

西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资 基金 2017 年半年度报告

2017 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：二〇一七年八月二十九日

§ 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 2017 年 8 月 28 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 2017 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	10
3.1 主要会计数据和财务指标	10
3.2 基金净值表现	10
3.3 其他指标	12
§4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	45
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
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.....	62
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.....	63
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.....	63
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	63
7.12 投资组合报告附注.....	64
§8 基金份额持有人信息.....	66
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	66
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	66
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.....	67
§9 开放式基金份额变动.....	68
§10 重大事件揭示.....	69
10.1 基金份额持有人大会决议.....	69
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.....	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	69
10.4 基金投资策略的改变.....	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	69
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.....	69
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	69
10.8 其他重大事件.....	71
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	72

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	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§12 备查文件目录.....	73
12.1 备查文件目录.....	73
12.2 存放地点.....	73
12.3 查阅方式.....	73

§ 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	213,334,851.54 份		
基金合同存续期	-		
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	1,524,836.00 份	1,524,836.00 份	210,285,179.54 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	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。 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。

1、资产配置策略

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。

2、股票投资策略

(1) 股票组合构建原则

本基金通过复制指数的方法,根据中证 500 等权重指数成份股组成及其基准权重构建股票投资组合。当预期成份股发生调整,成份股发生配股、增发、分红等行为,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证 500 等权重指数的效果可能带来影响时,基金管理人将根据市场情况,采取合理措施控制基金的跟踪误差。

在特殊情况下,本基金将选择其他股票或股票组合对标的指数中的股票加以适当替换,这些情况包括但不限于以下情形:

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。

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。

(2) 股票组合调整方法

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。

3、债券投资策略

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。

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。

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）		
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
外部注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	9,815,748.15
本期利润	2,125,610.84
加权平均基金份额本期利润	0.0102
本期加权平均净值利润率	1.03%
本期基金份额净值增长率	1.04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	-158,458,809.33
期末可供分配基金份额利润	-0.7428
期末基金资产净值	210,425,358.64
期末基金份额净值	0.9864
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-39.48%

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	4.91%	0.88%	4.64%	0.93%	0.27%	-0.05%
过去三个月	-2.86%	0.97%	-4.76%	1.02%	1.90%	-0.05%
过去六个月	1.04%	0.86%	-3.18%	0.89%	4.22%	-0.03%
过去一年	3.81%	0.88%	0.21%	0.89%	3.60%	-0.01%
自基金合同	-39.48%	1.99%	-19.78%	2.18%	-19.70%	-0.19%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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：

