600481	双良节能	53,440	306,211.20	0.18
414	600026	中海发展	51,900	306,210.00	0.18
415	000012	南玻A	26,700	305,982.00	0.18
416	600575	皖江物流	70,600	305,698.00	0.18

417	600773	西藏城投	19,500	305,565.00	0.18
418	600366	宁波韵升	12,800	305,536.00	0.18
419	300032	金龙机电	15,200	305,520.00	0.18
420	600611	大众交通	44,800	305,088.00	0.18
421	000050	深天马 A	14,600	304,702.00	0.18
422	300182	捷成股份	17,800	304,558.00	0.18
423	600433	冠豪高新	35,200	304,128.00	0.18
424	600978	宜华生活	27,300	304,122.00	0.18
425	600058	五矿发展	16,200	304,074.00	0.18
426	600894	广日股份	22,800	303,924.00	0.18
427	000810	创维数字	16,800	303,576.00	0.18
428	600428	中远航运	54,100	303,501.00	0.18
429	600216	浙江医药	22,900	302,051.00	0.18
430	000861	海印股份	61,090	301,784.60	0.18
431	000829	天音控股	22,600	301,710.00	0.18
432	000008	神州高铁	27,700	301,653.00	0.18
433	600053	九鼎投资	8,700	301,281.00	0.18
434	601886	江河集团	29,300	300,911.00	0.18
435	000090	天健集团	34,140	300,432.00	0.18
436	600158	中体产业	16,900	299,975.00	0.18
437	002181	粤传媒	36,480	299,500.80	0.18
438	600673	东阳光科	47,800	298,750.00	0.18
439	002444	巨星科技	14,700	298,704.00	0.18
440	000758	中色股份	38,500	298,375.00	0.18
441	000099	中信海直	22,900	297,700.00	0.18
442	002269	美邦服饰	67,600	297,440.00	0.18
443	600395	盘江股份	36,000	297,360.00	0.18
444	600335	国机汽车	26,450	296,504.50	0.18
445	002573	清新环境	17,500	296,100.00	0.18
446	600851	海欣股份	22,234	295,934.54	0.18
447	600757	长江传媒	35,200	295,328.00	0.18
448	600132	XD 重庆啤	19,400	294,686.00	0.18
449	600073	上海梅林	25,700	294,265.00	0.18
450	300115	长盈精密	14,260	293,756.00	0.17
451	000970	中科三环	20,200	293,102.00	0.17
452	300113	顺网科技	7,700	292,292.00	0.17
453	002106	莱宝高科	24,600	292,248.00	0.17
454	002217	合力泰	19,100	292,230.00	0.17
455	300043	互动娱乐	20,600	291,902.00	0.17

456	601233	桐昆股份	26,700	289,962.00	0.17
457	002463	沪电股份	54,700	288,816.00	0.17
458	002512	达华智能	14,100	285,948.00	0.17
459	600623	华谊集团	14,400	285,264.00	0.17
460	000969	安泰科技	20,300	284,809.00	0.17
461	600645	中源协和	8,100	284,634.00	0.17
462	600754	锦江股份	8,500	284,410.00	0.17
463	002602	世纪华通	15,300	283,509.00	0.17
464	603567	珍宝岛	12,900	281,865.00	0.17
465	002437	誉衡药业	32,100	279,270.00	0.17
466	002699	美盛文化	8,300	277,137.00	0.17
467	600259	广晟有色	4,800	274,848.00	0.16
468	002358	森源电气	17,700	273,111.00	0.16
469	000961	中南建设	47,900	268,719.00	0.16
470	002624	完美环球	7,100	268,025.00	0.16
471	600759	洲际油气	35,040	265,603.20	0.16
472	600392	盛和资源	16,150	264,537.00	0.16
473	000631	顺发恒业	54,304	264,460.48	0.16
474	600521	华海药业	10,050	244,416.00	0.15
475	002249	大洋电机	19,600	234,612.00	0.14
476	600859	王府井	15,283	232,912.92	0.14
477	600122	宏图高科	16,700	223,446.00	0.13
478	002672	东江环保	11,800	204,494.00	0.12
479	002505	大康农业	50,510	196,989.00	0.12
480	601005	重庆钢铁	73,900	186,228.00	0.11
481	600497	驰宏锌锗	17,700	176,469.00	0.11
482	000592	平潭发展	23,400	158,652.00	0.09
483	002408	齐翔腾达	25,663	140,889.87	0.08
484	002266	浙富控股	25,920	138,672.00	0.08
485	600545	新疆城建	19,600	135,436.00	0.08
486	600654	中安消	7,200	133,488.00	0.08
487	002373	千方科技	5,000	74,700.00	0.04
488	000975	银泰资源	1,700	25,500.00	0.02
489	000511	*ST 烯碳	2,600	23,192.00	0.01
490	600120	浙江东方	1,000	21,710.00	0.01
491	002190	成飞集成	600	21,264.00	0.01
492	000718	苏宁环球	1,610	21,074.90	0.01
493	000401	冀东水泥	1,900	20,140.00	0.01
494	002663	普邦园林	2,726	20,063.36	0.01

