

西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资 基金 2018 年半年度报告

2018 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：二〇一八年八月二十八日

§ 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 2018 年 8 月 27 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 2018 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	8
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 其他指标.....	错误!未定义书签。
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	46
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	46
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.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	61
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.....	63
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.....	65
§8 基金份额持有人信息.....	67
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	67
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	67
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	68
§9 开放式基金份额变动.....	69
§10 重大事件揭示.....	70
10.1 基金份额持有人大会决议.....	70
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.....	70
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	70
10.4 基金投资策略的改变.....	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	70
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.....	70
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	70
10.8 其他重大事件.....	72
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	73

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	73
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	73
§12 备查文件目录.....	74
12.1 备查文件目录.....	74
12.2 存放地点.....	74
12.3 查阅方式.....	74

§ 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		
前端交易代码	-		
后端交易代码	-		
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	244,373,695.82 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	-		
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 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
下属分级基金场内简称:	500 等权 A	500 等权 B	500 等权
下属分级基金的交易代码	502001	502002	502000
报告期末下属分级基金份额总额	1,076,936.00 份	1,076,936.00 份	242,219,823.82 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况、基金资产的流动性要求等因素确定各类资产的具体配置比例。在巨额申购赎回发生、成份股大比例分红等情况下，管理人将在综合考虑冲击成本因素和跟踪效果后，及时将股票配置比例调整至合理水平。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 股票组合构建原则</p> <p>本基金通过复制指数的方法，根据中证 500 等权重指数成份股组成及其基准权重构建股票投资组合。当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证 500 等权重指数的效果可能带来影响时，基金管理人将根据市场情况，采取合理措施控制基金的跟踪误差。</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	$95\% \times \text{中证 500 等权重指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行人民币活期存款利率 (税后)}$

风险收益特征	-		
下属分级基金的风险收益特征	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。	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。

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
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		徐剑钧	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(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-3,713,317.74
本期利润	-28,100,530.98
加权平均基金份额本期利润	-0.1282
本期加权平均净值利润率	-13.34%
本期基金份额净值增长率	-12.18%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-177,516,696.11
期末可供分配基金份额利润	-0.7264
期末基金资产净值	211,321,429.71
期末基金份额净值	0.8647
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-45.21%

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	-7.73%	1.65%	-9.52%	1.78%	1.79%	-0.13%
过去三个月	-11.11%	1.23%	-14.43%	1.31%	3.32%	-0.08%
过去六个月	-12.18%	1.28%	-16.73%	1.36%	4.55%	-0.08%
过去一年	-9.47%	1.09%	-16.72%	1.15%	7.25%	-0.06%
过去三年	-45.26%	1.66%	-39.53%	1.82%	-5.73%	-0.16%

自基金合同 生效起至今	-45.21%	1.76%	-33.19%	1.91%	-12.02%	-0.15%
----------------	---------	-------	---------	-------	---------	--------

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：

$benchmark(0)=1000;$

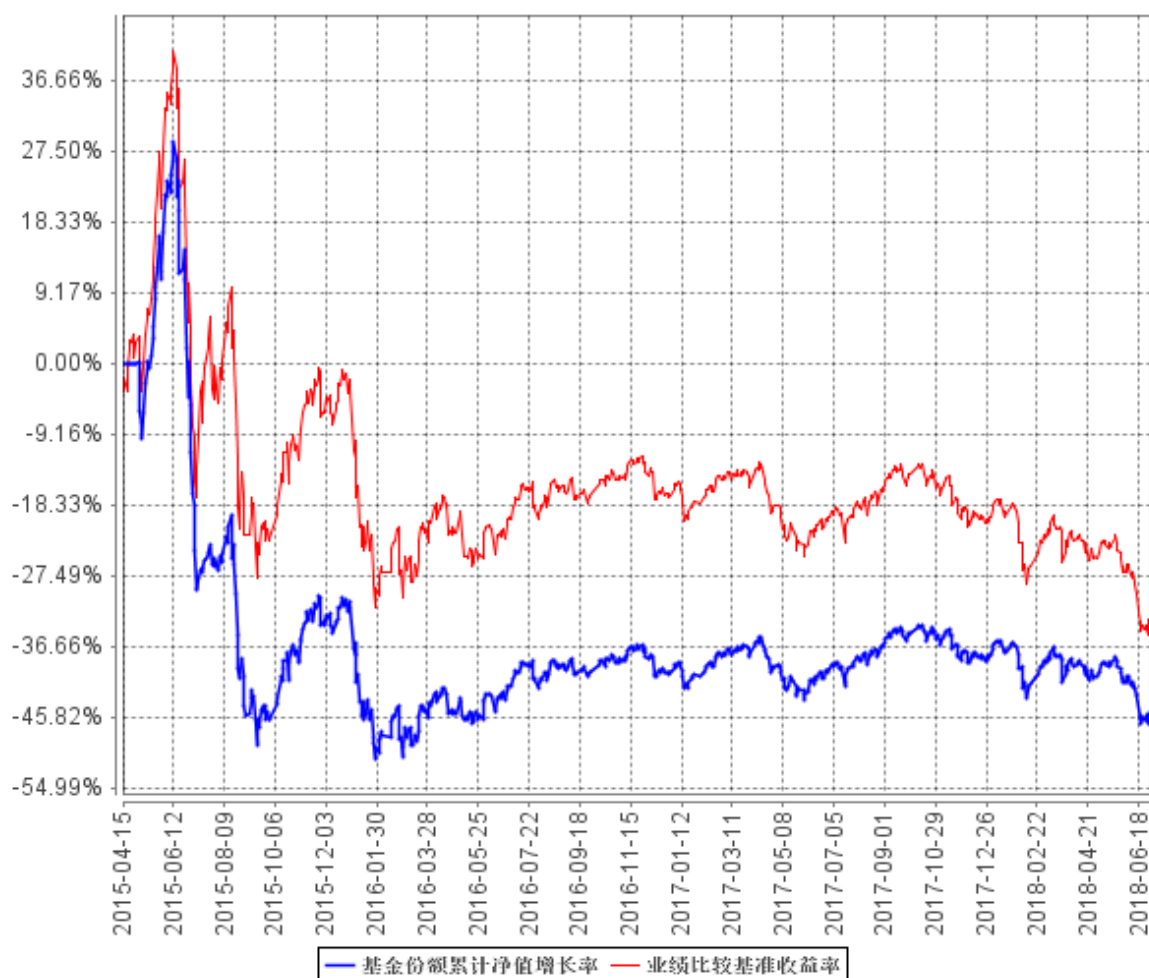
$\%benchmark(t) = 95%*(中证 500 等权重指数收益率(t)/ 中证 500 等权重指数收益率(t-1)-1)+5%*商业银行人民币活期存款利率/365;$

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

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利得科技有限公司合资控股，注册资本3.5亿元人民币，其中西部证券股份有限公司占比51%，利得科技有限公司占比49%，注册地上海。

截至2018年6月30日，本基金管理人旗下共管理29只开放式基金。

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		
盛丰衍	本基金基金经理	2016年11月24日	-	四年	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。

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

回顾 2018 年上半年，中证 500 等权重指数受中美贸易战及市场对国内经济的担忧影响而下跌。

在投资管理上，本基金运作严格按照基金合同的各项要求，主要依据被动化指数投资方法进行投资管理。本基金于 2016 年 11 月底开始参与网下打新。2018 年上半年基金规模维持在 2 个亿

左右，符合网下打新的沪深两市市值要求。公募基金网下打新属于 A 类投资者，新股获配中签率高于 B 类及 C 类投资者。在基金规模满足网下打新要求的前提下，本基金将继续参与网下打新，在被动化指数投资的基础上追求低风险的收益增厚。