$benchmark(0)=1000;$

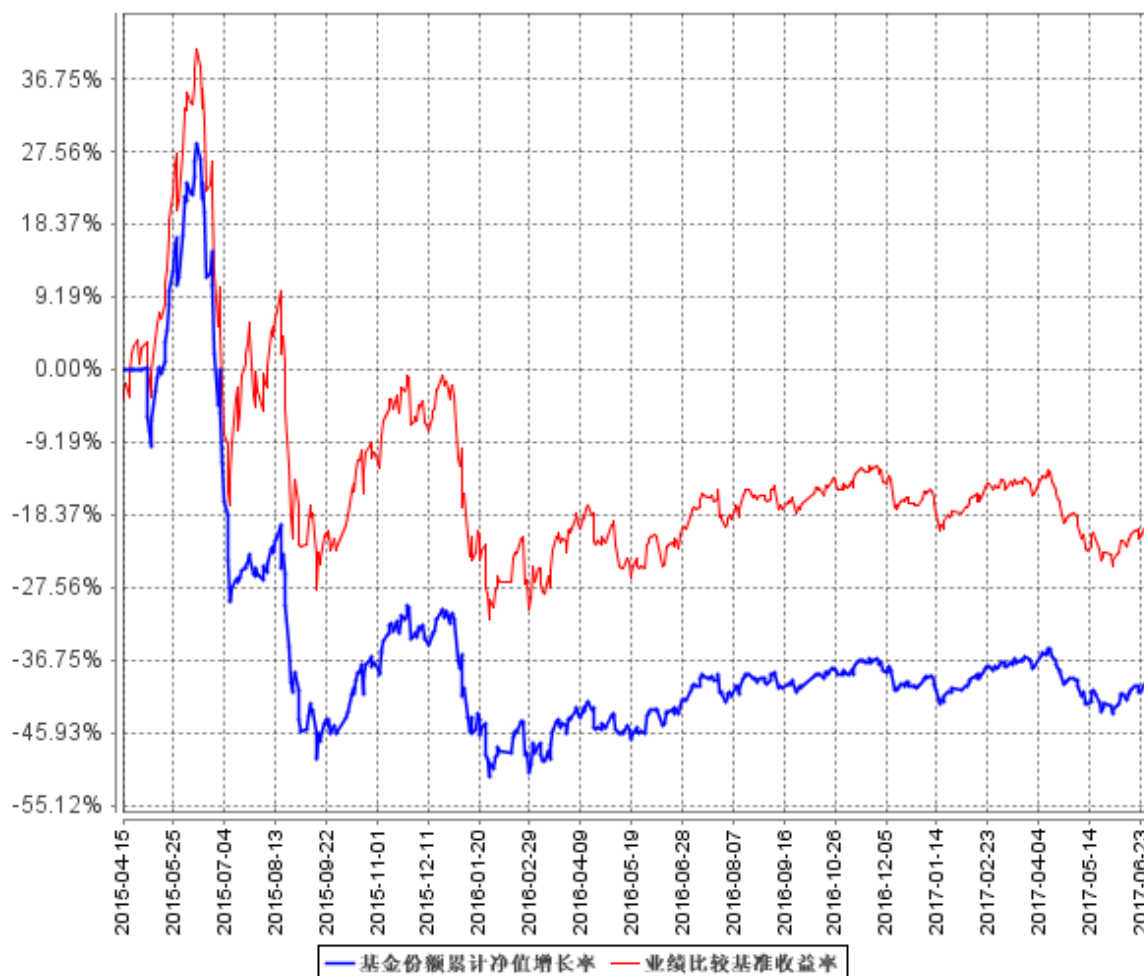
$\%benchmark(t) = 95\% * (中证 500 等权重指数收益率(t) / 中证 500 等权重指数收益率(t-1) - 1) + 5\% * 商业银行人民币活期存款利率 / 365;$

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

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。

3.3 其他指标

§ 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3.5亿元人民币，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2017年6月30日，本基金管理人共管理二十四只开放式基金。

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	-	三年	复旦大学理学硕士，曾任光大证券股份有限公司权益投资助理、上海光大证券资产管理有限公司研究员、兴证证券资产管理有限公司量化研究员。2016年10月加入本公司，有基金从业资格，中国国籍。
曹祥	本基金基金经理	2016年5月3日	-	七年	南京大学工学硕士，曾任南证期货有限公司研究员、国泰君安期货有限公司研究员。2015年8月加入本公司，现任高级研究员，具有基金从业资格，中国国籍。
付琦	本基金基金经理	2015年4月15日	2017年1月4日	十五年	加拿大渥太华大学工商管理硕士；曾任海通证券股份有限公司业务董事、招商基金管理有限公司研究部高级

					研究员。2013 年 7 月加入本公司,于 2017 年 1 月 4 日离任,具有基金从业资格,中国国籍。
--	--	--	--	--	---

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内, 本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》、本基金《基金合同》和其他相关法律法规的规定, 本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 在严格控制风险的基础上, 为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定, 无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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 2017 年上半年度，实体经济平稳运行；监管层打压炒作风气，倡导价值投资理念。A 股结构分化明显，金融股以及白马龙头领涨，无业绩支撑的中小票普跌，风格明显偏向价值。中证 500 等权重指数成分股中金融股比重极低，市值分布偏中盘，指数整体震荡下行。

在投资管理上，本基金运作严格按照基金合同的各项要求，依据被动化指数投资方法进行投资管理。本基金于 2016 年 11 月底开始参与网下打新。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。上半年超额业绩基准收益率主要来自于网下打新收益。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极低风险的收益增厚。

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 2017 年下半年，预计市场指数震荡上行。

利率中期上下均有约束；一方面较为严格的监管将常态化，金融机构整体负债增速受限，这使得利率下行空间有限；另一方面今年利率上行较快，目前已达高位，实体经济 ROE 并不支持更高的利率，若利率继续上行，监管层考虑实体经济承受能力会投鼠忌器放松监管以及供应流动性。

