

西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资 基金 2016 年年度报告 摘要

2016 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：二〇一七年三月三十一日

§ 1 重要提示

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 2017 年 3 月 30 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 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	199,907,958.03 份		
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所		
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
下属分级基金的场内简称	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	195,691,986.03 份	2,107,986.00 份	2,107,986.00 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</p>

	<p>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	赵毅	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

2.4 信息披露方式

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

§ 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	2016 年	2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日	2014 年
本期已实现收益	4,705,646.26	-23,815,032.77	-
本期利润	11,417,638.72	-24,002,824.02	-
加权平均基金份额本期利润	0.0939	-0.3454	-
本期基金份额净值增长率	-12.55%	-31.51%	-
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.8102	-0.7659	-
期末基金资产净值	200,068,567.71	11,082,924.46	-
期末基金份额净值	1.001	1.157	-

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
过去三个月	-0.33%	0.81%	-0.16%	0.82%	-0.17%	-0.01%
过去六个月	2.74%	0.90%	3.50%	0.89%	-0.76%	0.01%
过去一年	-12.55%	1.76%	-14.18%	1.83%	1.63%	-0.07%
自基金合同生效起至今	-40.10%	2.20%	-17.15%	2.42%	-22.95%	-0.22%

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：

$\text{benchmark}(0) = 1000$;

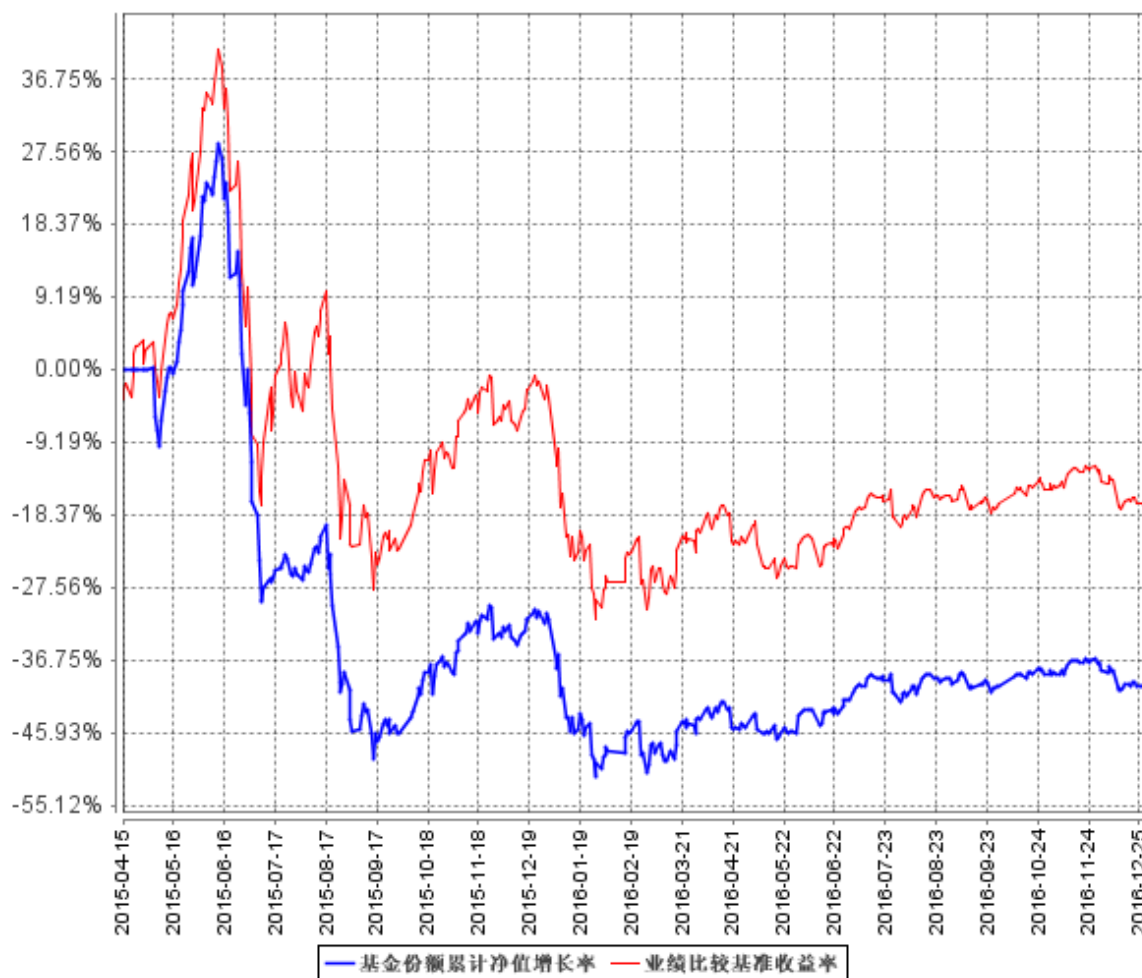
$\% \text{benchmark}(t) = 95\% * (\text{中证 500 等权重指数收益率}(t) / \text{中证 500 等权重指数收益率}(t-1) - 1) + 5\% * \text{商业银行人民币活期存款利率} / 365$;

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

其中 $t=1, 2, 3, \dots$ 。

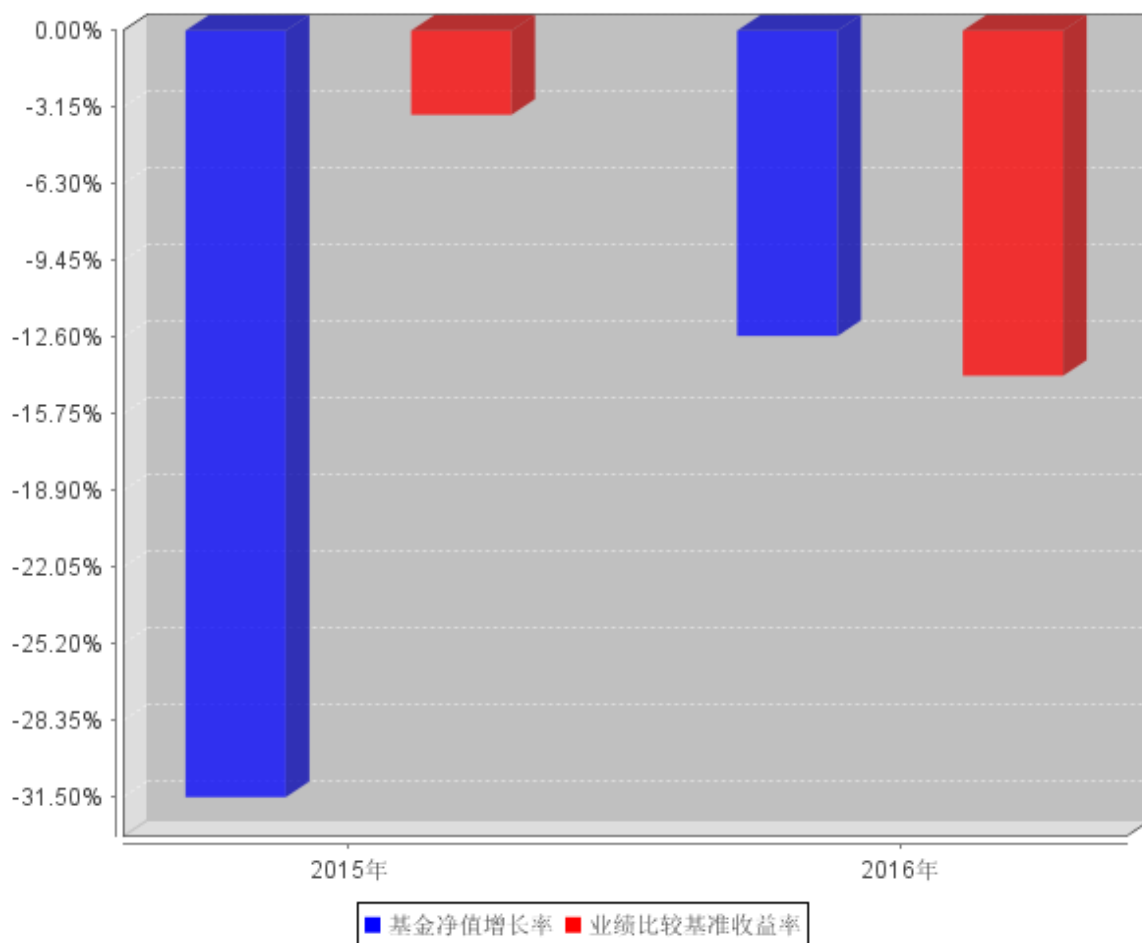
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