495	600640	号百控股	1,100	18,469.00	0.01
496	601168	西部矿业	3,000	17,790.00	0.01
497	000547	航天发展	1,100	16,896.00	0.01
498	000636	风华高科	1,900	16,796.00	0.01
499	600511	国药股份	600	16,452.00	0.01
500	000582	北部湾港	1,000	16,320.00	0.01
501	600614	鼎立股份	1,800	14,652.00	0.01
502	600751	天海投资	2,100	12,831.00	0.01
503	000693	ST 华泽	1,000	12,500.00	0.01

7.3.2 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。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000418	小天鹅 A	465,147.00	4.20
2	600298	安琪酵母	441,000.00	3.98
3	002508	老板电器	440,033.00	3.97
4	002371	七星电子	434,819.00	3.92
5	002155	湖南黄金	432,790.50	3.91
6	000596	古井贡酒	427,839.82	3.86
7	002466	天齐锂业	408,014.00	3.68
8	002299	圣农发展	404,156.00	3.65
9	002482	广田集团	403,957.50	3.64
10	600809	山西汾酒	401,209.00	3.62
11	002311	海大集团	396,766.00	3.58
12	002431	棕榈股份	392,363.00	3.54
13	002048	宁波华翔	391,803.00	3.54
14	000860	顺鑫农业	388,045.00	3.50
15	002074	国轩高科	384,528.00	3.47
16	600259	广晟有色	382,949.00	3.46
17	600216	XD 浙江医	381,848.00	3.45
18	600395	盘江股份	380,263.00	3.43
19	002635	安洁科技	379,532.00	3.42

20	600392	盛和资源	378,148.00	3.41
21	600175	美都能源	375,713.00	3.39
22	000563	陕国投 A	369,012.00	3.33
23	600880	博瑞传播	368,377.00	3.32
24	002001	新 和 成	365,883.00	3.30
25	002168	深圳惠程	365,608.70	3.30
26	600521	华海药业	361,322.00	3.26
27	603806	福斯特	360,160.00	3.25
28	000997	新 大 陆	357,893.00	3.23
29	600736	苏州高新	355,936.00	3.21
30	000969	安泰科技	355,470.00	3.21
31	002366	台海核电	355,132.00	3.20
32	002085	万丰奥威	354,800.97	3.20
33	600418	江淮汽车	352,941.00	3.18
34	600699	均胜电子	352,913.00	3.18
35	000620	新华联	352,178.00	3.18
36	002477	雏鹰农牧	352,043.00	3.18
37	000078	海王生物	352,016.00	3.18
38	600597	光明乳业	348,085.00	3.14
39	000848	承德露露	345,786.04	3.12
40	002056	横店东磁	344,955.10	3.11
41	300257	开山股份	344,599.00	3.11
42	000028	国药一致	343,911.00	3.10
43	002572	索菲亚	342,949.00	3.09
44	600086	东方金钰	342,846.00	3.09
45	600006	东风汽车	342,190.00	3.09
46	000988	华工科技	341,909.00	3.09
47	300072	三聚环保	341,495.86	3.08
48	600366	宁波韵升	341,313.00	3.08
49	002242	九阳股份	341,146.00	3.08
50	600456	宝钛股份	340,247.66	3.07
51	603077	和邦生物	339,854.00	3.07
52	600729	重庆百货	339,755.00	3.07
53	002503	搜于特	339,544.00	3.06
54	000786	北新建材	339,412.27	3.06
55	600618	氯碱化工	339,344.00	3.06