市场风格方面抱团的白马股筹码已稍显拥挤，预计将从价值偏向价值成长兼顾，整体风格业绩为王，市值因素将淡化。

海外资金将持续流入 A 股，逐渐提升 A 股中相比于国际而言高性价比的板块的估值。

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。

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：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	10,874,594.19	11,640,069.09
结算备付金		165,307.46	32,350.85
存出保证金		14,012.09	49,409.05
交易性金融资产	6.4.7.2	198,847,958.32	188,759,283.42
其中：股票投资		198,847,958.32	188,759,283.42
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	1,000,000.00	-
应收证券清算款		205,711.20	11,903.02
应收利息	6.4.7.5	4,921.90	5,787.26
应收股利		-	-
应收申购款		224.88	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		211,112,730.04	200,498,802.69
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 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		274,255.34	-
应付赎回款		16,960.40	-
应付管理人报酬		168,546.43	172,026.04
应付托管费		33,709.31	34,405.21
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	44,658.87	39,803.73

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	149,241.05	184,000.00
负债合计		687,371.40	430,234.98
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	347,901,841.69	334,275,651.61
未分配利润	6.4.7.10	-137,476,483.05	-134,207,083.90
所有者权益合计		210,425,358.64	200,068,567.71
负债和所有者权益总计		211,112,730.04	200,498,802.69

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9864 元，基金份额总额 213,334,851.54 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		3,671,668.08	7,793,034.56
1.利息收入		118,583.93	39,315.54
其中：存款利息收入	6.4.7.11	108,777.52	39,315.54
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		9,806.41	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		11,240,442.57	-121,410.55
其中：股票投资收益	6.4.7.12	10,100,547.49	-707,690.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
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	1,139,895.08	586,279.64
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-7,690,137.31	7,830,265.17
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	2,778.89	44,864.40

减：二、费用		1,546,057.24	564,283.01
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,017,179.70	186,882.23
2. 托管费	6.4.10.2.2	203,435.97	37,376.44
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	106,009.43	145,402.68
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	219,432.14	194,621.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,125,610.84	7,228,751.55
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,125,610.84	7,228,751.55

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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	16,171,245.52	-5,088,321.06	11,082,924.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,228,751.55	7,228,751.55
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	271,957,501.55	-122,383,084.91	149,574,416.64
其中：1.基金申购款	281,833,230.32	-126,847,704.95	154,985,525.37
2.基金赎回款	-9,875,728.77	4,464,620.04	-5,411,108.73
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	288,128,747.07	-120,242,654.42	167,886,092.65

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014] 1414 号批复核准,由西部利得基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同》和《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金招募说明书》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 202,971,734.99 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 320 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 4 月 15 日正式生效,基金合同生效日的

基金份额总额为 202,990,676.07 份基金份额，其中认购资金利息折合 18,941.08 份基金份额。本基金的基金管理人为西部利得基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

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

本财务报表由本基金的基金管理人西部利得基金管理有限公司批准于 2017 年 8 月 29 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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。

6.4.5 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。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	10,874,594.19
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	10,874,594.19

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	200,052,047.06	198,847,958.32	-1,204,088.74
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	200,052,047.06	198,847,958.32	-1,204,088.74

6.4.6.3 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。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	1,000,000.00	-

合计	1,000,000.00	-
----	--------------	---

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.6.4.2 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。

6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	5,243.39
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	74.40
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-402.19
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	6.30
合计	4,921.90

6.4.6.6 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	44,658.87
银行间市场应付交易费用	-
合计	44,658.87

6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	63.91

预提费用	99,177.14
应付指数使用费	50,000.00
合计	149,241.05

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	199,907,958.03	334,275,651.61
本期申购	15,668,824.79	17,282,531.88
本期赎回(以“-”号填列)	-2,241,931.28	-3,656,341.80
- 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	213,334,851.54	347,901,841.69

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.6.10 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	-161,972,061.14	27,764,977.24	-134,207,083.90
本期利润	9,815,748.15	-7,690,137.31	2,125,610.84
本期基金份额交易产生的变动数	-6,302,496.34	907,486.35	-5,395,009.99
其中：基金申购款	-8,026,843.74	1,235,946.04	-6,790,897.70
基金赎回款	1,724,347.40	-328,459.69	1,395,887.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-158,458,809.33	20,982,326.28	-137,476,483.05

6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
	活期存款利息收入
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	874.49
其他	2,358.84
合计	108,777.52

6.4.6.12 股票投资收益

6.4.6.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	45,935,716.74
减：卖出股票成本总额	35,835,169.25
买卖股票差价收入	10,100,547.49