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，截至报告期末，本基金运作未满五年。
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利得科技有限公司合资设立，注册资本 3.5 亿元人民币，其中西部证券股份有限公司出资 51%，利得科技有

限公司出资 49%，注册地上海。

截至 2016 年 12 月 31 日，西部利得基金共管理十七只开放式基金——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、西部利得天添鑫货币市场基金、西部利得合享债券型证券投资基金、西部利得景瑞灵活配置混合型证券投资基金、西部利得合赢债券型证券投资基金、西部利得天添富货币市场基金、西部利得天添金货币市场基金、西部利得祥盈债券型证券投资基金、西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金、西部利得祥运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	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。
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。
盛丰衍	本基金基金经理	2016 年 11 月 24 日	-	三年	复旦大学理学硕士，曾任光大证券股份有限公司权益投资助理、上海光大证券资产管理有限公司研究员、兴证证券资产管

					理有限公司量化研究员。2016 年 10 月加入本公司，有基金从业资格，中国国籍。
盛丰衍	本基金基金经理助理	2016 年 10 月 25 日	2016 年 11 月 23 日	三年	复旦大学理学硕士，曾任光大证券股份有限公司权益投资助理、上海光大证券资产管理有限公司研究员、兴证证券资产管理有限公司量化研究员。2016 年 10 月加入本公司，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	2016 年 7 月 29 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》、本基金《基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人已根据《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》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，制定了公司《投资管理制度》、《交易部部门规章》、《公平交易管理办法》及《异常交易监控办法》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

回顾 2016 年，中证 500 等权重指数先抑后扬，整体收跌。年初受险资抛盘锁定 16 年收益的影响，A 股急跌触发熔断，市场信心大幅受挫。三月份开始市场逐步回暖，指数震荡上行。下半年开始，国内经济基本面改善进一步提振市场信心，川普事件冲击有限。而在年末，货币供给边际收缩带来的资金面压力又开始占据主导地位，随之而来的债市暴跌、广谱利率迅速上升拖累 A 股市场。

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。本基金于 11 月底开始参与网下打新，随着中签新股的上市预计 2017 年开始为本基金贡献额外新股收益。

我们根据日常申赎情况，对股票仓位及头寸进行了及时且合理的安排，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 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.001 元，本报告期份额净值增长率为-12.55%，同期业绩比较基准增长率为-14.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年 A 股不破难立。

实体经济受房地产销售放缓以及广谱利率抬升拖累；政策面从稳增长转向防风险；资金面受制于汇率及国内资产泡沫，资金回流美国进一步影响国内资金流动性，预计实际中性偏紧；综上所述短期保持谨慎。

下半年随着风险因素的释放利空得以充分消化，打好防守反击战。

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

估值委员会的成员包括投资部、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。

4.7 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

本报告期间，本基金存在超过连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人已向中国证监会报告本基金的解决方案。

截至本报告期末，本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	毕马威华振审字第 1700077 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	我们审计了后附的第 1 页至第 36 页的西部利得中证 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”）财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表、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	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：（1）按照中华人民共和国财政部颁布的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”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（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。	
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西部利得基金管理有限公司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	我们认为，西部利得中证 500 指数分级基金财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和在财务报表附注 2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了西部利得中证 500 指数分级基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果及基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	黄小熠	虞京京

会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	上海市南京西路 1266 号恒隆广场二期 16 层
审计报告日期	2017 年 3 月 30 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：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		11,640,069.09	829,281.87
结算备付金		32,350.85	1,873.48
存出保证金		49,409.05	51,256.84
交易性金融资产		188,759,283.42	10,373,589.19
其中：股票投资		188,759,283.42	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		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		11,903.02	219,901.82
应收利息		5,787.26	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		-	-
资产总计		200,498,802.69	11,480,462.88
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 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		-	-

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		172,026.04	9,679.07
应付托管费		34,405.21	1,935.81
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		39,803.73	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		184,000.00	220,339.72
负债合计		430,234.98	397,538.42
所有者权益：			
实收基金		334,275,651.61	16,171,245.52
未分配利润		-134,207,083.90	-5,088,321.06
所有者权益合计		200,068,567.71	11,082,924.46
负债和所有者权益总计		200,498,802.69	11,480,462.88

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.001 元，基金份额总额 199,907,958.03 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 1.050 元，基金份额总额 2,107,986.00 份；西部利得中证 500 等权重指数分级 B 的基金份额净值 0.952 元，基金份额总额 2,107,986.00 份；西部利得中证 500 等权重指数分级的基金份额净值 1.001 元，基金份额总额 195,691,986.03 份。

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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 4 月 15 日(基金 合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		13,539,495.61	-22,361,763.31
1.利息收入		138,015.61	375,973.94
其中：存款利息收入		138,015.61	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）		6,633,424.77	-23,215,143.56
其中：股票投资收益		5,775,060.27	-23,422,302.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		858,364.50	207,158.46
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		6,711,992.46	-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）		56,062.77	665,197.56
减：二、费用		2,121,856.89	1,641,060.71
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	1,198,536.30	439,513.79
2. 托管费	7.4.8.2.2	239,707.17	87,902.78
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		288,823.42	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		394,790.00	294,728.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,417,638.72	-24,002,824.02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,417,638.72	-24,002,824.02

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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	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（本期净	-	11,417,638.72	11,417,638.72

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)	318,104,406.09	-140,536,401.56	177,568,004.53
其中: 1. 基金申购款	342,789,598.82	-150,834,264.43	191,955,334.39
2. 基金赎回款	-24,685,192.73	10,297,862.87	-14,387,329.86
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)	334,275,651.61	-134,207,083.90	200,068,567.71
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 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(本期净利润)	-	-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 (净值减少以“-”号填列)	-186,819,430.55	18,914,502.96	-167,904,927.59
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

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

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

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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最近一年年度财务报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税字 [1998]55 号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税 [2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015]101 号《财政部 国家税务总局 证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2015] 125 号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

- (a) 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。
- (b) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- (c) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改

为缴纳增值税。

证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

对香港市场投资者（包括单位和个人）通过基金互认买卖内地基金份额免征增值税。

2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。因此，截至 2016 年 12 月 31 日，本基金没有计提有关增值税费用。

(d) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(e) 对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。

(f) 关于香港市场投资者通过基金互认买卖内地基金份额的所得税问题：

对香港市场投资者（包括企业和个人）通过基金互认买卖内地基金份额取得的转让差价所得，暂免征收所得税。

对香港市场投资者（包括企业和个人）通过基金互认从内地基金分配取得的收益，由内地上

市公司向该内地基金分配股息红利时,对香港市场投资者按照 10% 的税率代扣所得税;或发行债券的企业向该内地基金分配利息时,对香港市场投资者按照 7%的税率代扣所得税,并由内地上市公司或发行债券的企业向其主管税务机关办理扣缴申报。该内地基金向投资者分配收益时,不再扣缴所得税。