56	002223	鱼跃医疗	338,013.24	3.05
57	601000	唐山港	337,405.00	3.04
58	000762	西藏矿业	336,458.00	3.04
59	002271	东方雨虹	336,372.00	3.04
60	600468	百利电气	336,281.00	3.03
61	600094	大名城	336,263.00	3.03
62	600864	哈投股份	336,141.00	3.03
63	002340	格林美	335,191.35	3.02
64	300026	红日药业	334,884.00	3.02
65	000587	金洲慈航	333,342.88	3.01
66	002353	杰瑞股份	333,278.17	3.01
67	300115	长盈精密	333,219.00	3.01
68	000501	鄂武商 A	332,962.90	3.00
69	000543	皖能电力	332,798.00	3.00
70	600557	康缘药业	332,622.00	3.00
71	002216	三全食品	332,509.00	3.00
72	603568	伟明环保	332,401.87	3.00
73	000581	威孚高科	332,181.00	3.00
74	600655	豫园商城	331,943.00	3.00
75	002327	富安娜	331,649.03	2.99
76	002293	罗莱生活	331,572.50	2.99
77	600067	冠城大通	330,749.00	2.98
78	600348	阳泉煤业	330,569.95	2.98
79	600059	古越龙山	330,344.00	2.98
80	002191	劲嘉股份	330,006.00	2.98
81	600851	海欣股份	329,894.58	2.98
82	600161	天坛生物	329,754.00	2.98
83	603589	口子窖	329,602.60	2.97
84	000426	兴业矿业	329,354.00	2.97
85	002179	中航光电	329,004.54	2.97
86	600200	江苏吴中	328,856.00	2.97
87	600195	中牧股份	328,788.00	2.97
88	600805	悦达投资	328,766.00	2.97
89	600528	中铁二局	328,529.00	2.96
90	600611	大众交通	328,120.00	2.96
91	000012	南玻 A	327,975.00	2.96

92	600176	中国巨石	327,873.60	2.96
93	300134	大富科技	327,694.75	2.96
94	600884	杉杉股份	327,567.00	2.96
95	002078	太阳纸业	327,486.29	2.95
96	000661	长春高新	327,471.80	2.95
97	002277	友阿股份	327,390.00	2.95
98	600143	金发科技	327,364.00	2.95
99	600435	北方导航	327,000.00	2.95
100	000816	智慧农业	326,828.00	2.95
101	600563	法拉电子	326,809.00	2.95
102	002325	洪涛股份	326,628.84	2.95
103	002714	牧原股份	326,158.00	2.94
104	002281	光迅科技	325,995.38	2.94
105	600754	锦江股份	325,969.00	2.94
106	601908	京运通	325,318.00	2.94
107	600132	重庆啤酒	325,089.00	2.93
108	000066	长城电脑	324,907.00	2.93
109	002595	豪迈科技	324,764.00	2.93
110	000552	靖远煤电	324,480.00	2.93
111	600458	时代新材	324,422.00	2.93
112	000513	丽珠集团	324,398.41	2.93
113	601012	隆基股份	324,375.00	2.93
114	600522	中天科技	324,366.00	2.93
115	002698	博实股份	324,340.00	2.93
116	600694	大商股份	324,313.00	2.93
117	002665	首航节能	324,236.00	2.93
118	600664	哈药股份	324,210.81	2.93
119	600970	中材国际	324,108.00	2.92
120	600312	平高电气	323,709.00	2.92
121	000939	凯迪生态	323,563.54	2.92
122	000550	江铃汽车	323,556.00	2.92
123	600466	蓝光发展	323,483.00	2.92
124	000671	阳光城	323,381.00	2.92
125	002317	众生药业	323,242.02	2.92
126	601678	滨化股份	323,181.80	2.92
127	000869	张裕 A	323,170.43	2.92

128	000488	晨鸣纸业	322,999.00	2.91
129	601226	华电重工	322,935.00	2.91
130	000656	金科股份	322,789.00	2.91
131	300001	特锐德	322,658.05	2.91
132	600826	兰生股份	322,614.43	2.91
133	000998	隆平高科	322,492.00	2.91
134	300274	阳光电源	322,373.16	2.91
135	002727	一心堂	322,141.00	2.91
136	000703	恒逸石化	321,983.00	2.91
137	600201	生物股份	321,928.00	2.90
138	002051	中工国际	321,491.00	2.90
139	600138	中青旅	321,394.00	2.90
140	600004	白云机场	321,240.10	2.90
141	002244	滨江集团	321,090.00	2.90
142	601965	中国汽研	320,888.52	2.90
143	600108	亚盛集团	320,770.00	2.89
144	600056	中国医药	320,750.00	2.89
145	601002	晋亿实业	320,671.00	2.89
146	601126	四方股份	320,558.00	2.89
147	603698	航天工程	320,486.00	2.89
148	600872	中炬高新	320,306.00	2.89
149	603001	奥康国际	320,299.46	2.89
150	000897	津滨发展	320,236.00	2.89
151	000600	建投能源	320,008.84	2.89
152	000400	许继电气	319,870.53	2.89
153	600409	三友化工	319,867.00	2.89
154	002461	珠江啤酒	319,721.00	2.88
155	600487	亨通光电	319,709.00	2.88
156	603699	纽威股份	319,569.00	2.88
157	600761	安徽合力	319,553.74	2.88
158	002588	史丹利	319,535.00	2.88
159	600496	精工钢构	319,535.00	2.88
160	002064	华峰氨纶	319,368.00	2.88
161	002285	世联行	319,349.00	2.88
162	601155	新城控股	319,269.40	2.88
163	600572	康恩贝	318,935.00	2.88