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

报告期内基金业绩表现参见本报告第三部分“主要财务指标和基金净值表现”。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年下半年，预计 A 股修复性上涨。2018 年 1 月以来 A 股持续调整，不仅消化了诸多利空甚至有过度悲观的征兆。调整至今 A 股无论从历史估值来看，还是与国际股票市场进行比较，当前 A 股整体估值均已在筑底阶段。投资者对于市场的低估值没有太多争议，但部分投资者担心弱市风险偏好持续下降，资金会无视基本面情况而恐慌性继续抛售。事实上历史的规律反复地验证了股票的价值最终是其价格的中流砥柱，非理性的低估或者高估都会随着时间而修复。目前指数估值处于历史较低位置，有业绩支撑，中长期配置的性价比较高。

随着中美双方进入修昔底德陷阱，以贸易战为代表的中美摩擦逐渐升温，但这是中国崛起的必经之路。中美贸易互相依存度高，对贸易摩擦导致的经济下行均较为抵触，全球治理上有大量共识，这些都增加了平稳跨过修昔底德陷阱的可能性。权益市场的长期表现和一个国家的国运紧密相连，作为世界经济最重要驱动力的中国，我们更有理由有足够的信心。

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

根据基金相关法律法规和基金合同的要求，结合本基金实际运作情况，本报告期内，本基金暂未进行利润分配。

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

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	8,816,874.43	3,014,181.01
结算备付金		310,666.24	236,358.97
存出保证金		87,524.70	54,283.62
交易性金融资产	6.4.7.2	202,815,834.73	212,865,839.86
其中：股票投资		199,815,534.73	204,732,461.86
基金投资		-	-
债券投资		3,000,300.00	8,133,378.00
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		381,937.43	267,330.29
应收利息	6.4.7.5	96,639.77	165,241.36
应收股利		-	-
应收申购款		5,136.95	21,744.49
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		212,514,614.25	216,624,979.60
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 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		705,026.96	-
应付赎回款		6,508.18	306.63
应付管理人报酬		165,943.06	182,835.95
应付托管费		33,188.62	36,567.20
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	148,192.45	142,756.86

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	134,325.27	160,001.16
负债合计		1,193,184.54	522,467.80
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	388,838,125.82	346,175,319.33
未分配利润	6.4.7.10	-177,516,696.11	-130,072,807.53
所有者权益合计		211,321,429.71	216,102,511.80
负债和所有者权益总计		212,514,614.25	216,624,979.60

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8647 元，基金份额总额 244,373,695.82 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-26,168,815.36	3,671,668.08
1.利息收入		159,697.84	118,583.93
其中：存款利息收入	6.4.7.11	55,151.07	108,777.52
债券利息收入		104,546.77	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	9,806.41
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,942,834.56	11,240,442.57
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-3,505,585.08	10,100,547.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	3,686.50	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,559,064.02	1,139,895.08
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-24,387,213.24	-7,690,137.31
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,534.60	2,778.89

减：二、费用		1,931,715.62	1,546,057.24
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,040,792.16	1,017,179.70
2. 托管费	6.4.10.2.2	208,158.42	203,435.97
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	498,119.29	106,009.43
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	184,645.75	219,432.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-28,100,530.98	2,125,610.84
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-28,100,530.98	2,125,610.84

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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	346,175,319.33	-130,072,807.53	216,102,511.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-28,100,530.98	-28,100,530.98
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）	42,662,806.49	-19,343,357.60	23,319,448.89
其中：1.基金申购款	44,698,194.94	-20,142,516.59	24,555,678.35
2.基金赎回款	-2,035,388.45	799,158.99	-1,236,229.46
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）	388,838,125.82	-177,516,696.11	211,321,429.71

项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	334,275,651.61	-134,207,083.90	200,068,567.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,125,610.84	2,125,610.84
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）	13,626,190.08	-5,395,009.99	8,231,180.09
其中：1.基金申购款	17,282,531.88	-6,790,897.70	10,491,634.18
2.基金赎回款	-3,656,341.80	1,395,887.71	-2,260,454.09
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）	347,901,841.69	-137,476,483.05	210,425,358.64

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：

贺燕萍	贺燕萍	张峰骏
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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： $95\% \times \text{中证 500 等权重指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行人民币活期存款利率（税后）}$ 。

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批准于 2018 年 8 月 28 日报出。

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》、《纽银策略优选股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

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

(1) 主要税项说明

根据财税[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[2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》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) 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。

(b)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。

2018 年 1 月 1 日(含)以后,资管产品管理人(以下称管理人)运营基金过程中发生的增值税应税行为,以管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。对基金在 2018 年 1 月 1 日以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,已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。

(c)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。

(d)对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司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。

(e)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。

(f)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,暂不征收企业所得税。

(g)对基金在 2018 年 1 月 1 日(含)以后运营过程中缴纳的增值税,按照证券投资基金管理人所在地适用的城市维护建设税税率,计算缴纳城市维护建设税。

(h)对基金在 2018 年 1 月 1 日(含)以后运营过程中缴纳的增值税,分别按照证券投资基金

管理人所在地适用的费率计算缴纳教育费附加、地方教育费附加。

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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	8,816,874.43
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	8,816,874.43

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	228,696,601.93	199,815,534.73	-28,881,067.20
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	3,000,300.00	1,300.00
	银行间市场	-	-
	合计	3,000,300.00	1,300.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	231,695,601.93	202,815,834.73	-28,879,767.20

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 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	4,692.24
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	139.80
应收债券利息	90,867.95
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	900.38
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	39.40
合计	96,639.77

6.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末均未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	148,192.45
银行间市场应付交易费用	-
合计	148,192.45

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	24.52
预提费用	84,300.75
应付指数使用费	50,000.00
合计	134,325.27

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	212,276,162.83	346,175,319.33
本期申购	33,376,709.59	44,698,194.94
本期赎回(以“-”号填列)	-1,279,176.60	-2,035,388.45
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	244,373,695.82	388,838,125.82

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	-147,600,260.10	17,527,452.57	-130,072,807.53
本期利润	-3,713,317.74	-24,387,213.24	-28,100,530.98
本期基金份额交易产生的变动数	-18,574,223.93	-769,133.67	-19,343,357.60
其中：基金申购款	-19,452,208.45	-690,308.14	-20,142,516.59
基金赎回款	877,984.52	-78,825.53	799,158.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-169,887,801.77	-7,628,894.34	-177,516,696.11

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	50,758.07
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	2,855.48
其他	1,537.52
合计	55,151.07

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	200,631,230.75
减：卖出股票成本总额	204,136,815.83
买卖股票差价收入	-3,505,585.08

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

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	3,686.50
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	3,686.50

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	6,352,113.60
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	6,144,313.50

减：应收利息总额	204,113.60
买卖债券差价收入	3,686.50

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

本基金在本报告期内未持有贵金属。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金在本报告期内未持有贵金属。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内未持有衍生工具。

6.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金本报告期内未持有衍生工具。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,559,064.02
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,559,064.02

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-24,387,213.24
——股票投资	-24,397,248.74
——债券投资	10,035.50
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-24,387,213.24

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,534.60
合计	1,534.60

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额不低于 25% 的部分归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费不低于 25% 的部分归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	498,119.29
银行间市场交易费用	-
合计	498,119.29

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	29,752.78
上市费用	29,752.78
银行汇划费用	345.00
指数使用费	100,000.00
合计	184,645.75

6.4.7.21 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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、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	基金托管人、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	22,702,821.73	5.38%	47,748,858.95	50.42%

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
西部证券	-	-	4,500,000.00	10.23%

