

# 西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资 基金 2015 年半年度报告

2015 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：二〇一五年八月二十五日

## § 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 2015 年 8 月 24 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 2015 年 4 月 15 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	55

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>56</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	56
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	57
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	58
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>58</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>59</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	59
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 .....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	59
10.4 基金投资策略的改变 .....	59
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 .....	59
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 .....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	59
10.8 其他重大事件 .....	60
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>62</b>
11.1 备查文件目录 .....	62
11.2 存放地点 .....	62
11.3 查阅方式 .....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金		
基金简称	西部利得中证 500 等权重指数分级		
场内简称	500 等权		
基金主代码	502000		
基金运作方式	上市契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 4 月 15 日		
基金管理人	西部利得基金管理有限公司		
基金托管人	兴业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	53,058,266.29 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所		
上市日期	2015 年 4 月 27 日		
下属分级基金的基金简称	西部利得中证 500 等权重指数分级	西部利得中证 500 等权重指数分级A	西部利得中证 500 等权重指数分级B
下属分级基金场内简称:	500 等权	500 等权 A	500 等权 B
下属分级基金的交易代码	502000	502001	502002
报告期末下属分级基金份额总额	22,408,352.29 份	15,324,957.00 份	15,324,957.00 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的成果，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</p>

	<p>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"> <li>1) 法律法规的限制；</li> <li>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；</li> <li>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；</li> <li>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；</li> <li>5) 预期标的指数的成份股即将调整。</li> </ol> <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 <math>\beta</math> 值相近等原则来选择替代股票。</p> <p>(2) 股票组合调整方法</p> <p>本基金将采用完全复制法构建股票投资组合，根据中证 500 等权重指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。同时，本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增发等因素的变化，对股票投资组合进行适时调整，以保证基金净值增长率与中证 500 等权重指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等流动性好的债券。本基金对债券进行配置的原则是：安全性与流动性优先，且兼顾收益性。</p> <p>本基金在满足安全性与流动性的前提下，通过对国内外宏观经济形势的把握和系统分析国内财政政策与货币市场政策等因素变化对债券市场的影响，审慎研判债券市场风险收益特征的变化趋势，采取自上而下的策略构造组合，进行个券选择。</p>		
业绩比较基准	95%×中证 500 等权重指数收益率+5%×商业银行人民币活期存款利率（税后）		
下属分级基金的风险收益特征	500 等权份额为股票型指数份额，其预期风险大于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。	500 等权 A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征。	500 等权 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		西部利得基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐剑钧	张志永
	联系电话	021-38572888	021-62677777-212004
	电子邮箱	service@westleadfund.com	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		4007-007-818;021-38572666	95561
传真		021-38572750	021-62159217
注册地址		上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 19 楼	福州市湖东路 154 号
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 11 楼	上海市江宁路 168 号兴业大厦 20 楼
邮政编码		200127	200041
法定代表人		安保和	高建平

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.westleadfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人处——上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 11 楼

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	西部利得基金管理有限公司	上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 11 楼

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 4 月 15 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	867,681.37
本期利润	480,329.46
加权平均基金份额本期利润	0.0046
本期加权平均净值利润率	0.44%
本期基金份额净值增长率	0.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	47,700.39
期末可供分配基金份额利润	0.0009

期末基金资产净值	53,105,966.68
期末基金份额净值	1.001
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2015年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	0.10%

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

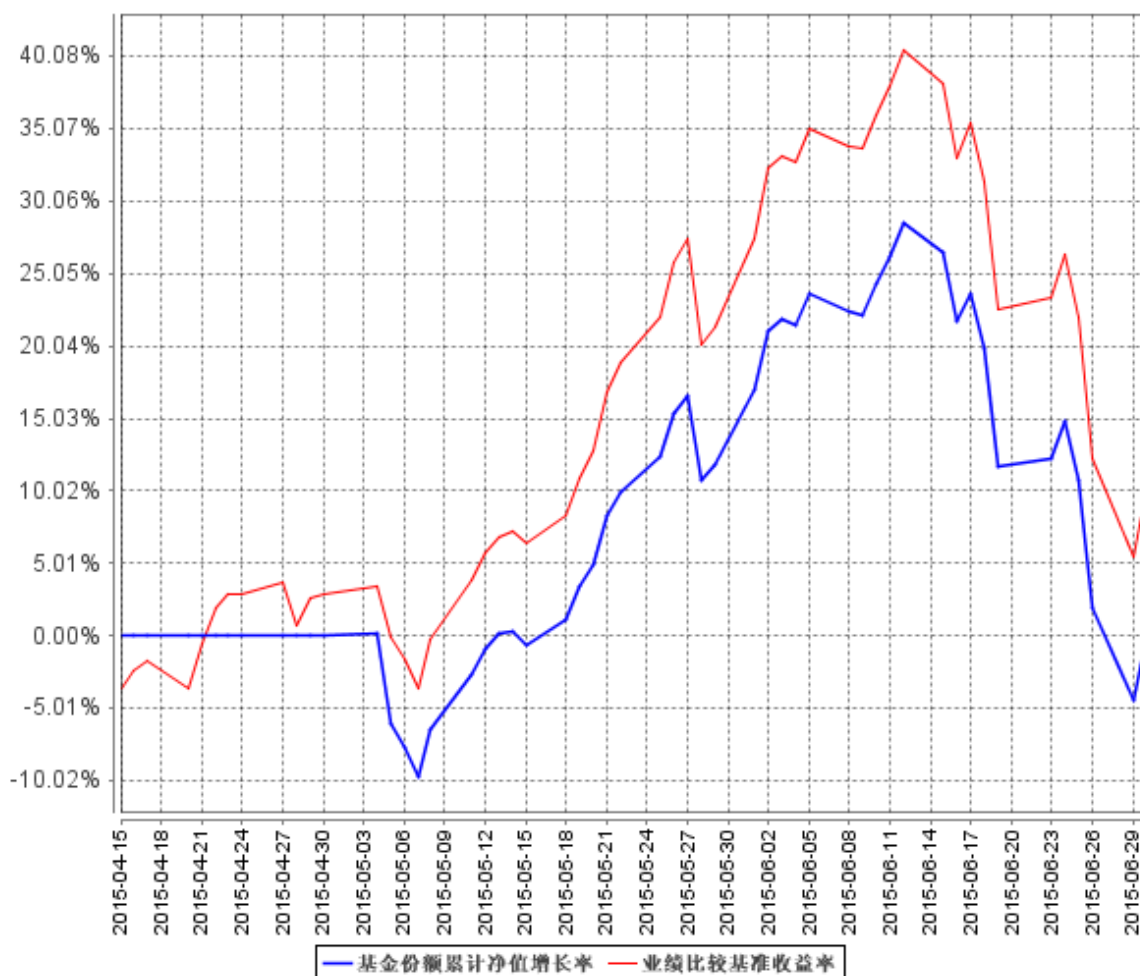
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-10.47%	3.61%	-8.96%	3.65%	-1.51%	-0.04%
自基金合同生效起至今	0.10%	2.80%	10.47%	2.94%	-10.37%	-0.14%



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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2015 年 4 月 15 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金生效时间未满一年。图示日期为 2015 年 4 月 15 日至 2015 年 6 月 30 日。

2、按照基金合同的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截止本报告期末，本基金尚处于建仓期。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

西部利得基金管理有限公司（简称“西部利得基金”，下同）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2010]864号）批准成立于 2010 年 7 月 20 日，公司由西部证券股份有限公司和上海利得财富资产管理有限公司合资设立，注册资本 3 亿元人民币，其中西部证券股份有限公司出资 51%，