164	002701	奥瑞金	318,895.00	2.88
165	002344	海宁皮城	318,793.00	2.88
166	600426	华鲁恒升	318,561.00	2.87
167	600284	浦东建设	318,559.00	2.87
168	000008	神州高铁	318,372.00	2.87
169	000973	佛塑科技	318,346.00	2.87
170	601717	郑煤机	318,182.00	2.87
171	600510	黑牡丹	318,164.17	2.87
172	603169	兰石重装	318,148.22	2.87
173	600325	华发股份	318,090.11	2.87
174	600478	科力远	317,937.00	2.87
175	600280	中央商场	317,857.00	2.87
176	000877	天山股份	317,852.00	2.87
177	601515	东风股份	317,685.92	2.87
178	600811	东方集团	317,682.00	2.87
179	002128	露天煤业	317,566.00	2.87
180	600397	安源煤业	317,277.00	2.86
181	000612	焦作万方	317,254.00	2.86
182	600808	马钢股份	317,213.26	2.86
183	600673	东阳光科	317,198.00	2.86
184	000030	富奥股份	317,051.00	2.86
185	002678	珠江钢琴	316,926.90	2.86
186	002073	软控股份	316,774.00	2.86
187	600498	烽火通信	316,597.00	2.86
188	600416	湘电股份	316,175.00	2.85
189	600039	四川路桥	316,165.00	2.85
190	000667	美好集团	316,049.00	2.85
191	601880	大连港	315,932.00	2.85
192	000900	现代投资	315,910.36	2.85
193	600236	桂冠电力	315,793.00	2.85
194	600509	天富能源	315,647.00	2.85
195	002368	太极股份	315,538.67	2.85
196	000979	中弘股份	315,533.00	2.85
197	002444	巨星科技	315,400.00	2.85
198	002251	步步高	315,366.00	2.85
199	000758	中色股份	315,351.00	2.85

200	000926	福星股份	315,178.68	2.84
201	600125	铁龙物流	315,102.48	2.84
202	601666	平煤股份	314,769.00	2.84
203	600320	振华重工	314,711.00	2.84
204	002025	航天电器	314,660.75	2.84
205	300039	上海凯宝	314,654.56	2.84
206	600801	华新水泥	314,628.88	2.84
207	600894	广日股份	314,564.00	2.84
208	600971	恒源煤电	314,529.00	2.84
209	600787	中储股份	314,497.84	2.84
210	000697	炼石有色	314,485.00	2.84
211	002428	云南锗业	314,233.00	2.84
212	600289	亿阳信通	314,167.00	2.83
213	002276	万马股份	314,066.01	2.83
214	000021	深科技	314,009.00	2.83
215	000830	鲁西化工	313,882.00	2.83
216	600270	外运发展	313,832.02	2.83
217	600874	创业环保	313,783.00	2.83
218	600720	祁连山	313,775.65	2.83
219	000685	中山公用	313,764.00	2.83
220	000088	盐田港	313,605.00	2.83
221	600743	华远地产	313,601.00	2.83
222	600425	青松建化	313,594.00	2.83
223	002122	天马股份	313,502.00	2.83
224	600187	国中水务	313,404.50	2.83
225	002342	巨力索具	313,344.88	2.83
226	000572	海马汽车	313,337.00	2.83
227	600026	中海发展	313,325.00	2.83
228	600639	浦东金桥	313,315.00	2.83
229	000983	西山煤电	313,271.00	2.83
230	000417	合肥百货	313,196.13	2.83
231	600017	日照港	313,134.00	2.83
232	600823	世茂股份	313,024.00	2.82
233	002390	信邦制药	312,974.00	2.82
234	600335	国机汽车	312,915.00	2.82
235	002498	汉缆股份	312,869.02	2.82

236	002589	瑞康医药	312,625.88	2.82
237	000049	德赛电池	312,567.00	2.82
238	600835	上海机电	312,533.38	2.82
239	603555	贵人鸟	312,447.66	2.82
240	600628	新世界	312,409.64	2.82
241	600790	轻纺城	312,321.00	2.82
242	002345	潮宏基	312,098.00	2.82
243	600141	兴发集团	312,062.00	2.82
244	600251	冠农股份	311,921.00	2.81
245	002005	德豪润达	311,846.38	2.81
246	002400	省广股份	311,839.00	2.81
247	600717	天津港	311,773.00	2.81
248	002640	跨境通	311,766.00	2.81
249	002308	威创股份	311,691.00	2.81
250	002028	思源电气	311,666.00	2.81
251	600300	维维股份	311,636.00	2.81
252	600517	置信电气	311,559.00	2.81
253	600277	亿利洁能	311,526.00	2.81
254	600180	瑞茂通	311,446.01	2.81
255	600831	广电网络	311,435.00	2.81
256	601001	大同煤业	311,430.00	2.81
257	600580	卧龙电气	311,395.00	2.81
258	002354	天神娱乐	311,366.00	2.81
259	600282	南钢股份	311,366.00	2.81
260	300055	万邦达	311,298.00	2.81
261	002267	陕天然气	311,204.46	2.81
262	601369	陕鼓动力	311,110.37	2.81
263	600169	太原重工	311,102.00	2.81
264	600575	皖江物流	311,099.00	2.81
265	600687	刚泰控股	311,029.00	2.81
266	002254	泰和新材	310,907.00	2.81
267	600166	福田汽车	310,880.00	2.81
268	600482	中国动力	310,876.00	2.80
269	002426	胜利精密	310,860.00	2.80
270	600292	远达环保	310,667.00	2.80
271	300010	立思辰	310,569.00	2.80