6.4.6.13 债券投资收益

6.4.6.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期末未持有债券，债券投资收益为零。

6.4.6.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

6.4.6.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

6.4.6.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末未持有债券，债券投资收益为零。

6.4.6.13.5 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。

6.4.6.14 贵金属投资收益

6.4.6.14.1 贵金属投资收益项目构成

贵金属不在本基金投资范围内。

6.4.6.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

贵金属不在本基金投资范围内。

6.4.6.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

贵金属不在本基金投资范围内。

6.4.6.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

贵金属不在本基金投资范围内。

6.4.6.15 衍生工具收益**6.4.6.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内未投资衍生工具，衍生工具收益为零。

6.4.6.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	-

本基金本报告期内未投资衍生工具，衍生工具收益为零。

6.4.6.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,139,895.08
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,139,895.08

6.4.6.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-7,690,137.31
——股票投资	-7,690,137.31
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-

——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-7,690,137.31

6.4.6.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,778.89
合计	2,778.89

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。

6.4.6.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	106,009.43
银行间市场交易费用	-
合计	106,009.43

6.4.6.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,671.58
上市费用	29,752.78
银行汇划费用	255.00
指数使用费	100,000.00
合计	219,432.14

6.4.6.21 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。

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

截至 2017 年 6 月 30 日止，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

截至 2017 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。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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	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。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	47,748,858.95	50.42%	75,040,056.30	41.61%

6.4.9.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.9.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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%	-	-

6.4.9.1.4 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。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	25,076.71	48.14%	23,385.49	52.36%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
西部证券	36,839.72	33.64%	39,288.52	36.51%

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,017,179.70	186,882.23
其中:支付销售机构的客户维护费	2,743.28	2,205.18

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

6.4.9.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	203,435.97	37,376.44

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

6.4.9.2.3 销售服务费

6.4.9.3 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。

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 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。

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 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	10,874,594.19	105,544.19	9,636,750.86	31,323.79

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 2017 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 165,307.46 元。

6.4.9.6 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。

6.4.9.7 其他关联交易事项的说明

-

6.4.10 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2017 年 1 月 3 日	-	2017 年 1 月 3 日	0.2500	0.00	-	0.00	
合计	-	-	-	0.2500	-	-	-	

6.4.11 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 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
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-

002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

6.4.11.2 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
000656	金科股份	2017年5月31日	临时停牌	6.54	-	-	82,100	334,462.19	536,934.00	-
600643	爱建集团	2017年4月17日	临时停牌	14.98	-	-	31,070	297,472.35	465,428.60	-
002168	深圳	2017	临时	16.99	-	-	27,000	365,778.62	458,730.00	-

	惠程	2017 年 1 月 23 日	停牌							
600277	亿利 洁能	2017 年 3 月 6 日	临时 停牌 日	7.83	-	-	56,600	349,550.65	443,178.00	-
002399	海普 瑞	2017 年 6 月 29 日	临时 停牌 日	20.23	-	-	21,300	381,990.00	430,899.00	-
600545	新疆 城建	2017 年 6 月 22 日	临时 停牌 日	11.96	-	-	35,700	357,008.19	426,972.00	-
002025	航天 电器	2017 年 6 月 29 日	临时 停牌 日	24.95	-	-	16,940	369,345.73	422,653.00	-
002642	荣之 联	2017 年 4 月 10 日	临时 停牌 日	25.06	-	-	16,800	408,402.14	421,008.00	-
002127	南极 电商	2017 年 6 月 29 日	临时 停牌 日	12.08	-	-	33,700	436,831.00	407,096.00	-
600655	豫园 商城	2017 年 5 月 17 日	临时 停牌 日	11.32	-	-	35,000	398,933.72	396,200.00	-
601001	大同 煤业	2017 年 6 月 22 日	临时 停牌 日	5.25	-	-	75,100	400,233.24	394,275.00	-
600460	士兰 微	2017 年 5 月 22 日	临时 停牌 日	6.07	-	-	63,500	411,019.22	385,445.00	-
002128	露天 煤业	2017 年 6 月 16 日	临时 停牌 日	8.70	-	-	44,200	337,458.64	384,540.00	-
300088	长信	2017	临时	15.75	-	-	24,400	312,271.68	384,300.00	-