上海利得财富资产管理有限公司出资 49%，注册地上海。

截至 2015 年 6 月 30 日，西部利得基金共管理六只开放式基金——西部利得策略优选股票型证券投资基金、西部利得新动向灵活配置混合型证券投资基金、西部利得稳健双利债券型证券投资基金、西部利得稳定增利债券型发起式证券投资基金、西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金和西部利得成长精选灵活配置混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
付琦	本基金基金经理、西部利得策略优选股票基金基金经理、西部利得新动向混合基金基金经理、公司总经理助理兼投资总监兼投资研究部总监	2015 年 4 月 15 日	-	十四年	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研究部总监，具有基金从业资格，中国国籍。
原泉	本基金基金经理、公司产品设计部总监	2015 年 4 月 15 日	-	五年	复旦大学金融工程硕士；曾任财通基金管理有限公司产品经理、太平资产管理有限公司经理、日邮物流（中国）有限公司经理、万得资讯有限公司项目经理。2013 年 8 月加入本公司，现任公司产品设计部总监，具有基金从业资格，中国国籍。

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》、《西部利得中证 500

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

### 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

2015 年二季度 A 股行情前期整体出现较大幅度上涨，概念股一片火热，创业板、中小板一路

高歌迭创新高。但在进入 6 月中旬后又出现快速回落，开始出现连续下跌行情，各板块指数大幅回调，A 股市场呈现整体先扬后抑。二季度中，上证指数整体上涨 32.23%，而中证 500 等权重指数则因为侧重中小盘股的属性在二季度中上涨了 70.71%，大幅超越了上证指数。

本报告期内，本基金尚处于建仓期内，基金运作严格按照基金合同的各项要求，依据被动化指数投资方法进行投资管理。本基金为分级基金，为不同风险偏好的投资者提供了不同风险收益特征的投资工具。我们根据对市场行情分析判断以及日常申购、赎回情况，对股票仓位及头寸进行了合理安排，基本将跟踪误差控制在相对合理水平。

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.001 元，本报告期份额净值增长率为 0.10%，同期业绩比较基准增长率为 10.47%，和业绩基准的差约 10.37%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015 年上半年宽松的货币环境对经济的下滑起到了一定的支撑作用，但向实体经济的传导效果不佳，投资不足，难以拉动内需。我国经济整体运行于合理区间，经济结构调整出现积极变化。2015 年下半年货币市场保持宽松是大概率事件，预计依然会保持宽松的货币政策。投资对稳增长的关键性作用将逐步显现，基建投资将随着地方债券发行的推进逐步企稳回升，房地产投资将随着房屋销售回升而逐步企稳回升，制造业投资将随着融资成本下降和终端需求回升而继续企稳回升。

A 股市场在经历了历史上最剧烈的回撤之后，下半年 A 股将进入反复筑底的震荡期。总体看，预计下半年指数可能处于下有政策托底，上有高点压力的状态。

#### 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：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	997,581.51	-
结算备付金		2,279,435.70	-
存出保证金		183,209.25	-
交易性金融资产	6.4.7.2	50,310,123.17	-
其中：股票投资		50,310,123.17	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		161,284.95	-
应收利息	6.4.7.5	1,937.41	-
应收股利		-	-
应收申购款		71,069.61	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		54,004,641.60	-
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2014 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		401,455.84	-
应付管理人报酬		54,226.98	-
应付托管费		10,845.41	-
应付销售服务费		-	-

应付交易费用	6.4.7.7	388,397.05	-
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	43,749.64	-
负债合计		898,674.92	-
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	53,058,266.29	-
未分配利润	6.4.7.10	47,700.39	-
所有者权益合计		53,105,966.68	-
负债和所有者权益总计		54,004,641.60	-

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.001 元，基金份额总额 53,058,266.29 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：2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 4 月 15 日(基金 合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		1,421,544.12	-
1.利息收入		209,258.14	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	78,737.02	-
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		130,521.12	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,281,717.62	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,121,228.44	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.16	160,489.18	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-387,351.91	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	317,920.27	-

<b>减：二、费用</b>		941,214.66	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	228,652.22	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	45,730.48	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	624,595.29	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	42,236.67	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		480,329.46	-
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		480,329.46	-

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金

本报告期：2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	202,990,676.07	-	202,990,676.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	480,329.46	480,329.46
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-149,932,409.78	-432,629.07	-150,365,038.85
其中：1.基金申购款	102,680,914.89	1,286,229.77	103,967,144.66
2.基金赎回款	-252,613,324.67	-1,718,858.84	-254,332,183.51
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	53,058,266.29	47,700.39	53,105,966.68
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	-	-	-

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 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于 2015 年 8 月 25 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

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

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

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

#### (2) 金融负债的分类

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

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

(3) 当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。

当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;

且 2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

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

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述

所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	997,581.51
定期存款	-
其他存款	-
合计：	997,581.51

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	50,697,475.08	50,310,123.17	-387,351.91
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	50,697,475.08	50,310,123.17	-387,351.91

### 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 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	829.11
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	1,025.80
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	82.50
合计	1,937.41

### 6.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	388,397.05
银行间市场应付交易费用	-
合计	388,397.05

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,512.97
预提费用	37,663.59
应付指数使用费	4,573.08
合计	43,749.64

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	202,990,676.07	202,990,676.07



本期申购	102,680,914.89	102,680,914.89
本期赎回(以“-”号填列)	-252,613,324.67	-252,613,324.67
- 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	53,058,266.29	53,058,266.29

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	867,681.37	-387,351.91	480,329.46
本期基金份额交易产生的变动数	1,652,907.83	-2,085,536.90	-432,629.07
其中：基金申购款	-144,379.59	1,430,609.36	1,286,229.77
基金赎回款	1,797,287.42	-3,516,146.26	-1,718,858.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,520,589.20	-2,472,888.81	47,700.39

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年4月15日(基金合同生效日)至2015年 6月30日
活期存款利息收入	60,308.22
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	15,424.12
其他	3,004.68
合计	78,737.02

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年4月15日(基金合同生效日)至 2015年6月30日
卖出股票成交总额	188,527,553.99
减：卖出股票成本总额	187,406,325.55
买卖股票差价收入	1,121,228.44

**6.4.7.13 债券投资收益**

本基金本报告期末未持有债券，债券投资收益为零。

**6.4.7.14 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。

**6.4.7.15 贵金属投资收益**

贵金属不在本基金投资范围内。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	160,489.18
基金投资产生的股利收益	-
合计	160,489.18

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-387,351.91
——股票投资	-387,351.91
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-387,351.91

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	317,920.27
合计	317,920.27

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	624,595.29
银行间市场交易费用	-
合计	624,595.29

### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	14,062.32
信息披露费	23,601.27
指数使用费	4,573.08
合计	42,236.67

## 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 2015 年 6 月 30 日止，本基金未发生需要披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至 2015 年 6 月 30 日止，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期的关联方交易

### 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

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期应支付关联方的佣金为零。

### 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
	2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	228,652.22	-
其中：支付销售机构的客户维护费	10,272.39	-

注：支付基金管理人西部利得基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1%的年费率计提，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
	2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	45,730.48	-

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

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.2%/当年天数

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

**6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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	997,581.51	60,308.22	-	-

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

2. 本基金通过“兴业银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2015 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 2,279,435.70 元。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券的情况。

**6.4.11 利润分配情况**

根据本基金基金合同，本基金不进行利润分配。

**6.4.12 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002183	怡亚通	-	临时停牌	73.15	-	-	5,800	256,908.92	424,270.00	-
600869	智慧能源	-	临时停牌	29.14	-	-	14,000	386,445.42	407,960.00	-
002276	万马	-	临时	34.15	-	-	7,600	182,365.35	259,540.00	-