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018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	12,061.18	4.64%	12,061.18	8.14%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	25,369.41	48.70%	23,385.49	52.36%

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	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,040,792.16	1,017,179.70
其中：支付销售机构的客户维护费	4,046.19	2,743.28

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

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
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	208,158.42	203,435.97

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

6.4.10.2.3 销售服务费

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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金的情况。

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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	8,816,874.43	50,758.07	10,874,594.19	105,544.19

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 2018 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 310,666.24 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

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
603693	江苏新能	2018 年 6 月 25 日	2018 年 7 月 3 日	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方	2018 年	2018	新股流	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-

	环宇	6月29日	2018年7月9日	通受限						
603105	芯能科技	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

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
300324	旋极信息	2018年5月30日	重大事项	9.49	-	-	79,482	811,518.98	754,284.18	-
000825	太钢不锈	2018年4月16日	重大资产重组	6.00	-	-	98,300	524,840.96	589,800.00	-
600811	东方集团	2018年5月30日	重要事项未公告	4.30	-	-	134,350	662,830.20	577,705.00	-
002699	美盛文化	2018年2月5日	重大事项	18.76	2018年7月2日	16.88	30,320	559,786.37	568,803.20	-
002477	雏鹰农牧	2018年6月14日	重大事项	3.31	-	-	171,600	616,390.00	567,996.00	-
600022	山东钢铁	2018年3月27日	重大资产重组	2.02	-	-	258,880	547,802.31	522,937.60	-

			组							
000426	兴业矿业	2018年6月19日	重大事项	7.21	-	-	70,800	627,783.66	510,468.00	-
002359	北讯集团	2018年5月21日	拟披露重大事项	19.58	-	-	25,300	662,923.09	495,374.00	-
002051	中工国际	2018年6月14日	重大资产重组	15.27	-	-	30,648	552,001.47	467,994.96	-
002426	胜利精密	2018年6月19日	拟披露重大事项	3.60	2018年7月3日	3.26	124,100	507,483.00	446,760.00	-
002005	德豪润达	2018年1月2日	重大事项	4.36	2018年7月2日	3.92	76,600	407,839.41	333,976.00	-
000669	金鸿控股	2018年6月13日	重大资产重组	7.25	2018年8月6日	6.53	43,377	399,192.99	314,483.25	-
600158	中体产业	2018年3月27日	拟筹划重大资产重组	11.64	2018年7月16日	11.61	24,500	325,232.15	285,180.00	-

002431	棕榈股份	2018年6月12日	重大事件	6.71	-	-	42,250	372,761.23	283,497.50	-
600086	东方金钰	2018年1月19日	拟筹划重大资产重组	10.04	-	-	26,400	263,940.25	265,056.00	-
300146	汤臣倍健	2018年1月31日	重大事件	16.60	2018年7月31日	16.50	15,600	187,438.36	258,960.00	-
600750	江中药业	2018年5月2日	重要事项未公告	17.57	2018年8月1日	16.12	13,720	261,208.25	241,060.40	-
600687	刚泰控股	2018年6月11日	重要事项未公告	9.09	-	-	25,143	268,406.26	228,549.87	-
002011	盾安环境	2018年5月2日	拟披露重大事件	6.40	-	-	34,700	261,258.82	222,080.00	-
600848	上海临港	2018年6月15日	重要事项未公	21.67	-	-	9,400	204,908.31	203,698.00	-

			告							
000939	凯迪生态	2017年11月16日	重大事项	4.99	2018年7月2日	4.74	40,500	171,623.71	202,095.00	-
600751	海航科技	2018年1月12日	重要事项未公告	6.49	-	-	30,200	224,001.74	195,998.00	-
600122	宏图高科	2018年6月19日	拟筹划重大资产重组	7.40	-	-	26,400	306,469.08	195,360.00	-
000566	海南海药	2017年11月22日	重大事项	12.89	2018年7月9日	11.60	14,500	162,998.63	186,905.00	-
002573	清新环境	2018年6月19日	拟披露重大事项	11.55	-	-	13,600	208,000.55	157,080.00	-
000587	金洲慈航	2018年6月15日	重大事项	4.96	2018年7月2日	4.46	28,700	203,398.45	142,352.00	-
002147	新光圆成	2018年1月18日	拟披露重大事项	14.76	-	-	8,871	110,614.68	130,935.96	-
002512	达华	2018	拟	9.70	-	-	11,900	148,527.48	115,430.00	-

	智能	年 6 月 19 日	披 露 重 大 事 项							
002408	齐翔 腾达	2018 年 6 月 19 日	重 大 资 产 重 组	12.28	-	-	8,663	99,370.78	106,381.64	-
600759	洲际 油气	2018 年 3 月 27 日	重 大 资 产 重 组	3.94	-	-	24,640	135,172.65	97,081.60	-
002665	首航 节能	2018 年 5 月 29 日	重 大 事 项	5.80	-	-	16,090	123,218.62	93,322.00	-
300266	兴源 环境	2018 年 2 月 5 日	拟 披 露 重 大 事 项	19.99	2018 年 7 月 2 日	17.99	4,400	116,815.27	87,956.00	-
000693	*ST 华泽	2018 年 5 月 2 日	暂 停 上 市	3.31	-	-	1,000	18,518.72	3,310.00	-

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

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是一只股票型指数基金分级证券投资基金，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。从本基金分离的两类基金份额来看，西部利得中证 500 等权 A 具有低风险、收益相对稳定的特征；西部利得中证 500 等权 B 具有高风险、高预期收益的特征。

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基金分级证券投资基金，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与绩效评估。

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 2018 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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	3,000,300.00	8,133,378.00
合计	3,000,300.00	8,133,378.00

于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

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 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

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 2018 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
------------------------	-------	-------	-------	-----	----

资产					
银行存款	8,816,874.43	-	-	-	8,816,874.43
结算备付金	310,666.24	-	-	-	310,666.24
存出保证金	87,524.70	-	-	-	87,524.70
交易性金融资产	3,000,300.00	-	-	-199,815,534.73	202,815,834.73
应收证券清算款	-	-	-	381,937.43	381,937.43
应收利息	-	-	-	96,639.77	96,639.77
应收申购款	-	-	-	5,136.95	5,136.95
资产总计	12,215,365.37	-	-	-200,299,248.88	212,514,614.25
负债					
应付证券清算款	-	-	-	705,026.96	705,026.96
应付赎回款	-	-	-	6,508.18	6,508.18
应付管理人报酬	-	-	-	165,943.06	165,943.06
应付托管费	-	-	-	33,188.62	33,188.62
应付交易费用	-	-	-	148,192.45	148,192.45
其他负债	-	-	-	134,325.27	134,325.27
负债总计	-	-	-	1,193,184.54	1,193,184.54
利率敏感度缺口	12,215,365.37	-	-	-199,106,064.34	211,321,429.71
上年度末 2017 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,014,181.01	-	-	-	3,014,181.01
结算备付金	236,358.97	-	-	-	236,358.97
存出保证金	54,283.62	-	-	-	54,283.62
交易性金融资产	8,133,378.00	-	-	-204,732,461.86	212,865,839.86
应收证券清算款	-	-	-	267,330.29	267,330.29
应收利息	-	-	-	165,241.36	165,241.36
应收申购款	-	-	-	21,744.49	21,744.49
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	11,438,201.60	-	-	-205,186,778.00	216,624,979.60
负债					
应付赎回款	-	-	-	306.63	306.63
应付管理人报酬	-	-	-	182,835.95	182,835.95
应付托管费	-	-	-	36,567.20	36,567.20
应付交易费用	-	-	-	142,756.86	142,756.86
其他负债	-	-	-	160,001.16	160,001.16
负债总计	-	-	-	522,467.80	522,467.80
利率敏感度缺口	11,438,201.60	-	-	-204,664,310.20	216,102,511.80