内地基金管理人应当向相关证券登记结算机构提供内地基金的香港市场投资者的相关信息。

(g)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。

(h)对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入,暂不征收个人所得税和企业所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
西部利得基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、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、基金代销机构
利得科技有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
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

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2015年4月15日(基金合同生效日)至 2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
西部证券	75,040,056.30	23.72%	-	-

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 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。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
西部证券	39,869.40	21.54%	-	-

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年4月15日(基金合同生效日) 至2015年12月31日
当期发生的基金应支付 的管理费	1,198,536.30	439,513.79
其中：支付销售机构的客 户维护费	4,398.79	17,913.27

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年4月15日(基金合同生效日) 至2015年12月31日
当期发生的基金应支付 的托管费	239,707.17	87,902.78

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。

7.4.8.3 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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.8.4.1 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运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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

西部利得中证 500 等权重指数分级				
关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
西部证券	26,758.00	0.0134%	0.00	0.0000%

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下属 A 类及 B 类份额。

7.4.8.5 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 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	11,640,069.09	126,247.73	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 2016 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 32,350.85 元。

7.4.8.6 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。

7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.10.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原	2016 年	2017 年	新股流	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-

	证券	2016 年 12 月 20 日	2017 年 1 月 3 日	通受限						
300583	赛托生物	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 6 日	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603877	太平鸟	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 9 日	新股流通受限	21.30	21.30	2,925	62,302.50	62,302.50	-
603689	皖天然气	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603266	天龙股份	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
603035	常熟汽饰	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股流通受限	10.44	10.44	2,040	21,297.60	21,297.60	-
603228	景旺电子	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股流通受限	23.16	23.16	883	20,450.28	20,450.28	-
300587	天铁股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 5 日	新股流通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
603186	华正新材	2016 年 12 月 26 日	2017 年 1 月 3 日	新股流通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股流通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美联新材	2016 年 12 月 26 日	2017 年 1 月 4 日	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	3.07	3.07	2,396	7,355.72	7,355.72	-
300588	熙菱信息	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股流通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

7.4.9.2 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
600161	天坛生物	2016年12月6日	临时停牌	39.40	-	-	12,800	388,072.50	504,320.00	-
002602	世纪华通	2016年12月15日	临时停牌	46.89	2017年1月9日	50.00	9,800	193,169.51	459,522.00	-
000563	陕国投 A	2016年10月14日	临时停牌	7.48	2017年1月18日	6.73	60,800	330,521.13	454,784.00	-
603555	贵人鸟	2016年12月12日	临时停牌	30.76	-	-	14,200	358,303.39	436,792.00	-
000887	中鼎股份	2016年11月18日	临时停牌	25.94	2017年2月15日	23.99	16,500	365,817.25	428,010.00	-
002025	航天电器	2016年9月12日	临时停牌	25.20	-	-	16,940	369,345.73	426,888.00	-
600655	豫园商城	2016年12月20日	临时停牌	11.42	-	-	35,000	398,933.72	399,700.00	-
000697	炼石有色	2016年11月17日	临时停牌	23.51	-	-	16,800	372,554.48	394,968.00	-
603169	兰石重装	2016年11月24日	临时停牌	13.36	-	-	29,100	361,414.02	388,776.00	-
000748	长城信息	2016年11月1日	临时停牌	20.31	-	-	19,140	350,580.76	388,733.40	-
600551	时代出版	2016年11月28日	临时停牌	20.32	-	-	19,100	347,369.31	388,112.00	-
600537	亿晶光电	2016年12月27日	临时停牌	7.43	2017年1月13日	8.17	52,122	381,093.07	387,266.46	-

300088	长信科技	2016年9月12日	临时停牌	15.80	-	-	24,400	312,271.68	385,520.00	-
002727	一心堂	2016年12月28日	临时停牌	21.20	2017年1月5日	21.66	18,100	403,435.92	383,720.00	-
002440	闰土股份	2016年10月24日	临时停牌	16.34	2017年1月12日	15.22	22,900	340,338.21	374,186.00	-
002396	星网锐捷	2016年9月12日	临时停牌	19.70	2017年2月21日	18.35	18,976	346,921.90	373,827.20	-
601168	西部矿业	2016年12月19日	临时停牌	7.83	-	-	47,700	386,265.08	373,491.00	-
002491	通鼎互联	2016年12月22日	临时停牌	15.54	2017年1月3日	15.89	24,000	393,066.90	372,960.00	-
600687	刚泰控股	2016年7月25日	临时停牌	16.42	2017年1月18日	16.38	22,500	358,961.22	369,450.00	-
002745	木林森	2016年7月18日	临时停牌	36.49	-	-	10,100	317,821.42	368,549.00	-
600673	东阳光科	2016年11月15日	临时停牌	7.29	-	-	50,500	336,654.40	368,145.00	-
002400	省广股份	2016年11月28日	临时停牌	13.79	-	-	26,690	367,164.99	368,055.10	-
002681	奋达科技	2016年12月19日	临时停牌	12.93	-	-	28,400	425,995.14	367,212.00	-
600151	航天机电	2016年11月11日	临时停牌	10.97	-	-	33,300	355,373.37	365,301.00	-
600171	上海贝岭	2016年12月14日	临时停牌	14.05	2017年2月16日	14.90	25,910	392,997.66	364,035.50	-
002635	安洁科技	2016年11月8日	临时停牌	36.40	2017年2月8日	33.50	9,800	318,730.77	356,720.00	-
600645	中源协和	2016年12月	临时停牌	26.80	-	-	13,300	437,663.50	356,440.00	-

		13 日								
000727	华东科技	2016 年 11 月 17 日	临时停牌	3.37	2017 年 2 月 15 日	3.47	105,100	339,243.18	354,187.00	-
000050	深天马 A	2016 年 9 月 12 日	临时停牌	18.82	-	-	16,500	317,748.08	310,530.00	-
000829	天音控股	2016 年 9 月 29 日	临时停牌	11.28	-	-	26,500	329,119.23	298,920.00	-
600859	王府井	2016 年 9 月 27 日	临时停牌	16.28	-	-	17,283	269,373.69	281,367.24	-
601005	重庆钢铁	2016 年 6 月 2 日	临时停牌	2.52	-	-	73,900	193,918.10	186,228.00	-
000547	航天发展	2016 年 6 月 13 日	临时停牌	15.36	2017 年 1 月 3 日	16.90	1,100	23,727.25	16,896.00	-
000693	ST 华泽	2016 年 3 月 1 日	临时停牌	12.50	-	-	1,000	18,518.72	12,500.00	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 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 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 176,272,204.30 元, 属于第二层级的余额为 12,487,079.12 元, 无属于第三层级的余额 (2015 年 12 月 31 日: 第一层级 9,360,376.15 元, 第二层级 1,013,213.04 元, 无第三层级)。

(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 2016 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	188,759,283.42	94.14
	其中: 股票	188,759,283.42	94.14
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	11,672,419.94	5.82

7	其他各项资产	67,099.33	0.03
8	合计	200,498,802.69	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境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,384,568.40	1.19
B	采矿业	7,156,835.80	3.58
C	制造业	112,751,797.48	56.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,485,849.40	3.24
E	建筑业	5,661,112.22	2.83
F	批发和零售业	12,595,000.49	6.30
G	交通运输、仓储和邮政业	5,280,716.40	2.64
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,335,776.82	5.17
J	金融业	1,206,700.70	0.60
K	房地产业	11,777,338.24	5.89
L	租赁和商务服务业	2,981,309.60	1.49
M	科学研究和技术服务业	728,905.00	0.36
N	水利、环境和公共设施管理业	1,130,255.70	0.56
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	395,626.00	0.20
Q	卫生和社会工作	343,680.00	0.17
R	文化、体育和娱乐业	3,770,895.64	1.88
S	综合	1,893,981.00	0.95
	合计	186,880,348.89	93.41