	股份		停牌							
600978	宜华木业	-	临时停牌	22.44	-	-	11,000	172,741.51	246,840.00	-
002414	高德红外	-	临时停牌	39.36	-	-	5,500	194,803.37	216,480.00	-
000066	长城电脑	-	临时停牌	21.54	-	-	9,900	179,222.95	213,246.00	-
000850	华茂股份	-	临时停牌	10.98	-	-	18,400	213,257.90	202,032.00	-
002308	威创股份	-	临时停牌	31.00	-	-	6,300	100,375.95	195,300.00	-
000566	海南海药	-	临时停牌	49.97	-	-	3,900	169,466.83	194,883.00	-
002018	华信国际	-	临时停牌	44.08	-	-	4,400	111,123.15	193,952.00	-
002226	江南化工	-	临时停牌	13.18	-	-	14,600	164,985.26	192,428.00	-
002368	太极股份	-	临时停牌	65.52	-	-	2,850	157,432.53	186,732.00	-
000650	仁和药业	-	临时停牌	17.17	-	-	10,725	116,251.42	184,148.25	-
002325	洪涛股份	-	临时停牌	31.15	-	-	5,900	112,968.82	183,785.00	-
002223	鱼跃医疗	-	临时停牌	67.20	-	-	2,670	115,522.40	179,424.00	-
002191	劲嘉股份	-	临时停牌	19.22	-	-	9,300	141,169.10	178,746.00	-
300144	宋城演艺	-	临时停牌	76.47	-	-	2,200	166,498.46	168,234.00	-
600482	风帆股份	-	临时停牌	42.38	-	-	3,900	94,244.55	165,282.00	-
600654	中安消	-	临时停牌	30.91	-	-	5,100	126,564.56	157,641.00	-
002269	美邦服饰	-	临时停牌	11.86	-	-	12,200	104,057.95	144,692.00	-
000732	泰禾集团	-	临时停牌	34.20	-	-	4,200	135,567.15	143,640.00	-
002194	武汉凡谷	-	临时停牌	26.98	-	-	5,300	83,978.23	142,994.00	-
002574	明牌珠宝	-	临时停牌	22.90	-	-	6,000	86,424.56	137,400.00	-
000688	建新矿业	-	临时停牌	17.07	-	-	7,900	79,568.28	134,853.00	-

600366	宁波韵升	-	临时停牌	35.09	-	-	3,800	107,185.52	133,342.00	-
600110	中科英华	-	临时停牌	13.73	-	-	9,600	86,088.16	131,808.00	-
000748	长城信息	-	临时停牌	34.88	-	-	3,740	105,012.60	130,451.20	-
000979	中弘股份	-	临时停牌	6.04	-	-	21,120	104,971.23	127,564.80	-
600879	航天电子	-	临时停牌	23.59	-	-	5,400	122,440.49	127,386.00	-
601718	际华集团	-	临时停牌	15.12	-	-	8,100	83,779.00	122,472.00	-
000543	皖能电力	-	临时停牌	21.36	-	-	5,600	95,974.18	119,616.00	-
600410	华胜天成	-	临时停牌	47.84	-	-	2,500	90,270.02	119,600.00	-
600416	湘电股份	-	临时停牌	22.64	-	-	5,200	96,231.33	117,728.00	-
001696	宗申动力	-	临时停牌	17.25	-	-	6,800	168,034.47	117,300.00	-
600587	新华医疗	-	临时停牌	58.63	-	-	2,000	104,910.17	117,260.00	-
600078	澄星股份	-	临时停牌	15.23	-	-	7,500	75,750.54	114,225.00	-
600175	美都能源	-	临时停牌	10.64	-	-	10,700	84,934.04	113,848.00	-
002665	首航节能	-	临时停牌	27.70	-	-	4,100	120,511.14	113,570.00	-
600790	轻纺城	-	临时停牌	13.38	-	-	8,450	96,454.21	113,061.00	-
002242	九阳股份	-	临时停牌	19.45	-	-	5,800	93,815.62	112,810.00	-
000697	炼石有色	-	临时停牌	33.83	-	-	3,300	120,139.74	111,639.00	-
002309	中利科技	-	临时停牌	33.39	-	-	3,300	87,331.26	110,187.00	-
002091	江苏国泰	-	临时停牌	26.22	-	-	4,200	87,819.86	110,124.00	-
601311	骆驼股份	-	临时停牌	28.20	-	-	3,800	80,505.27	107,160.00	-
002238	天威视讯	-	临时停牌	23.76	-	-	4,510	99,740.02	107,157.60	-
002461	珠江	-	临时	26.40	-	-	4,000	69,323.38	105,600.00	-

	啤酒		停牌							
000519	江南 红箭	-	临时 停牌	26.06	-	-	3,900	73,834.31	101,634.00	-
600312	平高 电气	-	临时 停牌	22.58	-	-	4,400	94,778.12	99,352.00	-
600335	国机 汽车	-	临时 停牌	37.93	-	-	2,600	74,861.67	98,618.00	-
600333	长春 燃气	-	临时 停牌	11.97	-	-	8,200	91,300.51	98,154.00	-
600499	科达 洁能	-	临时 停牌	29.64	-	-	3,300	84,740.95	97,812.00	-
600702	沱牌 舍得	-	临时 停牌	26.11	-	-	3,600	87,854.50	93,996.00	-
002069	獐子 岛	-	临时 停牌	19.76	-	-	4,700	83,660.92	92,872.00	-
002662	京威 股份	-	临时 停牌	17.84	-	-	5,124	94,604.18	91,412.16	-
000887	中鼎 股份	-	临时 停牌	24.75	-	-	3,500	92,088.86	86,625.00	-
600643	爱建 股份	-	临时 停牌	16.73	-	-	5,070	78,835.41	84,821.10	-
300291	华录 百纳	-	临时 停牌	37.76	-	-	2,200	116,782.00	83,072.00	-
000788	北大 医药	-	临时 停牌	20.72	-	-	3,700	75,039.12	76,664.00	-
002557	洽洽 食品	-	临时 停牌	16.38	-	-	4,650	86,413.09	76,167.00	-
002143	印纪 传媒	-	临时 停牌	32.01	-	-	2,300	83,282.00	73,623.00	-
000592	平潭 发展	-	临时 停牌	29.76	-	-	2,400	108,438.00	71,424.00	-
000693	华泽 钴镍	-	临时 停牌	20.57	-	-	2,800	75,163.99	57,596.00	-
002345	潮宏 基	-	临时 停牌	19.58	-	-	400	5,840.00	7,832.00	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。



### 6.4.13 金融工具风险及管理

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

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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。截至 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资。

#### **6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2015 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

本基金管理人通过监测组合久期、Beta 值等指标来衡量市场风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、存出保证金和结算备付金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 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	997,581.51	-	-	-	997,581.51
结算备付金	2,279,435.70	-	-	-	2,279,435.70
存出保证金	183,209.25	-	-	-	183,209.25
交易性金融资产	-	-	-	50,310,123.17	50,310,123.17
应收证券清算款	-	-	-	161,284.95	161,284.95
应收利息	-	-	-	1,937.41	1,937.41
应收申购款	-	-	-	71,069.61	71,069.61
资产总计	3,460,226.46	-	-	50,544,415.14	54,004,641.60
负债					
应付赎回款	-	-	-	401,455.84	401,455.84
应付管理人报酬	-	-	-	54,226.98	54,226.98
应付托管费	-	-	-	10,845.41	10,845.41
应付交易费用	-	-	-	388,397.05	388,397.05
其他负债	-	-	-	43,749.64	43,749.64
负债总计	-	-	-	898,674.92	898,674.92
利率敏感度缺口	3,460,226.46	-	-	49,645,740.22	53,105,966.68

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

期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 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	上年度末
----	-----	------

	2015 年 6 月 30 日		2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	50,310,123.17	94.74	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	50,310,123.17	94.74	-	-

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

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准（附注 6.4.1）以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015 年 6 月 30 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准（附注 6.4.1）上升 5%	2,400,000.00	-
	业绩比较基准（附注 6.4.1）下降 5%	-2,400,000.00	

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 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级的余额为

41,866,963.06 元，第二层级余额为 8,443,160.11，无属于第三层级的余额(2014 年 12 月 31 日，本基金尚未成立)。

(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级；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级还是第三层级。

(iii) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 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。