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。

6.4.13.4.2 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 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	199,815,534.73	94.56	204,732,461.86	94.74

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	3,000,300.00	1.42	8,133,378.00	3.76
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	202,815,834.73	95.98	212,865,839.86	98.50

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（2018年6月30日）	上年度末（2017年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	9,317,050.17	9,424,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-9,317,050.17	-9,424,000.00

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

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 2018 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 189962663.57 元，第二层次余额为 12853171.16 元，无属于第三层次的余额（2017 年 12 月 31

日，属于第一层次的余额为 192602651.85 元，属于第二层次的余额为 20263188.01 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 2018 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（2017 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	199,815,534.73	94.02
	其中：股票	199,815,534.73	94.02
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,000,300.00	1.41
	其中：债券	3,000,300.00	1.41
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,127,540.67	4.30
8	其他各项资产	571,238.85	0.27
9	合计	212,514,614.25	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境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,712,340.00	1.28
B	采矿业	8,860,177.34	4.19
C	制造业	110,474,451.26	52.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,303,266.18	3.46
E	建筑业	3,856,843.44	1.83
F	批发和零售业	11,732,899.48	5.55
G	交通运输、仓储和邮政业	7,083,553.60	3.35
H	住宿和餐饮业	702,614.00	0.33
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,855,506.98	7.50

J	金融业	5,084,004.70	2.41
K	房地产业	10,966,796.26	5.19
L	租赁和商务服务业	4,789,555.41	2.27
M	科学研究和技术服务业	595,134.00	0.28
N	水利、环境和公共设施管理业	1,357,560.70	0.64
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	124,096.00	0.06
Q	卫生和社会工作	116,341.20	0.06
R	文化、体育和娱乐业	6,161,478.20	2.92
S	综合	840,811.00	0.40
	合计	198,617,429.75	93.99

7.2.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,310.00	0.00
C	制造业	525,430.74	0.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	588,138.10	0.28
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
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	81,226.14	0.04
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	1,198,104.98	0.57

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

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	000528	柳 工	78,900	845,019.00	0.40
2	600062	华润双鹤	33,420	820,461.00	0.39
3	600572	康恩贝	113,700	815,229.00	0.39
4	600380	健康元	68,500	812,410.00	0.38
5	000418	小天鹅A	11,670	809,314.50	0.38
6	600348	阳泉煤业	112,500	804,375.00	0.38
7	601717	郑煤机	138,000	801,780.00	0.38
8	002176	江特电机	82,202	799,003.44	0.38
9	600580	卧龙电气	101,200	771,144.00	0.36
10	002709	天赐材料	20,000	770,800.00	0.36
11	601168	西部矿业	122,300	768,044.00	0.36
12	000636	风华高科	48,100	763,828.00	0.36
13	600426	华鲁恒升	42,886	754,364.74	0.36
14	300324	旋极信息	79,482	754,284.18	0.36
15	002019	亿帆医药	42,700	753,655.00	0.36
16	603369	今世缘	33,000	753,390.00	0.36
17	601678	滨化股份	121,478	750,734.04	0.36
18	600673	东阳光科	72,400	747,892.00	0.35
19	600056	中国医药	40,800	745,416.00	0.35
20	000999	华润三九	26,700	743,061.00	0.35
21	002317	众生药业	70,200	742,014.00	0.35
22	600869	智慧能源	157,200	741,984.00	0.35
23	002118	紫鑫药业	103,700	741,455.00	0.35
24	600216	浙江医药	57,900	739,383.00	0.35
25	600872	中炬高新	26,200	733,600.00	0.35
26	603025	大豪科技	37,733	729,756.22	0.35
27	600143	金发科技	139,700	729,234.00	0.35
28	300026	红日药业	198,800	725,620.00	0.34

29	000553	沙隆达 A	45,800	724,098.00	0.34
30	600060	海信电器	54,000	723,060.00	0.34
31	000758	中色股份	159,500	717,750.00	0.34
32	000703	恒逸石化	48,220	717,513.60	0.34
33	600835	上海机电	38,000	716,680.00	0.34
34	000848	承德露露	67,675	716,678.25	0.34
35	002340	格林美	118,432	716,513.60	0.34
36	600256	广汇能源	174,550	713,909.50	0.34
37	600161	天坛生物	36,854	713,124.90	0.34
38	000975	银泰资源	70,316	713,004.24	0.34
39	002128	露天煤业	78,600	712,116.00	0.34
40	600160	巨化股份	97,110	710,845.20	0.34
41	000596	古井贡酒	8,000	710,240.00	0.34
42	600618	氯碱化工	83,449	710,150.99	0.34
43	000552	靖远煤电	216,100	706,647.00	0.33
44	000878	云南铜业	73,900	705,006.00	0.33
45	300039	上海凯宝	121,140	702,612.00	0.33
46	002444	巨星科技	63,800	702,438.00	0.33
47	601179	中国西电	204,600	699,732.00	0.33
48	000028	国药一致	14,000	698,600.00	0.33
49	000830	鲁西化工	40,900	698,572.00	0.33
50	002221	东华能源	71,490	698,457.30	0.33
51	600563	法拉电子	14,000	692,860.00	0.33
52	300088	长信科技	119,339	692,166.20	0.33
53	000078	海王生物	143,550	690,475.50	0.33
54	002233	塔牌集团	60,200	688,688.00	0.33
55	600557	康缘药业	55,680	687,648.00	0.33
56	002078	太阳纸业	70,900	687,021.00	0.33
57	002603	以岭药业	49,100	686,418.00	0.32
58	002384	东山精密	28,600	686,400.00	0.32
59	300376	易事特	127,500	684,675.00	0.32
60	000937	冀中能源	165,800	681,438.00	0.32
61	600875	东方电气	91,500	678,015.00	0.32
62	600511	国药股份	25,100	676,445.00	0.32
63	601311	骆驼股份	58,900	675,583.00	0.32
64	002815	崇达技术	41,800	672,980.00	0.32
65	601233	桐昆股份	39,060	672,613.20	0.32
66	002463	沪电股份	179,100	669,834.00	0.32
67	000039	中集集团	50,400	669,312.00	0.32

68	300058	蓝色光标	117,200	668,040.00	0.32
69	002064	华峰氨纶	160,900	664,517.00	0.31
70	601001	大同煤业	133,900	664,144.00	0.31
71	002440	闰土股份	56,800	663,992.00	0.31
72	600582	天地科技	180,100	660,967.00	0.31
73	300308	中际旭创	11,000	660,440.00	0.31
74	600743	华远地产	256,000	657,920.00	0.31
75	600126	杭钢股份	110,200	657,894.00	0.31
76	600664	哈药股份	165,070	655,327.90	0.31
77	002056	横店东磁	93,000	651,930.00	0.31
78	002332	仙琚制药	74,300	650,125.00	0.31
79	603568	伟明环保	25,550	646,415.00	0.31
80	600006	东风汽车	158,000	646,220.00	0.31
81	600195	中牧股份	33,128	644,339.60	0.30
82	000513	丽珠集团	14,615	642,329.25	0.30
83	600808	马钢股份	178,900	642,251.00	0.30
84	000581	威孚高科	28,800	636,768.00	0.30
85	600499	科达洁能	92,800	636,608.00	0.30
86	300274	阳光电源	70,760	634,717.20	0.30
87	600545	卓郎智能	79,800	633,612.00	0.30
88	600757	长江传媒	111,300	633,297.00	0.30
89	300113	顺网科技	36,300	631,983.00	0.30
90	002600	领益智造	121,700	631,623.00	0.30
91	300383	光环新网	46,900	628,929.00	0.30
92	600859	王府井	29,533	628,166.91	0.30
93	600167	联美控股	62,700	627,000.00	0.30
94	300287	飞利信	87,200	626,968.00	0.30
95	002191	劲嘉股份	83,700	625,239.00	0.30
96	600823	世茂股份	148,761	621,820.98	0.29
97	002093	国脉科技	80,400	619,884.00	0.29
98	000543	皖能电力	140,510	619,649.10	0.29
99	002242	九阳股份	35,000	619,150.00	0.29
100	600970	中材国际	92,550	618,234.00	0.29
101	600694	大商股份	18,905	614,601.55	0.29
102	600908	无锡银行	103,875	611,823.75	0.29
103	600729	重庆百货	18,400	606,280.00	0.29
104	000997	新大陆	38,480	606,060.00	0.29
105	002701	奥瑞金	110,920	605,623.20	0.29
106	300182	捷成股份	79,700	604,126.00	0.29