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	12,500.00	0.01
C	制造业	1,517,639.62	0.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.02
E	建筑业	15,592.23	0.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	9,458.68	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	179,046.34	0.09
J	金融业	106,780.00	0.05
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,878,934.53	0.94

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

8.3.1 指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600161	天坛生物	12,800	504,320.00	0.25
2	000612	焦作万方	42,200	487,410.00	0.24
3	600426	华鲁恒升	35,520	470,640.00	0.24
4	600409	三友化工	49,700	466,683.00	0.23
5	002602	世纪华通	9,800	459,522.00	0.23
6	000563	陕国投 A	60,800	454,784.00	0.23
7	000930	中粮生化	33,800	454,272.00	0.23

8	000939	凯迪生态	35,200	453,024.00	0.23
9	002018	华信国际	44,400	451,548.00	0.23
10	601678	滨化股份	61,460	448,043.40	0.22

8.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	000887	中鼎股份	16,500	428,010.00	0.21
2	601005	重庆钢铁	73,900	186,228.00	0.09
3	600996	贵广网络	9,166	172,229.14	0.09
4	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.06
5	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.05

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600120	浙江东方	699,055.00	6.31
2	002371	七星电子	635,851.00	5.74
3	002155	湖南黄金	632,223.50	5.70
4	603369	今世缘	615,134.29	5.55
5	600751	天海投资	605,993.00	5.47
6	000418	小天鹅 A	595,243.00	5.37
7	300134	大富科技	575,296.75	5.19
8	600022	山东钢铁	573,193.00	5.17
9	600392	盛和资源	570,424.00	5.15
10	002431	棕榈股份	561,662.00	5.07
11	300122	智飞生物	557,690.08	5.03
12	002122	天马股份	556,688.50	5.02
13	600259	广晟有色	554,375.00	5.00
14	600521	华海药业	553,317.66	4.99
15	600166	福田汽车	551,571.00	4.98
16	002508	老板电器	550,678.00	4.97
17	000426	兴业矿业	546,089.00	4.93

18	000969	安泰科技	545,805.00	4.92
19	000762	西藏矿业	545,631.00	4.92
20	002311	海大集团	544,959.00	4.92
21	002194	武汉凡谷	535,817.00	4.83
22	002482	广田集团	534,272.50	4.82
23	000596	古井贡酒	531,479.82	4.80
24	000703	恒逸石化	527,451.00	4.76
25	600743	华远地产	526,918.94	4.75
26	002466	天齐锂业	521,367.00	4.70
27	600809	山西汾酒	520,531.00	4.70
28	000860	顺鑫农业	519,718.00	4.69
29	002168	深圳惠程	517,967.70	4.67
30	600657	信达地产	515,506.59	4.65
31	600418	江淮汽车	514,081.00	4.64
32	600729	重庆百货	511,302.00	4.61
33	600409	三友化工	508,273.00	4.59
34	000631	顺发恒业	505,372.50	4.56
35	600395	盘江股份	503,468.00	4.54
36	600200	江苏吴中	502,022.00	4.53
37	600298	安琪酵母	501,582.00	4.53
38	600161	天坛生物	501,548.00	4.53
39	603589	口子窖	501,213.60	4.52
40	601168	西部矿业	498,640.00	4.50
41	000612	焦作万方	497,687.00	4.49
42	603019	中科曙光	497,011.00	4.48
43	002299	圣农发展	495,355.00	4.47
44	600435	北方导航	495,238.00	4.47
45	000988	华工科技	494,649.00	4.46
46	600639	浦东金桥	493,323.00	4.45
47	002161	远望谷	493,051.00	4.45
48	002477	雏鹰农牧	492,020.00	4.44
49	601801	皖新传媒	491,372.52	4.43
50	600175	美都能源	491,192.00	4.43
51	600216	浙江医药	489,400.00	4.42
52	002273	水晶光电	489,048.00	4.41
53	000513	丽珠集团	487,892.11	4.40

54	002310	东方园林	486,142.00	4.39
55	600618	氯碱化工	485,582.00	4.38
56	600366	宁波韵升	485,207.00	4.38
57	002190	成飞集成	484,954.00	4.38
58	002048	宁波华翔	484,363.00	4.37
59	000973	佛塑科技	483,968.00	4.37
60	600094	大名城	483,808.00	4.37
61	600528	中铁二局	483,188.00	4.36
62	002512	达华智能	482,956.64	4.36
63	000078	海王生物	482,721.00	4.36
64	600880	博瑞传播	482,549.00	4.35
65	300072	三聚环保	482,223.86	4.35
66	002366	台海核电	481,828.00	4.35
67	002271	东方雨虹	480,925.00	4.34
68	002588	史丹利	478,722.00	4.32
69	601155	新城控股	477,208.40	4.31
70	002285	世联行	476,910.00	4.30
71	601001	大同煤业	475,649.00	4.29
72	600487	亨通光电	475,196.00	4.29
73	000810	创维数字	474,925.20	4.29
74	600006	东风汽车	474,838.00	4.28
75	600971	恒源煤电	474,695.00	4.28
76	600180	瑞茂通	473,023.01	4.27
77	601699	潞安环能	472,792.00	4.27
78	000786	北新建材	472,461.27	4.26
79	600699	均胜电子	471,893.90	4.26
80	300113	顺网科技	470,321.00	4.24
81	600851	海欣股份	469,820.58	4.24
82	002444	巨星科技	469,409.00	4.24
83	002439	启明星辰	468,065.60	4.22
84	002001	新 和 成	467,696.00	4.22
85	002635	安洁科技	467,414.00	4.22
86	000983	西山煤电	467,274.00	4.22
87	600478	科力远	466,726.00	4.21
88	600416	湘电股份	465,961.00	4.20
89	600750	江中药业	465,772.86	4.20

90	000656	金科股份	465,476.00	4.20
91	002681	奋达科技	465,259.44	4.20
92	000652	泰达股份	465,168.89	4.20
93	002056	横店东磁	464,548.10	4.19
94	002276	万马股份	463,954.01	4.19
95	600736	苏州高新	463,646.00	4.18
96	002572	索菲亚	463,503.00	4.18
97	300287	飞利信	463,346.36	4.18
98	300166	东方国信	461,831.00	4.17
99	300202	聚龙股份	461,673.74	4.17
100	600584	长电科技	461,441.00	4.16
101	000961	中南建设	461,248.00	4.16
102	000937	冀中能源	461,069.00	4.16
103	600522	中天科技	460,902.00	4.16
104	002051	中工国际	459,898.40	4.15
105	002340	格林美	459,781.35	4.15
106	600122	宏图高科	459,734.00	4.15
107	002640	跨境通	459,505.00	4.15
108	601666	平煤股份	458,019.00	4.13
109	601012	隆基股份	456,996.00	4.12
110	600640	号百控股	456,642.00	4.12
111	002368	太极股份	456,367.67	4.12
112	600348	阳泉煤业	455,950.95	4.11
113	002128	露天煤业	455,177.00	4.11
114	603005	晶方科技	455,029.00	4.11
115	002038	双鹭药业	454,860.00	4.10
116	603198	迎驾贡酒	454,544.50	4.10
117	002074	国轩高科	454,248.00	4.10
118	300055	万邦达	453,425.00	4.09
119	002727	一心堂	453,056.00	4.09
120	300032	金龙机电	452,981.00	4.09
121	600563	法拉电子	452,866.00	4.09
122	002179	中航光电	452,712.54	4.08
123	000620	新华联	452,549.00	4.08
124	000566	海南海药	451,412.36	4.07
125	000848	承德露露	451,341.04	4.07