(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	50,310,123.17	93.16
	其中：股票	50,310,123.17	93.16
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	3,277,017.21	6.07
7	其他各项资产	417,501.22	0.77
8	合计	54,004,641.60	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	636,664.00	1.20
B	采矿业	1,776,154.00	3.34
C	制造业	30,571,137.42	57.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,498,682.25	2.82
E	建筑业	1,414,231.60	2.66
F	批发和零售业	3,336,549.50	6.28
G	交通运输、仓储和邮政业	1,584,525.60	2.98
H	住宿和餐饮业	80,460.00	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,129,237.60	4.01
J	金融业	282,420.10	0.53
K	房地产业	3,539,370.60	6.66
L	租赁和商务服务业	1,367,512.00	2.58
M	科学研究和技术服务业	148,879.50	0.28
N	水利、环境和公共设施管理业	291,558.00	0.55
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	58,758.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业	1,016,033.00	1.91
S	综合	577,950.00	1.09
	合计	50,310,123.17	94.74

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002183	怡亚通	5,800	424,270.00	0.80
2	600869	智慧能源	14,000	407,960.00	0.77
3	600026	中海发展	20,300	260,652.00	0.49
4	002276	万马股份	7,600	259,540.00	0.49
5	600978	宜华木业	11,000	246,840.00	0.46

6	002489	浙江永强	5,760	217,152.00	0.41
7	002414	高德红外	5,500	216,480.00	0.41
8	000066	长城电脑	9,900	213,246.00	0.40
9	000850	华茂股份	18,400	202,032.00	0.38
10	002308	威创股份	6,300	195,300.00	0.37
11	000566	海南海药	3,900	194,883.00	0.37
12	002018	华信国际	4,400	193,952.00	0.37
13	002226	江南化工	14,600	192,428.00	0.36
14	600428	中远航运	11,700	189,423.00	0.36
15	601012	隆基股份	11,900	187,306.00	0.35
16	002368	太极股份	2,850	186,732.00	0.35
17	000540	中天城投	14,763	186,013.80	0.35
18	601010	文峰股份	19,000	185,630.00	0.35
19	000650	仁和药业	10,725	184,148.25	0.35
20	002325	洪涛股份	5,900	183,785.00	0.35
21	600737	中粮屯河	8,645	179,902.45	0.34
22	002223	鱼跃医疗	2,670	179,424.00	0.34
23	002191	劲嘉股份	9,300	178,746.00	0.34
24	000062	深圳华强	3,100	176,917.00	0.33
25	000930	中粮生化	9,300	175,305.00	0.33
26	300144	宋城演艺	2,200	168,234.00	0.32
27	002161	远望谷	7,600	165,376.00	0.31
28	600200	江苏吴中	4,500	165,375.00	0.31
29	600482	风帆股份	3,900	165,282.00	0.31
30	002701	奥瑞金	6,300	163,989.00	0.31
31	601233	桐昆股份	8,200	163,672.00	0.31
32	000718	苏宁环球	11,300	163,059.00	0.31
33	600376	首开股份	8,300	160,107.00	0.30
34	601608	中信重工	9,700	158,110.00	0.30
35	600654	中安消	5,100	157,641.00	0.30
36	600151	航天机电	9,800	157,094.00	0.30
37	600704	物产中大	6,500	155,220.00	0.29
38	603555	贵人鸟	3,700	154,586.00	0.29
39	600021	上海电力	7,300	154,030.00	0.29
40	300147	香雪制药	4,940	152,152.00	0.29
41	000690	宝新能源	12,000	151,800.00	0.29
42	600895	张江高科	5,200	151,372.00	0.29
43	002093	国脉科技	9,300	148,800.00	0.28
44	000861	海印股份	6,900	148,281.00	0.28



45	600171	上海贝岭	6,010	146,944.50	0.28
46	600219	南山铝业	14,500	146,305.00	0.28
47	000620	新华联	10,700	145,734.00	0.27
48	000031	中粮地产	7,700	145,453.00	0.27
49	002269	美邦服饰	12,200	144,692.00	0.27
50	600481	双良节能	6,020	144,179.00	0.27
51	000732	泰禾集团	4,200	143,640.00	0.27
52	600180	瑞茂通	5,000	143,300.00	0.27
53	002194	武汉凡谷	5,300	142,994.00	0.27
54	002244	滨江集团	7,600	139,916.00	0.26
55	600510	黑牡丹	9,000	139,680.00	0.26
56	600006	东风汽车	11,000	139,480.00	0.26
57	002030	达安基因	3,120	138,216.00	0.26
58	600176	中国巨石	5,100	138,006.00	0.26
59	002574	明牌珠宝	6,000	137,400.00	0.26
60	002285	世联行	6,400	137,216.00	0.26
61	000078	海王生物	6,200	136,400.00	0.26
62	600528	中铁二局	8,100	135,837.00	0.26
63	600201	金宇集团	1,900	135,128.00	0.25
64	000688	建新矿业	7,900	134,853.00	0.25
65	600380	健康元	8,800	133,408.00	0.25
66	600366	宁波韵升	3,800	133,342.00	0.25
67	600458	时代新材	5,300	133,030.00	0.25
68	000616	海航投资	12,800	132,864.00	0.25
69	000830	鲁西化工	13,300	132,468.00	0.25
70	002078	太阳纸业	16,500	132,000.00	0.25
71	002698	博实股份	2,500	132,000.00	0.25
72	600110	中科英华	9,600	131,808.00	0.25
73	002221	东华能源	4,400	131,252.00	0.25
74	000748	长城信息	3,740	130,451.20	0.25
75	600037	歌华有线	4,100	129,150.00	0.24
76	603077	和邦股份	6,200	128,960.00	0.24
77	002219	恒康医疗	2,900	128,934.00	0.24
78	600240	华业地产	8,400	128,184.00	0.24
79	000979	中弘股份	21,120	127,564.80	0.24
80	600879	航天电子	5,400	127,386.00	0.24
81	600770	综艺股份	6,500	127,010.00	0.24
82	600487	亨通光电	3,450	126,960.00	0.24
83	000090	天健集团	5,200	126,100.00	0.24

84	002408	齐翔腾达	7,274	124,676.36	0.23
85	000997	新大陆	4,680	124,488.00	0.23
86	600158	中体产业	4,300	123,195.00	0.23
87	000587	金叶珠宝	5,300	122,589.00	0.23
88	601718	际华集团	8,100	122,472.00	0.23
89	600521	华海药业	3,900	121,875.00	0.23
90	000596	古井贡酒	2,600	121,368.00	0.23
91	000418	小天鹅 A	5,070	121,173.00	0.23
92	002503	搜于特	6,400	120,832.00	0.23
93	002233	塔牌集团	7,000	120,820.00	0.23
94	600426	华鲁恒升	6,500	120,640.00	0.23
95	600387	海越股份	4,700	119,944.00	0.23
96	002029	七匹狼	5,700	119,700.00	0.23
97	000543	皖能电力	5,600	119,616.00	0.23
98	600410	华胜天成	2,500	119,600.00	0.23
99	600270	外运发展	4,060	118,389.60	0.22
100	600416	湘电股份	5,200	117,728.00	0.22
101	001696	宗申动力	6,800	117,300.00	0.22
102	600587	新华医疗	2,000	117,260.00	0.22
103	300115	长盈精密	3,500	116,585.00	0.22
104	600122	宏图高科	7,100	116,582.00	0.22
105	600601	方正科技	12,800	116,480.00	0.22
106	601886	江河创建	7,800	116,064.00	0.22
107	600826	兰生股份	3,000	115,890.00	0.22
108	600496	精工钢构	15,840	115,790.40	0.22
109	000680	山推股份	13,000	115,310.00	0.22
110	600835	上海机电	3,500	115,290.00	0.22
111	002384	东山精密	5,200	114,972.00	0.22
112	000088	盐田港	8,100	114,696.00	0.22
113	600816	安信信托	2,300	114,586.00	0.22
114	300253	卫宁软件	2,200	114,400.00	0.22
115	600078	澄星股份	7,500	114,225.00	0.22
116	002405	四维图新	2,600	113,880.00	0.21
117	600175	美都能源	10,700	113,848.00	0.21
118	002479	富春环保	6,200	113,770.00	0.21
119	600280	中央商场	8,200	113,734.00	0.21
120	002299	圣农发展	5,600	113,680.00	0.21
121	002665	首航节能	4,100	113,570.00	0.21
122	002073	软控股份	4,900	113,190.00	0.21