107	601020	华钰矿业	43,600	601,244.00	0.28
108	002280	联络互动	105,000	600,600.00	0.28
109	002344	海宁皮城	123,400	599,724.00	0.28
110	002373	千方科技	45,900	598,995.00	0.28
111	601689	拓普集团	30,800	598,752.00	0.28
112	600755	厦门国贸	82,100	598,509.00	0.28
113	600578	京能电力	191,576	597,717.12	0.28
114	601801	皖新传媒	78,300	595,863.00	0.28
115	600801	华新水泥	39,600	595,188.00	0.28
116	600645	中源协和	30,900	595,134.00	0.28
117	002491	通鼎互联	53,700	594,459.00	0.28
118	002745	木林森	33,400	594,186.00	0.28
119	601928	凤凰传媒	97,700	594,016.00	0.28
120	600017	日照港	185,000	593,850.00	0.28
121	000049	德赛电池	21,000	592,620.00	0.28
122	600737	中粮糖业	78,500	591,890.00	0.28
123	000825	太钢不锈	98,300	589,800.00	0.28
124	002299	圣农发展	37,940	587,690.60	0.28
125	000667	美好置业	275,200	586,176.00	0.28
126	000090	天健集团	94,248	584,337.60	0.28
127	600098	广州发展	90,200	581,790.00	0.28
128	600282	南钢股份	131,600	581,672.00	0.28
129	603806	福斯特	26,260	577,982.60	0.27
130	002358	森源电气	38,400	577,920.00	0.27
131	600811	东方集团	134,350	577,705.00	0.27
132	600565	迪马股份	194,800	574,660.00	0.27
133	000541	佛山照明	95,864	574,225.36	0.27
134	600039	四川路桥	173,800	570,064.00	0.27
135	002699	美盛文化	30,320	568,803.20	0.27
136	002477	雏鹰农牧	171,600	567,996.00	0.27
137	002400	省广集团	175,467	566,758.41	0.27
138	603816	顾家家居	7,700	566,027.00	0.27
139	002642	荣之联	61,400	564,266.00	0.27
140	600655	豫园股份	59,600	563,220.00	0.27
141	601811	新华文轩	57,500	558,900.00	0.26
142	601016	节能风电	194,500	558,215.00	0.26
143	000062	深圳华强	28,400	556,640.00	0.26
144	000887	中鼎股份	38,600	556,226.00	0.26
145	601019	山东出版	69,000	552,690.00	0.26

146	600863	内蒙华电	241,300	547,751.00	0.26
147	600277	亿利洁能	103,900	544,436.00	0.26
148	002583	海能达	65,200	544,420.00	0.26
149	600884	杉杉股份	24,600	543,660.00	0.26
150	000926	福星股份	75,476	542,672.44	0.26
151	600108	亚盛集团	186,600	539,274.00	0.26
152	600478	科力远	105,500	538,050.00	0.25
153	002174	游族网络	27,000	537,300.00	0.25
154	000066	中国长城	75,500	536,805.00	0.25
155	600600	青岛啤酒	12,200	534,726.00	0.25
156	600528	中铁工业	52,200	533,484.00	0.25
157	600155	宝硕股份	73,900	531,341.00	0.25
158	600623	华谊集团	53,200	530,936.00	0.25
159	000563	陕国投 A	156,100	530,740.00	0.25
160	600270	外运发展	25,260	529,449.60	0.25
161	000980	众泰汽车	74,000	526,140.00	0.25
162	600395	盘江股份	86,600	525,662.00	0.25
163	600022	山东钢铁	258,880	522,937.60	0.25
164	603169	兰石重装	103,000	516,030.00	0.24
165	002640	跨境通	34,300	515,186.00	0.24
166	600037	歌华有线	49,900	514,968.00	0.24
167	002277	友阿股份	111,600	514,476.00	0.24
168	600978	宜华生活	75,300	514,299.00	0.24
169	600094	大名城	88,700	510,912.00	0.24
170	000426	兴业矿业	70,800	510,468.00	0.24
171	603228	景旺电子	10,200	504,288.00	0.24
172	601777	力帆股份	96,100	502,603.00	0.24
173	600317	营口港	222,100	501,946.00	0.24
174	600642	申能股份	99,900	501,498.00	0.24
175	000960	锡业股份	41,600	499,616.00	0.24
176	002359	北讯集团	25,300	495,374.00	0.23
177	600657	信达地产	116,400	494,700.00	0.23
178	000021	深科技	72,400	493,768.00	0.23
179	603328	依顿电子	45,500	493,675.00	0.23
180	002588	史丹利	95,300	493,654.00	0.23
181	002517	恺英网络	68,450	492,155.50	0.23
182	002180	纳思达	17,800	488,788.00	0.23
183	600525	长园集团	45,740	483,471.80	0.23
184	000686	东北证券	75,400	483,314.00	0.23

185	000718	苏宁环球	131,400	482,238.00	0.23
186	600064	南京高科	65,080	477,687.20	0.23
187	603877	太平鸟	14,300	476,619.00	0.23
188	000488	晨鸣纸业	36,500	471,580.00	0.22
189	002127	南极电商	50,100	470,439.00	0.22
190	002635	安洁科技	27,350	470,420.00	0.22
191	600967	内蒙一机	36,900	470,106.00	0.22
192	002051	中工国际	30,648	467,994.96	0.22
193	601127	小康股份	27,000	466,830.00	0.22
194	603198	迎驾贡酒	25,200	462,924.00	0.22
195	601128	常熟银行	80,500	460,460.00	0.22
196	000685	中山公用	57,560	458,753.20	0.22
197	002707	众信旅游	47,500	456,000.00	0.22
198	002503	搜于特	129,560	453,460.00	0.21
199	601000	唐山港	191,360	449,696.00	0.21
200	000519	中兵红箭	57,755	448,756.35	0.21
201	600754	锦江股份	12,100	447,216.00	0.21
202	000727	华东科技	237,700	446,876.00	0.21
203	002426	胜利精密	124,100	446,760.00	0.21
204	600266	北京城建	47,400	445,560.00	0.21
205	000598	兴蓉环境	109,200	443,352.00	0.21
206	002841	视源股份	8,300	443,303.00	0.21
207	300418	昆仑万维	23,400	441,792.00	0.21
208	603659	璞泰来	6,900	440,841.00	0.21
209	002244	滨江集团	84,700	440,440.00	0.21
210	000501	鄂武商 A	35,830	440,350.70	0.21
211	002129	中环股份	56,100	439,263.00	0.21
212	002152	广电运通	74,400	437,472.00	0.21
213	600748	上实发展	86,470	435,808.80	0.21
214	000089	深圳机场	56,800	434,520.00	0.21
215	600760	中航沈飞	12,000	432,480.00	0.20
216	002013	中航机电	57,068	432,004.76	0.20
217	000738	航发控制	32,400	431,892.00	0.20
218	002544	杰赛科技	31,500	431,235.00	0.20
219	600575	皖江物流	116,200	431,102.00	0.20
220	300315	掌趣科技	101,400	423,852.00	0.20
221	000681	视觉中国	14,700	421,890.00	0.20
222	600201	生物股份	24,622	420,789.98	0.20
223	600879	航天电子	59,800	420,394.00	0.20