272	600422	昆药集团	310,540.00	2.80
273	600483	福能股份	310,437.00	2.80
274	600266	北京城建	310,337.00	2.80
275	600765	中航重机	310,300.81	2.80
276	600428	中远航运	310,228.00	2.80
277	600536	中国软件	310,147.00	2.80
278	000690	宝新能源	310,142.00	2.80
279	600380	健康元	310,075.00	2.80
280	600594	益佰制药	309,999.00	2.80
281	600220	江苏阳光	309,945.00	2.80
282	002414	高德红外	309,937.00	2.80
283	000961	中南建设	309,814.00	2.80
284	600316	洪都航空	309,799.75	2.80
285	600329	中新药业	309,796.00	2.80
286	002004	华邦健康	309,671.00	2.79
287	002392	北京利尔	309,576.00	2.79
288	600503	华丽家族	309,528.00	2.79
289	002029	七匹狼	309,479.50	2.79
290	603025	大豪科技	309,473.00	2.79
291	603198	迎驾贡酒	309,442.50	2.79
292	002233	塔牌集团	309,376.13	2.79
293	000598	兴蓉环境	309,256.00	2.79
294	000681	视觉中国	309,190.00	2.79
295	600219	南山铝业	309,096.00	2.79
296	000031	中粮地产	309,053.00	2.79
297	600499	科达洁能	309,045.00	2.79
298	002050	三花股份	308,923.00	2.79
299	002038	双鹭药业	308,907.00	2.79
300	600657	信达地产	308,884.59	2.79
301	603005	晶方科技	308,868.00	2.79
302	600351	亚宝药业	308,864.00	2.79
303	600596	新安股份	308,845.21	2.79
304	601010	文峰股份	308,781.00	2.79
305	601929	吉视传媒	308,775.57	2.79
306	600183	生益科技	308,614.00	2.78
307	600812	华北制药	308,589.00	2.78

308	600064	南京高科	308,452.00	2.78
309	000726	鲁泰 A	308,437.77	2.78
310	002131	利欧股份	308,388.00	2.78
311	000930	中粮生化	308,349.53	2.78
312	002092	中泰化学	308,316.00	2.78
313	000006	深振业 A	308,279.00	2.78
314	600881	亚泰集团	308,206.00	2.78
315	002238	天威视讯	308,082.00	2.78
316	300202	聚龙股份	307,977.34	2.78
317	600073	上海梅林	307,970.00	2.78
318	600635	大众公用	307,904.00	2.78
319	000878	云南铜业	307,810.87	2.78
320	600410	华胜天成	307,608.50	2.78
321	600151	航天机电	307,605.00	2.78
322	002022	科华生物	307,516.00	2.77
323	000652	泰达股份	307,432.89	2.77
324	601777	力帆股份	307,376.00	2.77
325	601699	潞安环能	307,038.00	2.77
326	600267	海正药业	307,027.00	2.77
327	300088	长信科技	306,954.00	2.77
328	000829	天音控股	306,657.00	2.77
329	600500	中化国际	306,624.00	2.77
330	002332	仙琚制药	306,338.00	2.76
331	002011	盾安环境	306,201.00	2.76
332	000528	柳工	306,151.84	2.76
333	600184	光电股份	306,112.00	2.76
334	601886	江河集团	306,080.00	2.76
335	600436	片仔癀	306,015.30	2.76
336	600776	东方通信	306,004.00	2.76
337	600240	华业资本	305,967.00	2.76
338	600160	巨化股份	305,897.00	2.76
339	002013	中航机电	305,651.00	2.76
340	001696	宗申动力	305,614.69	2.76
341	600507	方大特钢	305,580.00	2.76
342	600825	新华传媒	305,363.00	2.76
343	000919	金陵药业	305,301.84	2.75