123	600790	轻纺城	8,450	113,061.00	0.21
124	002242	九阳股份	5,800	112,810.00	0.21
125	002004	华邦颖泰	8,650	112,277.00	0.21
126	002588	史丹利	3,900	112,125.00	0.21
127	600831	广电网络	6,600	112,002.00	0.21
128	600120	浙江东方	3,300	111,837.00	0.21
129	603366	日出东方	7,600	111,720.00	0.21
130	600300	维维股份	11,000	111,650.00	0.21
131	000697	炼石有色	3,300	111,639.00	0.21
132	600289	亿阳信通	5,600	111,608.00	0.21
133	000417	合肥百货	9,100	111,475.00	0.21
134	002174	游族网络	1,200	111,312.00	0.21
135	002022	科华生物	2,607	111,214.62	0.21
136	601515	东风股份	5,500	111,100.00	0.21
137	600329	中新药业	4,400	110,836.00	0.21
138	002050	三花股份	9,600	110,304.00	0.21
139	002309	中利科技	3,300	110,187.00	0.21
140	002091	江苏国泰	4,200	110,124.00	0.21
141	600184	光电股份	3,900	109,824.00	0.21
142	000021	深科技	7,200	109,800.00	0.21
143	002250	联化科技	4,900	109,760.00	0.21
144	600195	中牧股份	3,900	109,590.00	0.21
145	000951	中国重汽	3,801	109,544.82	0.21
146	002508	老板电器	2,850	109,326.00	0.21
147	600812	华北制药	9,000	109,260.00	0.21
148	600584	长电科技	5,700	108,927.00	0.21
149	002663	普邦园林	11,226	108,892.20	0.21
150	600776	东方通信	6,600	108,834.00	0.20
151	600320	振华重工	10,300	108,150.00	0.20
152	000961	中南建设	5,400	107,838.00	0.20
153	600298	安琪酵母	3,100	107,818.00	0.20
154	600743	华远地产	13,400	107,602.00	0.20
155	600685	广船国际	2,000	107,480.00	0.20
156	601777	力帆股份	6,800	107,372.00	0.20
157	601311	骆驼股份	3,800	107,160.00	0.20
158	002238	天威视讯	4,510	107,157.60	0.20
159	600525	长园集团	5,200	106,964.00	0.20
160	000703	恒逸石化	8,300	105,908.00	0.20
161	002672	东江环保	5,000	105,750.00	0.20

162	002595	豪迈科技	4,900	105,742.00	0.20
163	002461	珠江啤酒	4,000	105,600.00	0.20
164	002390	信邦制药	5,900	105,492.00	0.20
165	000852	江钻股份	3,100	104,935.00	0.20
166	601908	京运通	5,000	104,900.00	0.20
167	600468	百利电气	4,500	104,895.00	0.20
168	000933	神火股份	11,100	104,562.00	0.20
169	000028	国药一致	1,400	104,314.00	0.20
170	002551	尚荣医疗	2,400	104,136.00	0.20
171	000661	长春高新	800	104,000.00	0.20
172	600640	号百控股	3,600	103,968.00	0.20
173	002332	仙琚制药	6,000	103,920.00	0.20
174	300273	和佳股份	3,480	103,669.20	0.20
175	002251	步步高	4,244	103,553.60	0.19
176	000667	美好集团	15,400	103,488.00	0.19
177	600699	均胜电子	2,700	103,437.00	0.19
178	002573	清新环境	5,000	103,350.00	0.19
179	000488	晨鸣纸业	11,500	103,155.00	0.19
180	002293	罗莱家纺	5,700	103,113.00	0.19
181	600004	白云机场	6,100	103,090.00	0.19
182	600787	中储股份	6,400	103,040.00	0.19
183	603001	奥康国际	3,300	103,026.00	0.19
184	600488	天药股份	10,600	102,714.00	0.19
185	600618	氯碱化工	7,549	102,515.42	0.19
186	000572	海马汽车	12,200	102,358.00	0.19
187	002430	杭氧股份	7,700	101,794.00	0.19
188	000519	江南红箭	3,900	101,634.00	0.19
189	601965	中国汽研	7,750	100,827.50	0.19
190	000969	安泰科技	7,000	100,660.00	0.19
191	600675	中华企业	8,900	100,659.00	0.19
192	600409	三友化工	8,900	100,570.00	0.19
193	600859	王府井	3,187	100,390.50	0.19
194	600736	苏州高新	8,800	100,232.00	0.19
195	000012	南玻 A	7,500	100,050.00	0.19
196	002477	雏鹰农牧	5,200	99,840.00	0.19
197	002635	安洁科技	4,100	99,835.00	0.19
198	000603	盛达矿业	4,000	99,760.00	0.19
199	600059	古越龙山	6,500	99,580.00	0.19
200	000631	顺发恒业	12,300	99,507.00	0.19

201	600199	金种子酒	7,100	99,400.00	0.19
202	600312	平高电气	4,400	99,352.00	0.19
203	600198	大唐电信	2,800	99,232.00	0.19
204	000006	深振业 A	7,300	99,061.00	0.19
205	000780	平庄能源	10,600	98,792.00	0.19
206	600335	国机汽车	2,600	98,618.00	0.19
207	600333	长春燃气	8,200	98,154.00	0.18
208	600499	科达洁能	3,300	97,812.00	0.18
209	002271	东方雨虹	3,800	97,660.00	0.18
210	600056	中国医药	4,000	97,360.00	0.18
211	600757	长江传媒	7,000	97,300.00	0.18
212	600884	杉杉股份	3,400	97,240.00	0.18
213	601000	唐山港	7,100	97,199.00	0.18
214	000511	烯碳新材	7,900	96,775.00	0.18
215	600397	安源煤业	10,000	96,700.00	0.18
216	600881	亚泰集团	7,600	96,596.00	0.18
217	600611	大众交通	5,800	96,570.00	0.18
218	002428	云南锗业	4,100	96,391.00	0.18
219	600635	大众公用	9,850	96,333.00	0.18
220	600351	亚宝药业	7,100	96,134.00	0.18
221	300043	互动娱乐	6,400	96,064.00	0.18
222	600765	中航重机	3,500	96,005.00	0.18
223	002315	焦点科技	1,000	96,000.00	0.18
224	002317	众生药业	3,400	95,846.00	0.18
225	002396	星网锐捷	2,976	95,529.60	0.18
226	600260	凯乐科技	5,800	95,410.00	0.18
227	603766	隆鑫通用	3,800	95,380.00	0.18
228	002025	航天电器	3,640	95,368.00	0.18
229	600425	青松建化	9,700	95,254.00	0.18
230	600067	冠城大通	9,600	95,232.00	0.18
231	002371	七星电子	2,500	95,000.00	0.18
232	600507	方大特钢	10,500	94,920.00	0.18
233	600546	山煤国际	11,100	94,461.00	0.18
234	000681	视觉中国	2,300	94,438.00	0.18
235	000816	智慧农业	9,100	94,094.00	0.18
236	600702	沱牌舍得	3,600	93,996.00	0.18
237	002424	贵州百灵	1,500	93,840.00	0.18
238	002028	思源电气	5,100	93,840.00	0.18
239	000030	富奥股份	8,100	93,717.00	0.18