224	000778	新兴铸管	97,600	417,728.00	0.20
225	600183	生益科技	45,575	417,467.00	0.20
226	600169	太原重工	177,100	414,414.00	0.20
227	600996	贵广网络	55,800	414,036.00	0.20
228	002251	步步高	36,344	413,594.72	0.20
229	002249	大洋电机	95,900	413,329.00	0.20
230	600179	安通控股	40,640	411,683.20	0.19
231	600291	西水股份	30,800	411,488.00	0.19
232	601098	中南传媒	32,500	410,800.00	0.19
233	002195	二三四五	95,810	410,066.80	0.19
234	603766	隆鑫通用	75,450	409,693.50	0.19
235	603888	新华网	24,250	408,855.00	0.19
236	002110	三钢闽光	25,400	407,162.00	0.19
237	002354	天神娱乐	43,900	406,514.00	0.19
238	603899	晨光文具	12,800	405,632.00	0.19
239	002414	高德红外	30,110	404,678.40	0.19
240	600298	安琪酵母	11,300	403,184.00	0.19
241	600316	洪都航空	43,070	401,412.40	0.19
242	002563	森马服饰	28,000	400,400.00	0.19
243	603885	吉祥航空	25,800	397,578.00	0.19
244	300159	新研股份	56,100	397,188.00	0.19
245	603056	德邦股份	14,500	397,155.00	0.19
246	002183	怡亚通	59,600	396,340.00	0.19
247	600120	浙江东方	29,250	396,337.50	0.19
248	002818	富森美	14,900	393,062.00	0.19
249	600004	白云机场	30,000	392,700.00	0.19
250	600640	号百控股	38,460	391,138.20	0.19
251	002375	亚厦股份	72,800	388,752.00	0.18
252	600717	天津港	51,400	387,042.00	0.18
253	600388	龙净环保	30,200	385,956.00	0.18
254	600410	华胜天成	44,060	385,525.00	0.18
255	600466	蓝光发展	61,880	383,656.00	0.18
256	600350	山东高速	94,400	382,320.00	0.18
257	000712	锦龙股份	38,299	382,224.02	0.18
258	002416	爱施德	64,980	381,432.60	0.18
259	600936	广西广电	80,100	381,276.00	0.18
260	600073	上海梅林	57,300	380,472.00	0.18
261	600503	华丽家族	96,600	377,706.00	0.18
262	600611	大众交通	94,600	376,508.00	0.18

263	603569	长久物流	26,360	376,420.80	0.18
264	000877	天山股份	55,400	373,950.00	0.18
265	603515	欧普照明	8,000	373,920.00	0.18
266	000690	宝新能源	53,600	373,056.00	0.18
267	600862	中航高科	60,400	371,460.00	0.18
268	002308	威创股份	44,600	370,180.00	0.18
269	000979	中弘股份	366,448	370,112.48	0.18
270	000009	中国宝安	75,500	369,950.00	0.18
271	300253	卫宁健康	29,710	368,106.90	0.17
272	002482	广田集团	61,650	368,050.50	0.17
273	001696	宗申动力	74,500	365,050.00	0.17
274	002410	广联达	13,100	363,263.00	0.17
275	000988	华工科技	25,000	361,250.00	0.17
276	002131	利欧股份	171,421	359,984.10	0.17
277	600594	益佰制药	40,100	359,296.00	0.17
278	600598	北大荒	39,200	359,072.00	0.17
279	600329	中新药业	18,800	357,200.00	0.17
280	000860	顺鑫农业	9,500	356,250.00	0.17
281	000750	国海证券	99,000	353,430.00	0.17
282	002657	中科金财	22,300	353,232.00	0.17
283	000156	华数传媒	36,600	352,824.00	0.17
284	000027	深圳能源	71,304	352,241.76	0.17
285	300134	大富科技	39,300	351,342.00	0.17
286	002807	江阴银行	62,400	350,688.00	0.17
287	600184	光电股份	28,300	350,637.00	0.17
288	000547	航天发展	44,600	348,326.00	0.16
289	002190	成飞集成	20,300	346,927.00	0.16
290	600292	远达环保	58,910	345,801.70	0.16
291	600409	三友化工	40,000	344,400.00	0.16
292	600839	四川长虹	120,200	343,772.00	0.16
293	000987	越秀金控	43,601	342,703.86	0.16
294	600428	中远海特	95,900	340,445.00	0.16
295	600633	浙数文化	40,600	338,604.00	0.16
296	000732	泰禾集团	17,400	338,430.00	0.16
297	002916	深南电路	5,300	336,603.00	0.16
298	600435	北方导航	41,200	336,192.00	0.16
299	600325	华发股份	43,280	334,554.40	0.16
300	603444	吉比特	2,600	332,254.00	0.16
301	002273	水晶光电	25,710	330,887.70	0.16

302	600418	江淮汽车	50,800	330,708.00	0.16
303	002439	启明星辰	15,500	328,910.00	0.16
304	600021	上海电力	48,400	326,216.00	0.15
305	000012	南玻A	65,573	324,586.35	0.15
306	000031	中粮地产	55,900	323,102.00	0.15
307	002672	东江环保	24,600	322,014.00	0.15
308	600639	浦东金桥	25,400	316,992.00	0.15
309	000400	许继电气	40,300	314,743.00	0.15
310	600787	中储股份	40,500	313,470.00	0.15
311	000729	燕京啤酒	46,100	310,253.00	0.15
312	600312	平高电气	54,600	307,944.00	0.15
313	600240	华业资本	41,900	307,127.00	0.15
314	600458	时代新材	41,700	306,912.00	0.15
315	002268	卫士通	13,900	303,437.00	0.14
316	600718	东软集团	22,900	299,074.00	0.14
317	600773	西藏城投	43,200	298,944.00	0.14
318	000600	建投能源	52,500	292,425.00	0.14
319	300166	东方国信	19,600	288,708.00	0.14
320	600158	中体产业	24,500	285,180.00	0.13
321	603019	中科曙光	6,200	284,394.00	0.13
322	002431	棕榈股份	42,250	283,497.50	0.13
323	600138	中青旅	14,100	281,013.00	0.13
324	002434	万里扬	32,000	280,960.00	0.13
325	300133	华策影视	26,300	280,095.00	0.13
326	600058	五矿发展	33,400	277,554.00	0.13
327	600643	爱建集团	29,420	276,548.00	0.13
328	600648	外高桥	15,000	274,200.00	0.13
329	002281	光迅科技	12,921	273,925.20	0.13
330	600917	重庆燃气	40,000	272,400.00	0.13
331	000536	华映科技	98,700	271,425.00	0.13
332	000766	通化金马	22,800	270,864.00	0.13
333	601880	大连港	138,420	268,534.80	0.13
334	000761	本钢板材	66,100	267,044.00	0.13
335	600086	东方金钰	26,400	265,056.00	0.13
336	002223	鱼跃医疗	13,455	262,237.95	0.12
337	600827	百联股份	25,600	261,120.00	0.12
338	600171	上海贝岭	22,500	260,550.00	0.12
339	002261	拓维信息	56,400	259,440.00	0.12
340	300146	汤臣倍健	15,600	258,960.00	0.12