126	600497	驰宏锌锗	450,585.15	4.07
127	600655	豫园商城	450,374.00	4.06
128	600645	中源协和	449,870.00	4.06
129	000488	晨鸣纸业	449,780.00	4.06
130	300274	阳光电源	448,889.16	4.05
131	002131	利欧股份	448,851.00	4.05
132	000158	常山股份	448,805.00	4.05
133	603806	福斯特	448,698.00	4.05
134	000930	中粮生化	448,662.53	4.05
135	600320	振华重工	448,109.00	4.04
136	002384	东山精密	447,494.48	4.04
137	600058	五矿发展	447,494.00	4.04
138	600536	中国软件	447,461.00	4.04
139	300291	华录百纳	447,448.72	4.04
140	600073	上海梅林	447,332.00	4.04
141	601000	唐山港	446,694.00	4.03
142	000581	威孚高科	446,651.00	4.03
143	600086	东方金钰	446,641.00	4.03
144	002317	众生药业	446,638.02	4.03
145	002254	泰和新材	446,597.00	4.03
146	002428	云南锗业	446,414.00	4.03
147	600614	鹏起科技	446,266.00	4.03
148	600183	生益科技	446,255.00	4.03
149	002405	四维图新	446,181.00	4.03
150	000997	新大陆	446,068.00	4.02
151	000031	中粮地产	446,065.00	4.02
152	600195	中牧股份	445,939.51	4.02
153	002281	光迅科技	445,668.38	4.02
154	600500	中化国际	445,348.00	4.02
155	000400	许继电气	445,138.53	4.02
156	000592	平潭发展	445,074.00	4.02
157	600240	华业资本	444,847.00	4.01
158	002309	中利集团	444,773.00	4.01
159	002308	威创股份	444,697.95	4.01
160	000550	江铃汽车	444,690.00	4.01
161	300199	翰宇药业	444,395.00	4.01

162	002085	万丰奥威	443,932.00	4.01
163	000021	深科技	443,525.00	4.00
164	603698	航天工程	443,275.00	4.00
165	002503	搜于特	442,555.00	3.99
166	600597	光明乳业	442,471.00	3.99
167	002646	青青稞酒	441,543.00	3.98
168	601777	力帆股份	441,518.00	3.98
169	600160	巨化股份	441,425.00	3.98
170	601678	滨化股份	441,362.80	3.98
171	600184	光电股份	441,237.00	3.98
172	002642	荣之联	441,159.00	3.98
173	000681	视觉中国	441,064.00	3.98
174	601965	中国汽研	441,028.52	3.98
175	600436	片仔癀	441,013.30	3.98
176	000758	中色股份	440,722.00	3.98
177	600601	方正科技	440,688.00	3.98
178	002358	森源电气	440,520.00	3.97
179	000552	靖远煤电	440,479.00	3.97
180	300043	星辉娱乐	440,460.00	3.97
181	600277	亿利洁能	440,312.00	3.97
182	600325	华发股份	440,282.11	3.97
183	300001	特锐德	439,736.05	3.97
184	603568	伟明环保	439,501.87	3.97
185	600869	智慧能源	439,407.00	3.96
186	002437	誉衡药业	439,403.50	3.96
187	002022	科华生物	439,051.00	3.96
188	600864	哈投股份	438,985.00	3.96
189	600198	大唐电信	438,903.00	3.96
190	002698	博实股份	438,428.00	3.96
191	600458	时代新材	438,031.00	3.95
192	600770	综艺股份	437,984.00	3.95
193	600468	百利电气	437,823.00	3.95
194	000519	中兵红箭	437,757.21	3.95
195	000563	陕国投 A	437,538.00	3.95
196	600289	亿阳信通	436,982.00	3.94
197	600270	外运发展	436,928.02	3.94

198	600335	国机汽车	436,819.00	3.94
199	600611	大众交通	436,771.00	3.94
200	600433	冠豪高新	435,810.00	3.93
201	600917	重庆燃气	434,920.00	3.92
202	600884	杉杉股份	434,674.00	3.92
203	002602	世纪华通	434,189.00	3.92
204	000501	鄂武商 A	433,879.90	3.91
205	002325	洪涛股份	433,505.84	3.91
206	000028	国药一致	433,320.00	3.91
207	002266	浙富控股	433,296.05	3.91
208	002589	瑞康医药	433,284.88	3.91
209	002354	天神娱乐	432,974.00	3.91
210	002223	鱼跃医疗	432,803.24	3.91
211	600970	中材国际	432,188.00	3.90
212	000970	中科三环	432,110.00	3.90
213	600879	航天电子	432,042.75	3.90
214	002013	中航机电	431,872.00	3.90
215	600187	国中水务	431,499.50	3.89
216	600456	宝钛股份	430,895.66	3.89
217	002390	信邦制药	430,362.00	3.88
218	000006	深振业 A	430,090.00	3.88
219	600351	亚宝药业	429,607.00	3.88
220	600580	卧龙电气	429,347.00	3.87
221	002663	普邦股份	429,186.00	3.87
222	002242	九阳股份	429,183.00	3.87
223	000869	张裕 A	429,130.43	3.87
224	600176	中国巨石	429,109.60	3.87
225	002699	美盛文化	428,821.31	3.87
226	300010	立思辰	428,811.00	3.87
227	002261	拓维信息	428,605.21	3.87
228	603169	兰石重装	427,835.22	3.86
229	000998	隆平高科	427,794.30	3.86
230	603766	隆鑫通用	427,726.00	3.86
231	600059	古越龙山	427,507.00	3.86
232	600056	中国医药	427,168.00	3.85
233	002221	东华能源	426,545.00	3.85

234	002551	尚荣医疗	426,484.00	3.85
235	002327	富安娜	426,410.03	3.85
236	000049	德赛电池	426,256.00	3.85
237	002078	太阳纸业	425,963.29	3.84
238	002657	中科金财	425,585.00	3.84
239	000587	金洲慈航	425,259.88	3.84
240	600125	铁龙物流	423,630.48	3.82
241	001696	宗申动力	423,013.69	3.82
242	000661	长春高新	422,764.80	3.81
243	002373	千方科技	422,723.58	3.81
244	002701	奥瑞金	422,584.00	3.81
245	600201	生物股份	422,488.00	3.81
246	000099	中信海直	422,389.00	3.81
247	000066	长城电脑	422,173.00	3.81
248	603567	珍宝岛	421,979.00	3.81
249	600079	人福医药	421,649.00	3.80
250	601002	晋亿实业	421,602.00	3.80
251	300026	红日药业	421,573.00	3.80
252	002030	达安基因	421,217.06	3.80
253	600850	华东电脑	420,907.00	3.80
254	002238	天威视讯	420,443.60	3.79
255	000671	阳光城	420,232.00	3.79
256	600787	中储股份	420,171.84	3.79
257	002332	仙琚制药	419,953.00	3.79
258	600510	黑牡丹	419,798.17	3.79
259	002191	劲嘉股份	419,662.00	3.79
260	002414	高德红外	418,846.87	3.78
261	600026	中远海能	418,522.00	3.78
262	600498	烽火通信	418,495.00	3.78
263	600511	国药股份	418,415.00	3.78
264	600594	益佰制药	418,380.00	3.77
265	600260	凯乐科技	418,344.00	3.77
266	600557	康缘药业	417,608.00	3.77
267	002353	杰瑞股份	417,442.17	3.77
268	002375	亚厦股份	416,901.00	3.76
269	002268	卫士通	416,884.00	3.76