240	600586	金晶科技	13,600	93,568.00	0.18
241	000900	现代投资	9,100	93,366.00	0.18
242	600773	西藏城投	5,300	93,333.00	0.18
243	600729	重庆百货	2,900	93,322.00	0.18
244	002005	德豪润达	8,100	92,988.00	0.18
245	600284	浦东建设	5,700	92,967.00	0.18
246	600216	浙江医药	7,000	92,960.00	0.18
247	002069	獐子岛	4,700	92,872.00	0.17
248	600220	江苏阳光	11,200	92,848.00	0.17
249	600125	铁龙物流	6,000	92,580.00	0.17
250	600651	飞乐音响	4,500	92,565.00	0.17
251	600636	三爱富	4,560	92,476.80	0.17
252	600325	华发股份	5,100	92,310.00	0.17
253	600460	士兰微	10,000	92,300.00	0.17
254	002128	露天煤业	5,600	92,288.00	0.17
255	000758	中色股份	4,700	92,261.00	0.17
256	000656	金科股份	13,300	91,903.00	0.17
257	002392	北京利尔	10,600	91,584.00	0.17
258	000921	海信科龙	7,501	91,512.20	0.17
259	600058	五矿发展	2,800	91,476.00	0.17
260	000671	阳光城	4,400	91,432.00	0.17
261	600039	四川路桥	14,000	91,420.00	0.17
262	002662	京威股份	5,124	91,412.16	0.17
263	601101	昊华能源	8,000	91,200.00	0.17
264	600017	日照港	11,200	90,832.00	0.17
265	000426	兴业矿业	5,500	90,805.00	0.17
266	600572	康恩贝	4,000	90,800.00	0.17
267	600511	国药股份	1,800	90,702.00	0.17
268	000829	天音控股	6,100	90,585.00	0.17
269	600073	上海梅林	7,000	90,580.00	0.17
270	002444	巨星科技	4,900	90,552.00	0.17
271	002013	中航机电	3,250	90,512.50	0.17
272	000926	福星股份	6,400	90,304.00	0.17
273	002463	沪电股份	10,800	90,180.00	0.17
274	002419	天虹商场	5,300	90,100.00	0.17
275	600545	新疆城建	6,000	90,060.00	0.17
276	002342	巨力索具	9,500	89,965.00	0.17
277	600823	世茂股份	6,900	89,907.00	0.17
278	002011	盾安环境	6,200	89,838.00	0.17

279	600894	广日股份	4,500	89,820.00	0.17
280	002237	恒邦股份	7,500	89,775.00	0.17
281	000897	津滨发展	9,400	89,676.00	0.17
282	002181	粤传媒	6,080	89,376.00	0.17
283	002340	格林美	5,870	89,282.70	0.17
284	000988	华工科技	5,000	89,050.00	0.17
285	600673	东阳光科	9,000	89,010.00	0.17
286	002311	海大集团	6,440	88,807.60	0.17
287	601678	滨化股份	9,900	88,803.00	0.17
288	600997	开滦股份	10,300	88,786.00	0.17
289	600694	大商股份	1,605	88,724.40	0.17
290	002440	闰土股份	3,700	88,689.00	0.17
291	600509	天富能源	6,300	88,641.00	0.17
292	600759	洲际油气	5,800	88,624.00	0.17
293	002041	登海种业	5,000	88,450.00	0.17
294	601126	四方股份	2,900	88,450.00	0.17
295	600780	通宝能源	9,100	88,361.00	0.17
296	000513	丽珠集团	1,300	88,179.00	0.17
297	002064	华峰氨纶	9,700	87,979.00	0.17
298	000541	佛山照明	7,670	87,974.90	0.17
299	000877	天山股份	7,500	87,900.00	0.17
300	601369	陕鼓动力	7,500	87,825.00	0.17
301	002648	卫星石化	5,800	87,812.00	0.17
302	600885	宏发股份	2,800	87,752.00	0.17
303	002327	富安娜	7,100	87,614.00	0.16
304	002266	浙富控股	6,400	87,552.00	0.16
305	601801	皖新传媒	3,000	87,510.00	0.16
306	000823	超声电子	6,500	87,490.00	0.16
307	600851	海欣股份	6,900	87,354.00	0.16
308	600418	江淮汽车	6,200	87,296.00	0.16
309	000525	红太阳	3,900	87,243.00	0.16
310	600088	中视传媒	2,700	87,129.00	0.16
311	002431	棕榈园林	3,000	87,060.00	0.16
312	000415	渤海租赁	9,200	87,032.00	0.16
313	002254	泰和新材	5,400	86,940.00	0.16
314	002393	力生制药	1,900	86,792.00	0.16
315	002190	成飞集成	1,700	86,683.00	0.16
316	600436	片仔癀	1,300	86,671.00	0.16
317	000887	中鼎股份	3,500	86,625.00	0.16

318	600183	生益科技	8,500	86,615.00	0.16
319	000973	佛塑科技	7,200	86,400.00	0.16
320	000735	罗牛山	9,200	86,388.00	0.16
321	600748	上实发展	5,500	86,075.00	0.16
322	600971	恒源煤电	9,400	86,010.00	0.16
323	000552	靖远煤电	6,100	86,010.00	0.16
324	002358	森源电气	4,000	85,920.00	0.16
325	000422	湖北宜化	9,300	85,839.00	0.16
326	600187	国中水务	11,000	85,800.00	0.16
327	002267	陕天然气	5,525	85,582.25	0.16
328	600566	济川药业	2,900	85,492.00	0.16
329	601999	出版传媒	6,000	85,320.00	0.16
330	300088	长信科技	3,100	85,250.00	0.16
331	002122	天马股份	8,000	85,200.00	0.16
332	002678	珠江钢琴	4,200	85,176.00	0.16
333	000600	建投能源	5,800	85,144.00	0.16
334	600596	新安股份	6,100	85,034.00	0.16
335	000636	风华高科	6,800	84,864.00	0.16
336	300202	聚龙股份	2,100	84,840.00	0.16
337	600643	爱建股份	5,070	84,821.10	0.16
338	601666	平煤股份	11,200	84,784.00	0.16
339	600422	昆药集团	2,295	84,754.35	0.16
340	002482	广田股份	3,100	84,630.00	0.16
341	002056	横店东磁	2,700	84,456.00	0.16
342	002273	水晶光电	2,700	84,375.00	0.16
343	002275	桂林三金	3,300	84,348.00	0.16
344	000998	隆平高科	3,100	84,010.00	0.16
345	300039	上海凯宝	5,400	83,970.00	0.16
346	000528	柳工	7,100	83,922.00	0.16
347	600811	东方集团	6,800	83,844.00	0.16
348	600160	巨化股份	7,600	83,752.00	0.16
349	600761	安徽合力	5,000	83,650.00	0.16
350	000762	西藏矿业	4,400	83,600.00	0.16
351	002092	中泰化学	8,200	83,558.00	0.16
352	600456	宝钛股份	3,200	83,424.00	0.16
353	000726	鲁泰 A	6,000	83,400.00	0.16
354	603005	晶方科技	1,700	83,147.00	0.16
355	601005	重庆钢铁	14,600	83,074.00	0.16
356	300291	华录百纳	2,200	83,072.00	0.16



357	000563	陕国投 A	5,900	83,013.00	0.16
358	000931	中关村	5,900	82,954.00	0.16
359	600825	新华传媒	5,000	82,950.00	0.16
360	000869	张裕 A	1,700	82,943.00	0.16
361	600261	阳光照明	10,200	82,926.00	0.16
362	600805	悦达投资	5,300	82,839.00	0.16
363	600169	太原重工	9,300	82,770.00	0.16
364	000547	闽福发 A	3,100	82,708.00	0.16
365	600639	浦东金桥	3,400	82,586.00	0.16
366	600292	中电远达	2,700	82,458.00	0.16
367	002277	友阿股份	4,800	82,368.00	0.16
368	002225	濮耐股份	8,700	82,302.00	0.15
369	002168	深圳惠程	5,300	82,256.00	0.15
370	600403	大有能源	9,200	82,248.00	0.15
371	600259	广晟有色	1,400	82,124.00	0.15
372	600580	卧龙电气	4,600	82,018.00	0.15
373	600664	哈药股份	6,800	81,872.00	0.15
374	600522	中天科技	3,600	81,828.00	0.15
375	000919	金陵药业	4,200	81,816.00	0.15
376	600435	北方导航	1,800	81,666.00	0.15
377	002049	同方国芯	1,700	81,600.00	0.15
378	000652	泰达股份	8,000	81,440.00	0.15
379	600594	益佰制药	1,400	81,382.00	0.15
380	600517	置信电气	5,200	81,380.00	0.15
381	000049	德赛电池	1,700	81,090.00	0.15
382	601208	东材科技	7,100	81,082.00	0.15
383	600141	兴发集团	4,700	80,981.00	0.15
384	600064	南京高科	4,150	80,925.00	0.15
385	300072	三聚环保	2,400	80,880.00	0.15
386	000550	江铃汽车	2,200	80,740.00	0.15
387	600337	美克家居	5,400	80,676.00	0.15
388	600754	锦江股份	2,700	80,460.00	0.15
389	600970	中材国际	5,500	80,410.00	0.15
390	601001	大同煤业	8,700	80,388.00	0.15
391	600551	时代出版	3,700	80,327.00	0.15
392	600138	中青旅	3,800	80,256.00	0.15
393	000860	顺鑫农业	3,500	80,185.00	0.15
394	603699	纽威股份	3,200	79,968.00	0.15
395	002048	宁波华翔	3,828	79,584.12	0.15