344	000777	中核科技	304,884.00	2.75
345	600079	人福医药	304,747.00	2.75
346	600850	华东电脑	304,570.00	2.75
347	600617	国新能源	304,449.18	2.75
348	300273	和佳股份	304,339.00	2.75
349	600643	爱建集团	304,328.00	2.75
350	000631	顺发恒业	304,182.50	2.74
351	300287	飞利信	304,061.36	2.74
352	002118	紫鑫药业	304,040.81	2.74
353	600748	上实发展	304,018.00	2.74
354	000861	海印股份	303,843.50	2.74
355	002194	武汉凡谷	303,807.00	2.74
356	002440	闰土股份	303,803.00	2.74
357	603019	中科曙光	303,770.00	2.74
358	000937	冀中能源	303,387.00	2.74
359	002250	联化科技	303,335.00	2.74
360	002358	森源电气	303,244.00	2.74
361	600112	天成控股	303,040.30	2.73
362	000931	中关村	302,812.00	2.73
363	002479	富春环保	302,576.00	2.73
364	000680	山推股份	302,186.00	2.73
365	002315	焦点科技	302,162.00	2.73
366	002041	登海种业	301,974.00	2.72
367	600601	方正科技	301,682.00	2.72
368	600869	智慧能源	301,096.00	2.72
369	600682	南京新百	300,981.00	2.72
370	600967	北方创业	300,702.66	2.71
371	002002	鸿达兴业	300,577.00	2.71
372	300147	香雪制药	300,496.00	2.71
373	002396	星网锐捷	300,476.00	2.71
374	002439	启明星辰	300,235.50	2.71
375	000090	天健集团	300,233.93	2.71
376	600516	方大炭素	300,110.00	2.71
377	600388	龙净环保	299,990.00	2.71
378	002603	以岭药业	299,877.00	2.71
379	600481	双良节能	299,834.00	2.71

380	000887	中鼎股份	299,833.00	2.71
381	600565	迪马股份	299,666.00	2.70
382	002221	东华能源	299,458.00	2.70
383	600062	华润双鹤	299,178.00	2.70
384	600433	冠豪高新	299,177.00	2.70
385	002646	青青稞酒	299,010.00	2.70
386	002161	远望谷	298,569.00	2.69
387	600750	江中药业	298,487.00	2.69
388	300182	捷成股份	298,477.00	2.69
389	600537	亿晶光电	298,381.00	2.69
390	601801	皖新传媒	298,215.52	2.69
391	600587	新华医疗	298,206.00	2.69
392	000616	海航投资	298,076.53	2.69
393	603355	莱克电气	297,860.00	2.69
394	000566	海南海药	297,687.36	2.69
395	300199	翰宇药业	297,652.00	2.69
396	600917	重庆燃气	297,568.00	2.68
397	600158	中体产业	297,397.00	2.68
398	002375	亚厦股份	297,361.00	2.68
399	002551	尚荣医疗	297,007.00	2.68
400	002437	誉衡药业	297,002.00	2.68
401	002573	清新环境	296,973.00	2.68
402	002063	远光软件	296,912.36	2.68
403	600586	金晶科技	296,815.00	2.68
404	600755	厦门国贸	296,696.00	2.68
405	000669	金鸿能源	296,540.00	2.68
406	000727	华东科技	296,526.00	2.68
407	002269	美邦服饰	296,480.00	2.68
408	002657	中科金财	296,445.00	2.67
409	600198	大唐电信	296,183.00	2.67
410	600171	上海贝岭	295,759.00	2.67
411	002030	达安基因	295,753.06	2.67
412	600633	浙报传媒	295,620.00	2.67
413	600879	航天电子	295,409.75	2.67
414	000099	中信海直	295,288.00	2.66
415	300244	迪安诊断	295,261.00	2.66

416	603328	依顿电子	295,097.00	2.66
417	603766	隆鑫通用	294,981.00	2.66
418	002310	东方园林	294,699.00	2.66
419	603883	老百姓	293,903.00	2.65
420	601233	桐昆股份	293,332.00	2.65
421	000062	深圳华强	293,257.50	2.65
422	002745	木林森	293,174.00	2.65
423	002489	浙江永强	293,120.00	2.64
424	600757	长江传媒	293,081.00	2.64
425	000541	佛山照明	292,881.60	2.64
426	002405	四维图新	292,621.00	2.64
427	300253	卫宁健康	292,459.23	2.64
428	600773	西藏城投	292,238.00	2.64
429	002261	拓维信息	291,627.21	2.63
430	000970	中科三环	291,558.00	2.63
431	600978	宜华生活	290,858.79	2.62
432	002602	世纪华通	289,849.00	2.62
433	002384	东山精密	289,525.48	2.61
434	002093	国脉科技	289,217.00	2.61
435	002410	广联达	289,165.00	2.61
436	600088	中视传媒	288,885.84	2.61
437	600651	飞乐音响	288,645.00	2.60
438	600551	时代出版	288,618.00	2.60
439	002181	粤传媒	288,241.00	2.60
440	300291	华录百纳	288,101.72	2.60
441	000158	常山股份	287,727.00	2.60
442	002624	完美环球	287,686.00	2.60
443	600525	长园集团	287,485.00	2.59
444	002642	荣之联	287,443.00	2.59
445	600584	长电科技	286,207.00	2.58
446	000050	深天马 A	285,756.00	2.58
447	600759	洲际油气	284,127.00	2.56
448	002268	卫士通	284,070.00	2.56
449	600053	九鼎投资	281,233.92	2.54
450	600770	综艺股份	280,716.00	2.53
451	002699	美盛文化	280,383.00	2.53