270	000012	南 玻 A	416,876.00	3.76
271	002400	省广股份	415,911.00	3.75
272	300257	开山股份	415,898.00	3.75
273	002595	豪迈科技	415,756.00	3.75
274	002678	珠江钢琴	415,327.90	3.75
275	002002	鸿达兴业	414,982.00	3.74
276	603077	和邦生物	414,569.00	3.74
277	002073	软控股份	414,551.00	3.74
278	603699	纽威股份	414,497.00	3.74
279	600776	东方通信	414,042.00	3.74
280	600132	重庆啤酒	413,812.00	3.73
281	600410	华胜天成	413,718.50	3.73
282	601908	京运通	413,533.00	3.73
283	600507	方大特钢	413,304.00	3.73
284	600643	爱建集团	412,731.00	3.72
285	300147	香雪制药	412,182.00	3.72
286	000030	富奥股份	412,057.00	3.72
287	600805	悦达投资	411,930.00	3.72
288	600219	南山铝业	411,928.00	3.72
289	600171	上海贝岭	411,848.00	3.72
290	600572	康恩贝	411,776.00	3.72
291	002345	潮宏基	411,757.00	3.72
292	600651	飞乐音响	411,732.00	3.72
293	000667	美好置业	411,662.00	3.71
294	002244	滨江集团	411,567.00	3.71
295	600628	新世界	411,326.64	3.71
296	600894	广日股份	410,924.00	3.71
297	600765	中航重机	410,537.80	3.70
298	600503	华丽家族	409,883.00	3.70
299	600664	哈药股份	408,898.81	3.69
300	600808	马钢股份	408,886.26	3.69
301	000008	神州高铁	408,684.00	3.69
302	000975	银泰资源	408,355.00	3.68
303	002041	登海种业	408,205.00	3.68
304	603188	亚邦股份	408,144.30	3.68
305	600482	中国动力	408,095.00	3.68

306	002092	中泰化学	407,689.00	3.68
307	600138	中青旅	407,614.00	3.68
308	002426	胜利精密	407,557.00	3.68
309	002410	广联达	407,523.00	3.68
310	601369	陕鼓动力	407,451.37	3.68
311	600537	亿晶光电	407,403.00	3.68
312	600428	中远海特	407,020.00	3.67
313	002249	大洋电机	406,610.00	3.67
314	002463	沪电股份	406,584.00	3.67
315	300039	上海凯宝	406,558.56	3.67
316	002269	美邦服饰	406,382.00	3.67
317	000680	山推股份	406,226.00	3.67
318	000829	天音控股	406,148.00	3.66
319	600596	新安股份	406,033.31	3.66
320	000541	佛山照明	405,912.60	3.66
321	002216	三全食品	405,845.00	3.66
322	002714	牧原股份	405,386.00	3.66
323	002011	盾安环境	405,123.00	3.66
324	000636	风华高科	404,873.00	3.65
325	000417	合肥百货	404,778.13	3.65
326	600338	西藏珠峰	404,696.00	3.65
327	002277	友阿股份	404,144.00	3.65
328	600720	祁连山	404,065.65	3.65
329	000861	海印股份	404,060.50	3.65
330	603001	奥康国际	404,027.46	3.65
331	601010	文峰股份	404,019.00	3.65
332	600266	北京城建	403,854.00	3.64
333	300253	卫宁健康	403,817.23	3.64
334	601929	吉视传媒	403,520.57	3.64
335	600017	日照港	403,413.00	3.64
336	000926	福星股份	403,188.68	3.64
337	002018	华信国际	403,133.00	3.64
338	002489	浙江永强	403,082.00	3.64
339	600575	皖江物流	403,080.00	3.64
340	600067	冠城大通	402,891.00	3.64
341	000979	中弘股份	402,788.00	3.63

342	002665	首航节能	402,114.00	3.63
343	002293	罗莱生活	401,848.50	3.63
344	000543	皖能电力	401,631.00	3.62
345	002573	清新环境	401,613.00	3.62
346	600220	江苏阳光	401,579.00	3.62
347	600682	南京新百	401,511.00	3.62
348	300115	长盈精密	401,133.00	3.62
349	000939	凯迪生态	400,897.54	3.62
350	600831	广电网络	400,706.00	3.62
351	600460	士兰微	400,623.00	3.61
352	600292	远达环保	400,375.00	3.61
353	603883	老百姓	399,587.00	3.61
354	600098	广州发展	399,439.00	3.60
355	600466	蓝光发展	399,437.00	3.60
356	002064	华峰氨纶	399,406.00	3.60
357	600062	华润双鹤	399,258.00	3.60
358	600088	中视传媒	399,127.84	3.60
359	600872	中炬高新	399,055.00	3.60
360	600267	海正药业	398,846.00	3.60
361	600826	兰生股份	398,381.43	3.59
362	002505	大康农业	398,324.60	3.59
363	300296	利亚德	398,000.00	3.59
364	600169	太原重工	397,981.00	3.59
365	002498	汉缆股份	397,872.02	3.59
366	600517	置信电气	397,191.00	3.58
367	002025	航天电器	396,995.75	3.58
368	600141	兴发集团	396,559.00	3.58
369	000877	天山股份	396,420.00	3.58
370	600978	宜华生活	396,143.79	3.57
371	600635	大众公用	396,041.00	3.57
372	600315	上海家化	396,030.00	3.57
373	002407	多氟多	396,016.00	3.57
374	600757	长江传媒	395,968.00	3.57
375	600312	平高电气	395,907.00	3.57
376	600967	北方创业	395,857.66	3.57
377	000878	云南铜业	395,687.87	3.57

378	300159	新研股份	395,651.00	3.57
379	600307	酒钢宏兴	395,543.00	3.57
380	600426	华鲁恒升	395,343.00	3.57
381	600586	金晶科技	395,165.00	3.57
382	002005	德豪润达	394,868.38	3.56
383	600483	福能股份	394,852.00	3.56
384	000825	太钢不锈	394,818.00	3.56
385	002460	赣锋锂业	394,101.00	3.56
386	000959	首钢股份	393,870.00	3.55
387	300182	捷成股份	393,729.00	3.55
388	600422	昆药集团	393,718.54	3.55
389	000726	鲁泰 A	393,709.77	3.55
390	600825	新华传媒	393,537.00	3.55
391	600549	厦门钨业	393,322.80	3.55
392	600748	上实发展	393,261.00	3.55
393	000572	海马汽车	393,177.00	3.55
394	002491	通鼎互联	393,066.90	3.55
395	000761	本钢板材	392,637.00	3.54
396	002416	爱施德	392,532.00	3.54
397	000600	建投能源	392,439.75	3.54
398	000897	津滨发展	392,216.00	3.54
399	000900	现代投资	392,117.36	3.54
400	000727	华东科技	391,881.00	3.54
401	600291	西水股份	391,810.00	3.54
402	601880	大连港	391,726.00	3.53
403	600761	安徽合力	391,674.74	3.53
404	601311	骆驼股份	391,190.00	3.53
405	300266	兴源环境	390,941.50	3.53
406	600481	双良节能	390,843.14	3.53
407	002118	紫鑫药业	390,751.81	3.53
408	600004	白云机场	390,744.10	3.53
409	601515	东风股份	390,383.92	3.52
410	603868	飞科电器	390,216.00	3.52
411	603866	桃李面包	390,102.00	3.52
412	000777	中核科技	389,964.00	3.52
413	600754	锦江股份	389,821.00	3.52