396	000685	中山公用	2,700	79,461.00	0.15
397	600983	惠而浦	5,000	79,450.00	0.15
398	000848	承德露露	4,350	79,170.00	0.15
399	000939	凯迪电力	5,400	79,110.00	0.15
400	002437	誉衡药业	2,700	78,435.00	0.15
401	600062	华润双鹤	3,000	78,120.00	0.15
402	600429	三元股份	6,900	77,901.00	0.15
403	603369	今世缘	2,100	77,889.00	0.15
404	002179	中航光电	2,360	77,880.00	0.15
405	600850	华东电脑	1,400	77,546.00	0.15
406	600720	祁连山	7,300	77,307.00	0.15
407	002281	光迅科技	1,607	77,264.56	0.15
408	002155	湖南黄金	6,200	77,066.00	0.15
409	600993	马应龙	2,400	77,016.00	0.15
410	600500	中化国际	4,400	76,912.00	0.14
411	000788	北大医药	3,700	76,664.00	0.14
412	603328	依顿电子	2,500	76,650.00	0.14
413	000582	北部湾港	3,600	76,572.00	0.14
414	002557	洽洽食品	4,650	76,167.00	0.14
415	603899	晨光文具	1,900	76,114.00	0.14
416	600880	博瑞传播	4,900	76,097.00	0.14
417	002646	青青稞酒	2,600	75,868.00	0.14
418	002705	新宝股份	4,000	75,200.00	0.14
419	600557	康缘药业	2,700	75,141.00	0.14
420	002063	远光软件	2,400	75,048.00	0.14
421	300267	尔康制药	2,200	74,998.00	0.14
422	002216	三全食品	5,100	74,970.00	0.14
423	603698	航天工程	1,900	74,898.00	0.14
424	002480	新筑股份	4,600	74,796.00	0.14
425	000099	中信海直	4,200	74,676.00	0.14
426	002490	山东墨龙	6,200	74,462.00	0.14
427	002118	紫鑫药业	4,300	74,390.00	0.14
428	002642	荣之联	1,300	74,295.00	0.14
429	002466	天齐锂业	1,200	74,160.00	0.14
430	600750	江中药业	2,300	74,037.00	0.14
431	601226	华电重工	4,650	73,981.50	0.14
432	600808	马钢股份	13,900	73,948.00	0.14
433	002140	东华科技	3,300	73,788.00	0.14
434	600797	浙大网新	3,900	73,671.00	0.14

435	000719	大地传媒	3,300	73,656.00	0.14
436	002143	印纪传媒	2,300	73,623.00	0.14
437	601880	大连港	10,200	73,440.00	0.14
438	300274	阳光电源	2,400	73,368.00	0.14
439	600617	国新能源	4,000	73,080.00	0.14
440	600755	厦门国贸	6,500	73,060.00	0.14
441	600657	信达地产	8,800	72,512.00	0.14
442	002204	大连重工	5,400	72,144.00	0.14
443	600161	天坛生物	1,900	71,554.00	0.13
444	600143	金发科技	6,000	71,520.00	0.13
445	600392	盛和资源	2,800	71,428.00	0.13
446	000592	平潭发展	2,400	71,424.00	0.13
447	002681	奋达科技	2,600	71,396.00	0.13
448	600864	哈投股份	4,400	71,280.00	0.13
449	601002	晋亿实业	4,500	71,190.00	0.13
450	600478	科力远	4,180	71,143.60	0.13
451	000962	东方钨业	4,800	71,040.00	0.13
452	600801	华新水泥	6,700	70,819.00	0.13
453	600433	冠豪高新	4,600	70,794.00	0.13
454	600917	重庆燃气	5,600	70,784.00	0.13
455	002400	省广股份	2,800	70,728.00	0.13
456	002195	二三四五	1,700	70,652.00	0.13
457	000501	鄂武商 A	3,400	69,700.00	0.13
458	600267	海正药业	3,700	69,523.00	0.13
459	603019	中科曙光	800	69,272.00	0.13
460	002373	千方科技	1,600	69,264.00	0.13
461	600655	豫园商城	4,300	69,015.00	0.13
462	000975	银泰资源	4,000	68,920.00	0.13
463	600874	创业环保	5,400	68,850.00	0.13
464	300033	同花顺	800	68,792.00	0.13
465	603188	亚邦股份	2,400	68,784.00	0.13
466	600803	新奥股份	4,001	68,457.11	0.13
467	000401	冀东水泥	5,200	68,380.00	0.13
468	600563	法拉电子	2,200	68,090.00	0.13
469	600132	重庆啤酒	3,000	67,560.00	0.13
470	600536	中国软件	1,900	67,412.00	0.13
471	300134	大富科技	2,400	67,080.00	0.13
472	600079	人福医药	1,800	66,690.00	0.13
473	601717	郑煤机	6,100	66,551.00	0.13

474	600251	冠农股份	4,800	66,384.00	0.13
475	601139	深圳燃气	6,300	66,150.00	0.12
476	600498	烽火通信	2,500	66,150.00	0.12
477	000777	中核科技	2,000	65,700.00	0.12
478	600389	江山股份	2,100	65,604.00	0.12
479	600537	亿晶光电	3,611	64,636.90	0.12
480	603169	兰石重装	3,400	62,866.00	0.12
481	600112	天成控股	3,300	62,700.00	0.12
482	600446	金证股份	500	61,730.00	0.12
483	300244	迪安诊断	700	58,758.00	0.11
484	000693	华泽钴镍	2,800	57,596.00	0.11
485	002240	威华股份	4,000	54,240.00	0.10
486	002345	潮宏基	400	7,832.00	0.01

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601519	大智慧	1,858,060.00	3.50
2	601010	文峰股份	1,318,137.00	2.48
3	600026	中海发展	1,310,462.00	2.47
4	300059	东方财富	1,238,591.00	2.33
5	600021	上海电力	1,203,219.00	2.27
6	601012	隆基股份	1,086,584.00	2.05
7	300168	万达信息	1,032,668.00	1.94
8	600380	健康元	1,014,826.00	1.91
9	002183	怡亚通	995,385.00	1.87
10	000566	海南海药	989,772.00	1.86
11	000540	中天城投	965,742.57	1.82
12	600528	中铁二局	930,656.00	1.75
13	000066	长城电脑	898,417.59	1.69
14	300144	宋城演艺	876,803.00	1.65
15	600219	南山铝业	857,296.90	1.61

16	600978	宜华木业	852,087.00	1.60
17	600869	智慧能源	843,688.00	1.59
18	603555	贵人鸟	839,381.00	1.58
19	001696	宗申动力	832,701.00	1.57
20	600240	华业资本	809,864.65	1.52