341	000656	金科股份	53,700	257,760.00	0.12
342	600258	首旅酒店	9,400	255,398.00	0.12
343	002179	中航光电	6,508	253,812.00	0.12
344	000006	深振业 A	43,300	253,738.00	0.12
345	600260	凯乐科技	9,400	252,296.00	0.12
346	000592	平潭发展	88,400	251,056.00	0.12
347	300291	华录百纳	35,400	249,570.00	0.12
348	600517	置信电气	66,900	247,530.00	0.12
349	000977	浪潮信息	10,200	243,270.00	0.12
350	002368	太极股份	8,350	242,734.50	0.11
351	000661	长春高新	1,060	241,362.00	0.11
352	600750	江中药业	13,720	241,060.40	0.11
353	000969	安泰科技	38,300	239,375.00	0.11
354	002390	信邦制药	31,900	233,508.00	0.11
355	300043	星辉娱乐	58,300	233,200.00	0.11
356	002048	宁波华翔	18,700	230,571.00	0.11
357	002479	富春环保	40,600	229,390.00	0.11
358	600687	刚泰控股	25,143	228,549.87	0.11
359	603868	飞科电器	4,700	227,339.00	0.11
360	000813	德展健康	27,500	226,600.00	0.11
361	002371	北方华创	4,500	223,515.00	0.11
362	300032	金龙机电	39,800	223,278.00	0.11
363	002011	盾安环境	34,700	222,080.00	0.11
364	600536	中国软件	10,100	218,463.00	0.10
365	600939	重庆建工	44,139	218,046.66	0.10
366	600053	九鼎投资	12,600	216,342.00	0.10
367	600125	铁龙物流	25,800	215,946.00	0.10
368	002041	登海种业	31,000	211,420.00	0.10
369	600584	长电科技	12,400	210,056.00	0.10
370	603000	人民网	25,200	209,160.00	0.10
371	600848	上海临港	9,400	203,698.00	0.10
372	600166	福田汽车	100,200	203,406.00	0.10
373	600280	中央商场	23,200	202,304.00	0.10
374	600460	士兰微	16,500	201,300.00	0.10
375	601966	玲珑轮胎	12,700	200,279.00	0.09
376	002345	潮宏基	23,000	197,800.00	0.09
377	600300	维维股份	60,500	197,230.00	0.09
378	002670	国盛金控	18,291	196,994.07	0.09
379	600597	光明乳业	19,900	196,413.00	0.09

380	600751	海航科技	30,200	195,998.00	0.09
381	002505	大康农业	91,510	195,831.40	0.09
382	000930	中粮生化	19,000	195,700.00	0.09
383	600122	宏图高科	26,400	195,360.00	0.09
384	300055	万邦达	17,000	195,330.00	0.09
385	002049	紫光国微	4,400	194,128.00	0.09
386	600770	综艺股份	32,400	191,160.00	0.09
387	002690	美亚光电	8,000	190,720.00	0.09
388	000061	农产品	35,300	190,620.00	0.09
389	000401	冀东水泥	21,400	189,818.00	0.09
390	603658	安图生物	2,300	189,658.00	0.09
391	300115	长盈精密	14,600	189,362.00	0.09
392	600026	中远海能	44,200	187,408.00	0.09
393	000566	海南海药	14,500	186,905.00	0.09
394	600187	国中水务	65,600	186,304.00	0.09
395	300002	神州泰岳	44,600	185,982.00	0.09
396	600307	酒钢宏兴	87,500	183,750.00	0.09
397	603225	新凤鸣	9,120	182,126.40	0.09
398	300001	特锐德	15,900	180,624.00	0.09
399	600885	宏发股份	6,020	180,118.40	0.09
400	603589	口子窖	2,900	178,205.00	0.08
401	000829	天音控股	24,300	178,119.00	0.08
402	600366	宁波韵升	28,924	176,436.40	0.08
403	002002	鸿达兴业	38,211	176,152.71	0.08
404	600895	张江高科	15,200	174,800.00	0.08
405	603883	老百姓	2,100	174,636.00	0.08
406	002022	科华生物	14,707	174,277.95	0.08
407	000025	特力A	5,400	173,718.00	0.08
408	002489	浙江永强	47,360	172,390.40	0.08
409	600635	大众公用	45,750	170,190.00	0.08
410	000990	诚志股份	12,140	169,960.00	0.08
411	002509	天广中茂	57,500	167,325.00	0.08
412	002285	世联行	26,500	166,155.00	0.08
413	600422	昆药集团	21,390	165,772.50	0.08
414	600874	创业环保	17,700	165,318.00	0.08
415	000158	常山北明	24,040	165,154.80	0.08
416	300257	开山股份	10,800	165,132.00	0.08
417	002038	双鹭药业	4,300	163,357.00	0.08
418	000572	海马汽车	47,600	163,268.00	0.08

419	002663	普邦股份	54,726	162,536.22	0.08
420	601608	中信重工	62,200	161,720.00	0.08
421	600614	鹏起科技	27,600	157,596.00	0.07
422	002573	清新环境	13,600	157,080.00	0.07
423	002366	台海核电	10,900	155,434.00	0.07
424	002839	张家港行	25,000	152,250.00	0.07
425	600881	亚泰集团	38,900	145,097.00	0.07
426	600392	盛和资源	8,850	143,635.50	0.07
427	000587	金洲慈航	28,700	142,352.00	0.07
428	600521	华海药业	5,300	141,457.00	0.07
429	002353	杰瑞股份	8,700	141,375.00	0.07
430	600500	中化国际	20,500	139,810.00	0.07
431	600151	航天机电	34,200	138,852.00	0.07
432	600267	海正药业	9,300	135,222.00	0.06
433	300010	立思辰	11,000	134,640.00	0.06
434	600393	粤泰股份	36,400	131,768.00	0.06
435	002147	新光圆成	8,871	130,935.96	0.06
436	600141	兴发集团	11,160	130,014.00	0.06
437	300202	聚龙股份	12,400	129,332.00	0.06
438	600971	恒源煤电	18,100	129,234.00	0.06
439	600315	上海家化	3,200	126,816.00	0.06
440	002030	达安基因	8,133	125,410.86	0.06
441	603377	东方时尚	8,960	124,096.00	0.06
442	002028	思源电气	7,337	123,188.23	0.06
443	002589	瑞康医药	9,000	122,760.00	0.06
444	002254	泰和新材	10,780	122,676.40	0.06
445	601200	上海环境	7,600	120,308.00	0.06
446	002266	浙富控股	31,820	119,325.00	0.06
447	002399	海普瑞	5,300	117,342.00	0.06
448	600259	广晟有色	4,000	117,120.00	0.06
449	002681	奋达科技	13,500	116,910.00	0.06
450	300244	迪安诊断	6,120	116,341.20	0.06
451	600079	人福医药	8,800	116,336.00	0.06
452	002250	联化科技	13,100	115,542.00	0.05
453	002512	达华智能	11,900	115,430.00	0.05
454	002506	协鑫集成	24,500	114,660.00	0.05
455	600338	西藏珠峰	5,400	111,888.00	0.05
456	603355	莱克电气	3,700	111,185.00	0.05
457	002092	中泰化学	11,500	110,860.00	0.05