414	000723	美锦能源	389,742.00	3.52
415	000089	深圳机场	389,596.00	3.52
416	600694	大商股份	389,590.00	3.52
417	002315	焦点科技	389,572.00	3.52
418	600801	华新水泥	389,562.88	3.51
419	300156	神雾环保	389,396.76	3.51
420	002093	国脉科技	389,111.00	3.51
421	002123	梦网荣信	388,841.00	3.51
422	000960	锡业股份	388,816.00	3.51
423	600759	洲际油气	388,707.00	3.51
424	600316	洪都航空	388,623.75	3.51
425	000690	宝新能源	388,519.00	3.51
426	600835	上海机电	388,474.38	3.51
427	600151	航天机电	388,449.00	3.50
428	600380	健康元	388,285.00	3.50
429	600993	马应龙	388,184.00	3.50
430	600496	精工钢构	387,948.00	3.50
431	600717	天津港	387,639.00	3.50
432	600499	科达洁能	387,462.00	3.50
433	600687	刚泰控股	387,328.00	3.49
434	002581	未名医药	387,272.00	3.49
435	002344	海宁皮城	386,967.00	3.49
436	603355	莱克电气	386,958.00	3.49
437	002690	美亚光电	386,933.15	3.49
438	600981	汇鸿集团	386,895.00	3.49
439	600874	创业环保	386,800.00	3.49
440	000806	银河生物	386,307.00	3.49
441	600862	中航高科	386,113.25	3.48
442	600280	中央商场	385,819.00	3.48
443	600388	龙净环保	385,796.00	3.48
444	000090	天健集团	385,769.21	3.48
445	600143	金发科技	385,694.00	3.48
446	002544	杰赛科技	385,580.00	3.48
447	002029	七匹狼	385,506.50	3.48
448	603377	东方时尚	385,440.00	3.48
449	600236	桂冠电力	385,358.00	3.48

450	002106	莱宝高科	385,224.00	3.48
451	600112	天成控股	385,180.30	3.48
452	002603	以岭药业	385,007.00	3.47
453	000748	长城信息	384,948.00	3.47
454	000999	华润三九	384,736.00	3.47
455	002004	华邦健康	384,641.00	3.47
456	600300	维维股份	384,406.00	3.47
457	002461	珠江啤酒	384,366.00	3.47
458	300273	和佳股份	384,288.00	3.47
459	000919	金陵药业	384,199.84	3.47
460	002233	塔牌集团	384,195.13	3.47
461	000697	炼石有色	383,965.00	3.46
462	002217	合力泰	383,910.00	3.46
463	002063	远光软件	383,777.36	3.46
464	002019	亿帆医药	383,714.00	3.46
465	000816	智慧农业	383,554.00	3.46
466	600516	方大炭素	383,522.00	3.46
467	002251	步步高	383,467.00	3.46
468	002267	陕天然气	383,187.46	3.46
469	600863	内蒙华电	383,131.00	3.46
470	000887	中鼎股份	382,935.00	3.46
471	600251	冠农股份	382,744.00	3.45
472	600108	亚盛集团	382,451.00	3.45
473	600600	青岛啤酒	382,319.00	3.45
474	002399	海普瑞	381,990.00	3.45
475	603555	贵人鸟	381,787.66	3.44
476	000616	海航投资	381,020.53	3.44
477	600509	天富能源	380,975.00	3.44
478	601717	郑煤机	380,973.00	3.44
479	601126	四方股份	380,910.00	3.44
480	002422	科伦药业	380,820.00	3.44
481	601231	环旭电子	380,811.00	3.44
482	600823	世茂股份	380,265.00	3.43
483	600284	浦东建设	379,910.01	3.43
484	600812	华北制药	379,646.00	3.43
485	600790	轻纺城	379,551.00	3.42

486	600329	中新药业	378,942.00	3.42
487	601226	华电重工	378,860.39	3.42
488	002250	联化科技	378,633.00	3.42
489	000088	盐田港	378,343.00	3.41
490	000598	兴蓉环境	378,150.00	3.41
491	300244	迪安诊断	377,187.00	3.40
492	603025	大豪科技	377,165.00	3.40
493	600282	南钢股份	377,065.00	3.40
494	002707	众信旅游	376,928.00	3.40
495	000830	鲁西化工	376,548.00	3.40
496	300136	信维通信	376,310.00	3.40
497	600673	东阳光科	376,001.00	3.39
498	600551	时代出版	375,993.00	3.39
499	601016	节能风电	375,987.00	3.39
500	002181	粤传媒	375,775.00	3.39
501	600587	新华医疗	375,533.00	3.39
502	600064	南京高科	375,080.00	3.38
503	601689	拓普集团	374,926.92	3.38
504	002672	东江环保	374,919.00	3.38
505	600811	东方集团	373,998.00	3.37
506	300324	旋极信息	373,743.00	3.37
507	002440	闰土股份	373,078.00	3.37
508	002176	江特电机	372,867.00	3.36
509	600039	四川路桥	372,668.00	3.36
510	600773	西藏城投	372,644.00	3.36
511	002342	巨力索具	372,517.88	3.36
512	000685	中山公用	372,242.00	3.36
513	603528	多伦科技	371,343.00	3.35
514	600525	长园集团	371,333.00	3.35
515	601233	桐昆股份	370,936.00	3.35
516	000517	荣安地产	370,909.56	3.35
517	002028	思源电气	370,731.00	3.35
518	000669	金鸿能源	370,430.00	3.34
519	002479	富春环保	368,812.00	3.33
520	000528	柳工	367,850.84	3.32
521	000025	特力A	367,845.00	3.32

522	002624	完美世界	367,437.00	3.32
523	600425	青松建化	367,351.00	3.31
524	000931	中关村	367,010.00	3.31
525	300088	长信科技	366,855.00	3.31
526	601886	江河集团	366,032.00	3.30
527	002050	三花智控	365,512.00	3.30
528	600755	厦门国贸	365,143.35	3.29
529	600881	亚泰集团	364,651.00	3.29
530	002396	星网锐捷	364,396.00	3.29
531	600617	国新能源	364,085.18	3.29
532	002392	北京利尔	363,928.00	3.28
533	600565	迪马股份	363,437.00	3.28
534	600633	浙报传媒	362,982.00	3.28
535	600158	中体产业	362,458.00	3.27
536	600053	九鼎投资	360,968.92	3.26
537	002049	紫光国芯	360,564.00	3.25
538	000401	冀东水泥	360,454.00	3.25
539	600397	安源煤业	360,192.00	3.25
540	603328	依顿电子	359,866.00	3.25
541	000050	深天马 A	358,931.00	3.24
542	000062	深圳华强	355,790.50	3.21
543	002408	齐翔腾达	354,501.00	3.20
544	600623	华谊集团	336,255.00	3.03
545	002745	木林森	320,999.00	2.90
546	600859	王府井	300,260.00	2.71
547	600545	新疆城建	290,631.00	2.62
548	600429	三元股份	264,711.00	2.39
549	002237	恒邦股份	258,018.00	2.33
550	002180	艾派克	248,357.80	2.24
551	002174	游族网络	239,393.00	2.16

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300072	三聚环保	777,110.72	7.01
2	002310	东方园林	683,809.50	6.17

3	000983	西山煤电	595,749.00	5.38
4	601666	平煤股份	590,032.00	5.32
5	601155	新城控股	580,413.00	5.24
6	600507	方大特钢	576,287.00	5.20
7	002085	万丰奥威	560,995.00	5.06
8	000550	江铃汽车	536,394.00	4.84
9	601965	中国汽研	531,816.02	4.80
10	600320	振华重工	527,193.00	4.76
11	000030	富奥股份	520,616.00	4.70
12	002122	天马股份	511,637.00	4.62
13	002678	珠江钢琴	509,453.20	4.60
14	000900	现代投资	494,893.00	4.47
15	002216	三全食品	491,823.00	4.44
16	600761	安徽合力	488,756.00	4.41
17	002466	天齐锂业	484,667.00	4.37
18	600510	黑牡丹	484,538.00	4.37
19	600004	白云机场	478,345.00	4.32
20	600498	烽火通信	472,029.00	4.26
21	002299	圣农发展	471,709.00	4.26
22	002602	世纪华通	467,268.00	4.22
23	601369	陕鼓动力	464,743.00	4.19
24	600132	重庆啤酒	464,358.00	4.19
25	002131	利欧股份	462,743.00	4.18
26	603077	和邦生物	462,456.00	4.17
27	600456	宝钛股份	456,073.00	4.12
28	000088	盐田港	454,798.88	4.10
29	603699	纽威股份	454,749.00	4.10
30	601515	东风股份	451,987.00	4.08
31	000671	阳光城	445,506.50	4.02
32	002293	罗莱生活	441,033.80	3.98
33	600482	中国动力	435,274.00	3.93
34	002461	珠江啤酒	421,724.00	3.81
35	600509	天富能源	420,095.00	3.79
36	002426	胜利精密	408,685.50	3.69
37	300182	捷成股份	407,768.66	3.68
38	601126	四方股份	404,845.00	3.65
39	600812	华北制药	404,028.00	3.65
40	000426	兴业矿业	403,267.00	3.64