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	601519	大智慧	1,708,048.00	3.22
2	300059	东方财富	1,222,443.00	2.30
3	300168	万达信息	1,098,581.00	2.07
4	601010	文峰股份	1,024,856.00	1.93
5	600026	中海发展	1,010,832.10	1.90
6	600021	上海电力	1,008,112.94	1.90
7	601012	隆基股份	876,898.00	1.65
8	000566	海南海药	845,318.00	1.59
9	600380	健康元	843,117.00	1.59
10	002183	怡亚通	833,551.00	1.57
11	600820	隧道股份	765,715.00	1.44
12	000540	中天城投	738,909.00	1.39
13	000066	长城电脑	737,929.64	1.39
14	601872	招商轮船	711,240.00	1.34
15	600528	中铁二局	699,188.00	1.32
16	600582	天地科技	693,917.42	1.31
17	002123	荣信股份	690,318.00	1.30
18	600978	宜华木业	688,834.00	1.30
19	603555	贵人鸟	685,280.99	1.29
20	300144	宋城演艺	684,634.00	1.29

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	238,103,800.63
卖出股票的收入（成交）总额	188,527,553.99

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

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

贵金属不在本基金投资范围内。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

股指期货不在本基金投资范围内。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货不在本基金投资范围内。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本基金投资国债期货的投资政策

国债期货不在本基金投资范围内。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

国债期货不在本基金投资范围内。

### 7.11.3 本基金投资国债期货的投资评价

国债期货不在本基金投资范围内。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

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

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	183,209.25
2	应收证券清算款	161,284.95
3	应收股利	-
4	应收利息	1,937.41
5	应收申购款	71,069.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	417,501.22

### 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

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	002183	怡亚通	424,270.00	0.80	临时停牌
2	600869	智慧能源	407,960.00	0.77	临时停牌
3	002276	万马股份	259,540.00	0.49	临时停牌
4	600978	宜华木业	246,840.00	0.46	临时停牌
5	002414	高德红外	216,480.00	0.41	临时停牌
6	000066	长城电脑	213,246.00	0.40	临时停牌
7	000850	华茂股份	202,032.00	0.38	临时停牌
8	002308	威创股份	195,300.00	0.37	临时停牌

### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
西部利得中证 500 等权重指数分级 A	366	41,871.47	11,641,666.00	75.97%	3,683,291.00	24.03%
西部利得中证 500 等权重指数分级 B	756	20,271.11	1,556,653.00	10.16%	13,768,304.00	89.84%
西部利得中证 500 等权重指数分级	1,776	12,617.32	16,126,207.00	71.97%	6,282,145.29	28.03%
合计	2,823	18,794.99	29,324,526.00	55.27%	23,733,740.29	44.73%

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 期末上市基金前十名持有人

#### 1. 西部利得中证 500 等权重指数分级 A:

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额
----	-------	---------	--------



			比例
1	银河资本—邮储银行—青昀套利 3 号资产管理计划	2,910,500.00	18.99%
2	银河资本—邮储银行—青昀 8 号资产管理计划	2,300,000.00	15.01%
3	中国太平洋保险(集团)股份有限公司—集团本级—自有资金—	1,922,511.00	12.54%
4	银河资本—邮储银行—青昀套利 4 号资产管理计划	1,587,650.00	10.36%
5	银河资本—光大银行—银河资本青昀套利 2 号资产管理计划	1,261,200.00	8.23%
6	银河资本—光大银行—银河资本—青昀 1 号资产管理计划	1,239,805.00	8.09%
7	董景秋	570,000.00	3.72%
8	张安南	407,800.00	2.66%
9	银河资本—邮储银行—银河资本青昀套利 6 号资产管理计划	320,000.00	2.09%
10	李澄章	135,500.00	0.88%

## 2. 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	银河资本—邮储银行—银河资本青昀套利 6 号资产管理计划	767,703.00	5.01%
2	徐建平	566,800.00	3.70%
3	银河资本—邮储银行—青昀 8 号资产管理计划	500,100.00	3.26%
4	刘自敏	500,000.00	3.26%
5	黄淑芳	365,700.00	2.39%
6	魏佐泓	346,800.00	2.26%
7	何国浚	327,900.00	2.14%
8	黄惠娟	304,500.00	1.99%
9	陈建平	300,000.00	1.96%
10	史莉萍	264,300.00	1.72%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	西部利得中证 500 等权重指数分级	0.00	0.0000%
	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%

	合计	0.00	0.0000%
--	----	------	---------

#### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	0
	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
	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	0
	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
	合计	0

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	西部利得中证 500 等权重指数分级	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
基金合同生效日（2015 年 4 月 15 日）基金份额总额	202,990,676.07	0.00	0.00
本报告期期初基金份额总额	-	-	-
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	102,680,914.89	0.00	0.00
减：基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	252,613,324.67	0.00	0.00
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-30,649,914.00	15,324,957.00	15,324,957.00
本报告期期末基金份额总额	22,408,352.29	15,324,957.00	15,324,957.00

注：本基金基金合同于 2015 年 4 月 15 日生效。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开本基金份额持有人大会，无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本基金聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金进行审计。本报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源	2	426,619,430.22	100.00%	388,397.05	100.00%	-

注：1. 基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资质雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各券商提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合席位券商标准的，由公司研究部提出席位券商的调整意见（调整名单及调整原因），并经公司批准。

### 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
申万宏源	-	-	-2,074,900,000.00	100.00%	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	西部利得基金管理有限公司关于旗下开放式基金 2014 年年度最后一个自然日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 1 月 5 日
2	关于西部利得基金管理有限公司旗下基金持有的停牌股票调整估值的提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 2 月 28 日
3	关于西部利得基金管理有限公司旗下基金持有的停牌股票调整估值的提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 3 月 3 日
4	西部利得基金管理有限公司关于旗下证券投资基金参加齐鲁证券有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 3 月 13 日
5	西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金份额发售公告	证券日报、公司网站	2015 年 3 月 24 日
6	西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同（摘要）	证券日报、公司网站	2015 年 3 月 24 日
7	西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金招募说明书	证券日报、公司网站	2015 年 3 月 24 日
8	西部利得基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 4 月 1 日

9	关于西部利得基金管理有限公司旗下基金持有的停牌股票调整估值的提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 4 月 2 日
10	关于西部利得基金管理有限公司旗下基金持有的停牌股票调整估值的提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 4 月 3 日
11	西部利得基金管理有限公司关于西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金提前结束募集的公告	证券日报、公司网站	2015 年 4 月 8 日
12	西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金经理变更公告	证券日报、公司网站	2015 年 4 月 10 日
13	西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同生效公告	证券日报、公司网站	2015 年 4 月 16 日
14	关于西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	证券日报、公司网站	2015 年 4 月 22 日
15	关于西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金开通份额配对转换业务的公告	证券日报、公司网站	2015 年 4 月 22 日
16	关于西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金开通跨系统转托管业务的公告	证券日报、公司网站	2015 年 4 月 22 日
17	西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金之西部利得中证 500 等权重份额、西部利得中证 500 等权重 A 份额及西部利得中证 500 等权重 B 份额上市交易公告书	证券日报、公司网站	2015 年 4 月 22 日
18	西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金之 500 等权、500 等权 A、500 等权 B 基金份额上市交易提示性公告	证券日报、公司网站	2015 年 4 月 27 日
19	关于西部利得基金管理有限公司旗下基金持有的停牌股票调整估值价格的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站、	2015 年 5 月 6 日
20	关于西部利得基金管理有限公司旗下基金持有的停牌股票调整估值价格的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站、	2015 年 5 月 19 日
21	关于西部利得基金管理有限公司旗下证券投资基金参与天天基金费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 5 月 27 日
22	关于西部利得基金管理有限公司旗下基金持有的停牌股票调整估值的提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015 年 6 月 9 日

23	关于西部利得基金管理有限公司 办公地址变更的公告	中国证券报、证券时 报、上海证券报、证 券日报、公司网站	2015 年 6 月 30 日
----	-----------------------------	------------------------------------	-----------------

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

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

### 11.2 存放地点

本基金管理人处——上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 11 楼

### 11.3 查阅方式

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

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

西部利得基金管理有限公司  
2015 年 8 月 25 日