452	300113	顺网科技	279,760.00	2.52
453	002309	中利科技	279,367.00	2.52
454	601311	XD 骆驼股	278,622.00	2.51
455	002106	莱宝高科	278,396.00	2.51
456	603188	亚邦股份	278,002.30	2.51
457	002463	沪电股份	277,912.00	2.51
458	600993	马应龙	277,179.00	2.50
459	002049	紫光国芯	276,916.00	2.50
460	002217	合力泰	274,632.00	2.48
461	600058	五矿发展	274,303.00	2.48
462	000810	创维数字	274,177.20	2.47
463	002681	奋达科技	274,173.44	2.47
464	000519	江南红箭	273,497.21	2.47
465	600260	凯乐科技	273,444.00	2.47
466	002273	水晶光电	272,473.00	2.46
467	603567	珍宝岛	270,443.00	2.44
468	002512	达华智能	269,075.00	2.43
469	600623	华谊集团	268,357.00	2.42
470	600429	三元股份	264,711.00	2.39
471	600645	中源协和	264,208.00	2.38
472	000748	长城信息	263,590.00	2.38
473	600122	宏图高科	262,074.00	2.36
474	600859	王府井	260,191.00	2.35
475	002237	恒邦股份	258,018.00	2.33
476	300043	互动娱乐	255,983.00	2.31
477	300032	金龙机电	255,431.00	2.30
478	002408	齐翔腾达	252,489.00	2.28
479	600460	士兰微	251,702.00	2.27
480	002180	艾派克	248,357.80	2.24
481	002174	游族网络	239,393.00	2.16

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净
----	------	------	----------	----------

				值比例 (%)
1	002237	恒邦股份	336,890.00	3.04
2	002174	游族网络	315,327.50	2.85
3	600429	三元股份	266,465.98	2.40
4	002180	艾派克	260,399.25	2.35
5	000603	盛达矿业	260,129.00	2.35
6	600074	保千里	241,226.00	2.18
7	600885	宏发股份	239,915.00	2.16
8	000933	*ST 神火	230,950.00	2.08
9	603899	晨光文具	227,779.00	2.06
10	600566	济川药业	226,105.00	2.04
11	002419	天虹商场	224,513.00	2.03
12	600816	安信信托	217,726.00	1.96
13	603369	今世缘	216,872.50	1.96
14	600997	开滦股份	216,575.20	1.95
15	002371	七星电子	211,438.00	1.91
16	000951	中国重汽	208,881.64	1.88
17	600376	首开股份	204,296.00	1.84
18	601139	深圳燃气	203,522.00	1.84
19	002140	东华科技	202,009.00	1.82
20	600803	新奥股份	196,668.82	1.77

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	160,425,727.88
卖出股票的收入（成交）总额	19,907,331.39

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

贵金属不在本基金投资范围内。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

股指期货不在本基金投资范围内。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货不在本基金投资范围内。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本基金投资国债期货的投资政策

国债期货不在本基金投资范围内。

7.11.2 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。

7.11.3 本基金投资国债期货的投资评价

国债期货不在本基金投资范围内。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	37,517.54
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,923.83
5	应收申购款	105,548.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	148,990.00

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 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。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	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 500 等权重指数分级 A	179	14,111.93	50,256.00	1.99%	2,475,780.00	98.01%
西部利得中证 500 等权重指	772	3,272.07	23,235.00	0.92%	2,502,801.00	99.08%

数分级 B						
西部利得 中证 500 等权重指 数分级	634	263,798.05	163,913,490.02	98.01%	3,334,471.11	1.99%
合计	1,434	120,153.44	163,986,981.02	95.18%	8,313,052.11	4.82%

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/个人投资者持有的份额占总份额的比例计算中，对下属分级基金，比例的分子采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用各分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