41	002714	牧原股份	396,623.00	3.58
42	002267	陕天然气	394,673.25	3.56
43	600236	桂冠电力	384,656.00	3.47
44	002074	国轩高科	380,002.00	3.43
45	601226	华电重工	379,770.50	3.43
46	600617	国新能源	371,832.50	3.36
47	002181	粤传媒	371,258.40	3.35
48	000008	神州高铁	366,687.00	3.31
49	600754	锦江股份	350,836.00	3.17
50	002049	紫光国芯	348,212.00	3.14
51	002624	完美世界	340,401.00	3.07
52	600497	驰宏锌锗	339,506.00	3.06
53	002237	恒邦股份	336,890.00	3.04
54	600487	亨通光电	330,315.00	2.98
55	000703	恒逸石化	326,561.98	2.95
56	600120	浙江东方	326,043.00	2.94
57	002174	游族网络	315,327.50	2.85
58	002194	武汉凡谷	313,724.61	2.83
59	601801	皖新传媒	299,225.00	2.70
60	002371	七星电子	296,649.00	2.68
61	000612	焦作万方	283,476.00	2.56
62	002155	湖南黄金	282,795.00	2.55
63	002482	广田集团	278,231.00	2.51
64	002271	东方雨虹	277,097.00	2.50
65	600429	三元股份	266,465.98	2.40
66	600623	华谊集团	266,159.00	2.40
67	000418	小天鹅A	265,277.96	2.39
68	000961	中南建设	262,735.00	2.37
69	002180	艾派克	260,399.25	2.35
70	000603	盛达矿业	260,129.00	2.35
71	600751	天海投资	259,418.00	2.34
72	601699	潞安环能	257,977.00	2.33
73	000937	冀中能源	257,348.00	2.32
74	300134	大富科技	244,503.00	2.21
75	600074	保千里	241,226.00	2.18
76	600885	宏发股份	239,915.00	2.16
77	002092	中泰化学	239,099.00	2.16
78	600657	信达地产	238,558.76	2.15

79	601001	大同煤业	237,040.99	2.14
80	002013	中航机电	234,183.00	2.11
81	600166	福田汽车	234,113.00	2.11
82	000656	金科股份	233,363.00	2.11
83	000933	*ST 神火	230,950.00	2.08
84	000513	丽珠集团	230,543.00	2.08
85	002281	光迅科技	228,739.00	2.06
86	000066	长城电脑	228,533.00	2.06
87	002251	步步高	228,216.00	2.06
88	603899	晨光文具	227,779.00	2.06
89	600566	济川药业	226,105.00	2.04
90	600729	重庆百货	225,655.39	2.04
91	002419	天虹商场	224,513.00	2.03

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	241,567,368.52
卖出股票收入（成交）总额	75,668,727.02

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前十名资产支持证

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	49,409.05
2	应收证券清算款	11,903.02
3	应收股利	-
4	应收利息	5,787.26
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	67,099.33

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	600161	天坛生物	504,320.00	0.25	临时停牌
2	002602	世纪华通	459,522.00	0.23	临时停牌
3	000563	陕国投 A	454,784.00	0.23	临时停牌

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

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	000887	中鼎股份	428,010.00	0.21	临时停牌
2	601005	重庆钢铁	186,228.00	0.09	临时停牌
3	601375	中原证券	106,780.00	0.05	新股锁定

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 500 等权重指数分级 A	157	13,426.66	1,300.00	0.06%	2,106,686.00	99.94%
西部利得中证 500 等权重指数分级 B	671	3,141.56	3,743.00	0.18%	2,104,243.00	99.82%
西部利得中证 500 等权重指数分级	538	363,739.75	192,259,852.47	98.25%	3,432,133.56	1.75%
合计	1,242	160,956.49	192,264,895.47	96.18%	7,643,062.56	3.82%

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	黄松友	1,138,150.00	53.99%
2	方春娣	256,815.00	12.18%
3	李莉	99,900.00	4.74%
4	董景秋	92,477.00	4.39%
5	聂佳磊	91,677.00	4.35%
6	范国强	81,800.00	3.88%

7	黄之林	64,400.00	3.06%
8	谢丽芳	50,000.00	2.37%
9	杨大妹	50,000.00	2.37%
10	王学军	21,100.00	1.00%

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	刘艳	227,700.00	10.80%
2	李莉	100,600.00	4.77%
3	欧才	78,494.00	3.72%
4	黄之林	64,400.00	3.06%
5	唐磊	50,100.00	2.38%
6	谢丽芳	50,000.00	2.37%
7	李秀莲	48,672.00	2.31%
8	王玉英	42,448.00	2.01%
9	戈世华	34,833.00	1.65%
10	林玉琴	34,070.00	1.62%

西部利得中证 500 等权重指数分级

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	董景秋	496,534.00	23.91%
2	黄之林	243,131.00	11.71%
3	张容	121,160.00	5.83%
4	郭付元	90,686.00	4.37%
5	唐利军	77,908.00	3.75%
6	张花格	59,613.00	2.87%
7	董万友	56,854.00	2.74%
8	朱清	54,764.00	2.64%
9	王明辉	54,052.00	2.60%
10	向顺波	53,400.00	2.57%

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	0.0000%
	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%

截至本报告期末，本基金管理人的从业人员未持有本基金份额。

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	-	-	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	-	-	204,998,731.15
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	14,759,931.25
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-60,150.00	-60,150.00	209,037.40
本报告期期末基金份额总额	2,107,986.00	2,107,986.00	195,691,986.03

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高级管理人员变动如下：

根据基金管理人一届二十八次董事会会议决议，自 2016 年 9 月 29 日起，原董事长安保和先生离任，徐剑钧先生职务由原督察长变更为董事长，赵毅先生担任督察长职务。

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

本报告期为本基金审计的会计师事务所改聘为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。本报告期应支付毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计费人民币 54,000 元。截至报告期末连续服务期为 0~1 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
西部证券	2	75,040,056.30	23.72%	39,869.40	21.54%	-
海通证券	1	53,999,588.11	17.07%	28,690.19	15.50%	-
中信建投	1	45,886,076.47	14.50%	42,733.81	23.09%	-
东吴证券	2	35,552,434.78	11.24%	18,888.90	10.20%	-
华金证券	2	31,334,448.28	9.90%	13,515.02	7.30%	-
光大证券	2	29,430,937.56	9.30%	23,289.01	12.58%	-
东北证券	2	17,534,737.03	5.54%	7,562.87	4.09%	-
方正证券	2	13,123,319.39	4.15%	6,972.28	3.77%	-
银河证券	2	12,403,319.68	3.92%	2,001.84	1.08%	-
广发证券	1	1,295,757.01	0.41%	947.59	0.51%	-
平安证券	2	459,868.52	0.15%	336.31	0.18%	-
申万宏源	2	309,785.00	0.10%	288.62	0.16%	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
西部证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

东吴证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

西部利得基金管理有限公司
2017 年 3 月 31 日