458	603188	亚邦股份	10,800	110,160.00	0.05
459	000612	焦作万方	20,900	109,725.00	0.05
460	300199	翰宇药业	7,600	108,528.00	0.05
461	603556	海兴电力	5,970	108,474.90	0.05
462	600416	湘电股份	14,900	107,131.00	0.05
463	600993	马应龙	6,270	106,652.70	0.05
464	000970	中科三环	11,400	106,590.00	0.05
465	002408	齐翔腾达	8,663	106,381.64	0.05
466	002212	南洋股份	8,900	105,821.00	0.05
467	002424	贵州百灵	9,300	105,648.00	0.05
468	002407	多氟多	7,500	105,150.00	0.05
469	002004	华邦健康	20,650	104,902.00	0.05
470	600777	新潮能源	47,900	104,901.00	0.05
471	300273	和佳股份	15,280	103,598.40	0.05
472	000806	银河生物	23,500	101,755.00	0.05
473	601969	海南矿业	18,400	100,832.00	0.05
474	000807	云铝股份	19,000	98,420.00	0.05
475	600651	飞乐音响	25,200	98,280.00	0.05
476	600759	洲际油气	24,640	97,081.60	0.05
477	600481	双良节能	31,542	96,518.52	0.05
478	000762	西藏矿业	10,000	96,300.00	0.05
479	002428	云南锗业	12,400	95,728.00	0.05
480	002073	软控股份	16,400	94,300.00	0.04
481	002665	首航节能	16,090	93,322.00	0.04
482	002342	巨力索具	24,100	91,339.00	0.04
483	002276	万马股份	15,500	90,520.00	0.04
484	002831	裕同科技	1,800	90,000.00	0.04
485	002920	德赛西威	3,000	89,700.00	0.04
486	002155	湖南黄金	13,000	88,920.00	0.04
487	300266	兴源环境	4,400	87,956.00	0.04
488	601872	招商轮船	20,000	72,200.00	0.03
489	600765	中航重机	9,700	72,168.00	0.03
490	300116	坚瑞沃能	10,000	27,600.00	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

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	002005	德豪润达	76,600	333,976.00	0.16
2	000669	金鸿控股	43,377	314,483.25	0.15
3	000939	凯迪生态	40,500	202,095.00	0.10
4	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.06
5	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.04
6	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.02
7	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.02
8	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.01
9	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.01
10	000693	*ST 华泽	1,000	3,310.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	000066	中国长城	2,498,574.00	1.16
2	300383	光环新网	2,077,938.00	0.96
3	600346	恒力股份	1,603,441.00	0.74
4	600623	华谊集团	1,546,720.98	0.72
5	002128	露天煤业	1,489,972.00	0.69
6	000960	锡业股份	1,464,432.00	0.68
7	000830	鲁西化工	1,379,584.66	0.64
8	002176	江特电机	1,311,299.00	0.61
9	600216	浙江医药	1,228,357.00	0.57
10	002589	瑞康医药	1,194,970.00	0.55
11	600884	杉杉股份	1,194,020.00	0.55
12	002118	紫鑫药业	1,181,267.00	0.55
13	600160	巨化股份	1,178,944.00	0.55
14	000636	风华高科	1,143,466.00	0.53
15	300273	和佳股份	1,141,891.78	0.53
16	002440	闰土股份	1,137,470.00	0.53

17	000426	兴业矿业	1,110,539.00	0.51
18	603369	今世缘	1,108,761.00	0.51
19	600348	阳泉煤业	1,107,397.00	0.51
20	600380	健康元	1,104,432.00	0.51

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	000066	中国长城	2,442,745.34	1.13
2	600346	恒力股份	2,096,171.79	0.97
3	300383	光环新网	1,857,190.00	0.86
4	600623	华谊集团	1,542,138.00	0.71
5	002422	科伦药业	1,531,181.00	0.71
6	000960	锡业股份	1,531,096.00	0.71
7	002589	瑞康医药	1,491,282.28	0.69
8	600566	济川药业	1,412,255.00	0.65
9	600536	中国软件	1,405,269.00	0.65
10	000860	顺鑫农业	1,377,118.00	0.64
11	300273	和佳股份	1,358,987.00	0.63
12	000807	云铝股份	1,273,689.00	0.59
13	600884	杉杉股份	1,242,084.60	0.57
14	002032	苏泊尔	1,208,673.95	0.56
15	000977	浪潮信息	1,166,260.00	0.54
16	000732	泰禾集团	1,133,297.00	0.52
17	603369	今世缘	1,131,245.00	0.52
18	002681	奋达科技	1,122,846.00	0.52
19	000830	鲁西化工	1,120,903.00	0.52
20	002050	三花智控	1,112,838.18	0.51

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	223,487,469.94
卖出股票收入（成交）总额	200,631,230.75

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	3,000,300.00	1.42
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,000,300.00	1.42

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019571	17 国债 17	30,000	3,000,300.00	1.42

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 本期国债期货投资政策

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 本期国债期货投资评价

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	87,524.70
2	应收证券清算款	381,937.43
3	应收股利	-
4	应收利息	96,639.77
5	应收申购款	5,136.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	571,238.85

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

本基金本报告期末指数投资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

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	002005	德豪润达	333,976.00	0.16	重大资产重组
2	000669	金鸿控股	314,483.25	0.15	重大资产重组
3	000939	凯迪生态	202,095.00	0.10	实行退市风险警示公告

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	118	9,126.58	33,100.00	3.07%	1,043,836.00	96.93%
西部利得中证 500 等权重指数分级 B	461	2,336.09	3,743.00	0.35%	1,073,193.00	99.65%
西部利得中证 500 等权重指数分级	1,629	148,692.34	235,747,809.89	97.33%	6,472,013.93	2.67%
合计	2,208	110,676.49	235,784,652.89	96.49%	8,589,042.93	3.51%

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，比例的分母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%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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	0~10
	合计	0~10

§ 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	106,736.00	1,067,136.00	210,141,890.83
本报告期基金总申购份额	-	-	28,092,621.00
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	1,279,176.60
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	9,800.00	9,800.00	5,264,488.59
本报告期期末基金份额总额	1,076,936.00	1,076,936.00	242,219,823.82

注：其中“总申购份额”含红利再投、转换入份额；“总赎回份额”含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开本基金份额持有人大会，无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人无重大人事变动。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变更。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金进行审计。

10.6 管理人、托管人及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			
太平洋证券	2	166,386,948.88	39.45%	105,040.66	40.39%	-
海通证券	1	79,064,629.53	18.75%	42,007.07	16.15%	-
东兴证券	2	75,711,833.47	17.95%	50,570.93	19.45%	-
中信建投	2	35,705,759.79	8.47%	30,655.30	11.79%	-
东北证券	2	26,475,032.30	6.28%	11,419.10	4.39%	-
西部证券	2	22,702,821.73	5.38%	12,061.18	4.64%	-
银河证券	2	8,067,178.24	1.91%	1,301.25	0.50%	-
申万宏源	2	7,651,880.23	1.81%	7,010.97	2.70%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	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。

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
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	1,028,752.34	100.00%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

本报告期内本基金未发生其他重大事件。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	>6 个月	197,112,840.32	4,906,532.84	-	202,019,373.16	82.67%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金为指数分级基金，其主要风险包括但不限于：中证 500 指数波动风险、流动性风险等。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准本基金设立的相关文件；
- (2) 本基金《基金合同》；
- (3) 本基金《招募说明书》；
- (4) 本基金《托管协议》；
- (5) 基金管理人《基金管理资格证书》及《企业法人营业执照》；
- (6) 报告期内本基金公告的各项原稿。

12.2 存放地点

本基金管理人处——上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 11 楼

12.3 查阅方式

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

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

西部利得基金管理有限公司

2018 年 8 月 28 日