8.2 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	黄松友	1,405,350.00	55.63%
2	左彦升	229,800.00	9.10%
3	夏南凯	106,300.00	4.21%
4	董景秋	92,477.00	3.66%
5	范丽金	77,679.00	3.08%
6	高明桂	69,533.00	2.75%
7	向顺波	56,977.00	2.26%
8	周衡阳	33,000.00	1.31%
9	陈立	30,500.00	1.21%
10	朱清	27,350.00	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	李莉	250,000.00	9.90%
2	陈兵	140,100.00	5.55%
3	欧才	78,494.00	3.11%
4	王天舒	72,800.00	2.88%
5	李晟	53,076.00	2.10%
6	李秀莲	48,672.00	1.93%
7	张建明	46,900.00	1.86%
8	顾海峰	44,800.00	1.77%
9	巫剑飞	42,828.00	1.70%
10	谭新河	40,000.00	1.58%

8.3 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	0.0000%
	西部利得中证 500 等权重指数分级 B	0.00	0.0000%
	西部利得中证 500 等权重指数分级	0.00	0.0000%
	合计	0.00	0.0000%

8.4 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

§ 9 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	-	-	202,990,676.07
本报告期期初基金份额总额	2,168,136.00	2,168,136.00	5,244,148.73
本报告期基金总申购份额	-	-	168,535,360.49

减:本报告期基金总赎回份额	-	-	5,904,485.49
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	357,900.00	357,900.00	-627,062.60
本报告期期末基金份额总额	2,526,036.00	2,526,036.00	167,247,961.13

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开本基金份额持有人大会，无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

本报告期后，本基金管理人于 2016 年 7 月 7 日收到深圳市罗湖区人民法院就原告万科企业股份有限公司工会委员会诉本基金管理人损害股东利益责任纠纷一案的《民事诉讼状》。截止本公告送出日，本基金管理人正在按照法律程序积极应诉。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

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。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
西部证券	2	75,040,056.30	41.61%	39,869.40	36.41%	-
海通证券	1	50,025,930.94	27.74%	26,578.97	24.27%	-
中信建投	1	39,489,037.86	21.90%	36,776.27	33.59%	-
方正证券	2	8,893,305.59	4.93%	4,725.05	4.32%	-
银河证券	2	6,259,725.58	3.47%	1,010.67	0.92%	-
光大证券	1	315,218.00	0.17%	249.45	0.23%	-
申万宏源	2	309,785.00	0.17%	288.62	0.26%	-
平安证券	3	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-

注：1. 基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资力雄厚，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。

2. 报告期内新增交易单元为：

- (1) 平安证券
- (2) 东北证券
- (3) 国泰君安
- (4) 海通证券
- (5) 方正证券
- (6) 中泰证券
- (7) 光大证券
- (8) 中信建投

(9) 华泰证券

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
西部证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	西部利得基金管理有限公司关于旗下开放式基金 2015 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	2016 年 1 月 4 日
2	西部利得基金管理有限公司关于指数熔断机制实施后旗下基金开放时间调整的提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016 年 1 月 4 日
3	关于办理定期份额折算期间西部利得中证 500 等权重份额、西部利得中证 500 等权重 A 份额停牌公告	证券日报、公司网站	2016 年 1 月 5 日
4	关于西部利得中证 500 等权重 A 份额 2016 年度约定年基准收益率的公告	证券日报、公司网站	2016 年 1 月 5 日
5	西部利得基金管理有限公司指数熔断旗下基金开放时间调整公告	公司网站	2016 年 1 月 5 日
6	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结果及	证券日报、公司网站	2016 年 1 月 6 日

	恢复交易的公告		
7	西部利得基金管理有限公司指数熔断旗下基金开放时间调整公告	公司网站	2016 年 1 月 8 日
8	西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	证券日报、公司网站	2016 年 1 月 21 日
9	关于西部利得基金管理有限公司旗下基金持有的停牌股票调整估值的提示性公告-600000	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016 年 2 月 23 日
10	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-600499	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016 年 3 月 17 日
11	西部利得基金管理有限公司关于新增平安证券有限责任公司为代销机构并同时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	2016 年 3 月 22 日
12	西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金 2015 年度报告摘要	证券日报、公司网站	2016 年 3 月 30 日
13	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-002353	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016 年 3 月 30 日
14	西部利得基金管理有限公司关于新增国金证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016 年 4 月 7 日
15	西部利得基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银河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	2016 年 4 月 15 日
16	西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	证券日报、公司网站	2016 年 4 月 21 日
17	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	2016 年 5 月 3 日
18	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	2016 年 5 月 5 日
19	关于西部利得基金管理有限公司旗下基金持有的停牌股票调整估值的提示性公告-000401	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016 年 5 月 10 日
20	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(2016 年第 1 期)	证券日报、公司网站	2016 年 5 月 27 日
21	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	2016 年 6 月 15 日
22	西部利得基金管理有限公司关于旗下部分基金参与陆金所资管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	2016 年 6 月 28 日

§ 11 备查文件目录

11.1 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。

11.2 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

11.3 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
2016 年 8 月 24 日