	科技	年 5 月 31 日	停牌							
601717	郑煤机	2017 年 4 月 24 日	临时停牌	7.79	-	-	49,200	285,382.84	383,268.00	-
002505	大康农业	2017 年 3 月 13 日	临时停牌	3.50	-	-	109,410	396,083.10	382,935.00	-
000099	中信海直	2017 年 5 月 4 日	临时停牌	11.26	-	-	33,400	419,318.40	376,084.00	-
600673	东阳光科	2016 年 11 月 15 日	临时停牌	7.29	-	-	50,500	336,654.40	368,145.00	-
002681	奋达科技	2017 年 6 月 22 日	临时停牌	12.59	-	-	28,900	429,738.44	363,851.00	-
600657	信达地产	2017 年 6 月 19 日	临时停牌	5.76	-	-	62,000	348,791.46	357,120.00	-
002013	中航机电	2017 年 5 月 16 日	临时停牌	10.33	-	-	34,312	306,610.71	354,442.96	-
300291	华录百纳	2017 年 4 月 19 日	临时停牌	20.02	-	-	17,500	396,593.12	350,350.00	-
600289	亿阳信通	2017 年 6 月 26 日	临时停牌	10.94	-	-	30,600	409,506.05	334,764.00	-
300134	大富科技	2017 年 2 月 9 日	临时停牌	23.36	-	-	13,700	374,627.00	320,032.00	-
002358	森源	2017	临时	17.02	-	-	18,500	312,058.10	314,870.00	-

	电气	年 6 月 27 日	停牌							
600468	百利电气	2017 年 6 月 15 日	临时停牌	6.50	-	-	46,800	421,476.79	304,200.00	-
002122	天马股份	2017 年 4 月 24 日	临时停牌	10.30	-	-	29,000	238,955.13	298,700.00	-
000061	农产品	-	临时停牌	9.06	-	-	21,400	191,457.00	193,884.00	-
000693	*ST 华泽	2016 年 3 月 1 日	临时停牌	12.50	-	-	1,000	18,518.72	12,500.00	-

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

于 2017 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。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

于 2017 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。

6.4.12 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。

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只股票型指数分级证券投资基金，采用指数化投资策略，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，追求对中证 500 等权重指数的有效跟踪。本基金预期风险大于货币

市场基金、债券型基金、混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额看，西部利得中证 500 等权重 A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；西部利得中证 500 等权重 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。

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

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

6.4.12.2 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 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资。

6.4.12.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资。

6.4.12.3 流动性风险

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

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

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

于 2017 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.12.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.12.4 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。

6.4.12.4.1 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。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 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	10,874,594.19	-	-	-	10,874,594.19
结算备付金	165,307.46	-	-	-	165,307.46
存出保证金	14,012.09	-	-	-	14,012.09
交易性金融资产	-	-	-	198,847,958.32	198,847,958.32
买入返售金融资产	1,000,000.00	-	-	-	1,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	205,711.20	205,711.20
应收利息	-	-	-	4,921.90	4,921.90
应收申购款	-	-	-	224.88	224.88
资产总计	12,053,913.74	-	-	199,058,816.30	211,112,730.04
负债					
应付证券清算款	-	-	-	274,255.34	274,255.34
应付赎回款	-	-	-	16,960.40	16,960.40
应付管理人报酬	-	-	-	168,546.43	168,546.43
应付托管费	-	-	-	33,709.31	33,709.31
应付交易费用	-	-	-	44,658.87	44,658.87
其他负债	-	-	-	99,177.14	99,177.14
负债总计	-	-	-	637,307.49	637,307.49
利率敏感度缺口	12,053,913.74	-	-	-198,421,508.81	210,475,422.55
上年度末 2016 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	11,640,069.09	-	-	-	11,640,069.09
结算备付金	32,350.85	-	-	-	32,350.85
存出保证金	49,409.05	-	-	-	49,409.05
交易性金融资产	-	-	-	188,759,283.42	188,759,283.42
应收证券清算款	-	-	-	11,903.02	11,903.02

应收利息	-	-	-	5,787.26	5,787.26
资产总计	11,721,828.99	-	-	-188,776,973.70	200,498,802.69
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	172,026.04	172,026.04
应付托管费	-	-	-	34,405.21	34,405.21
应付交易费用	-	-	-	39,803.73	39,803.73
其他负债	-	-	-	184,000.00	184,000.00
负债总计	-	-	-	430,234.98	430,234.98
利率敏感度缺口	11,721,828.99	-	-	-188,346,738.72	200,068,567.71

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。

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.12.4.2 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。

6.4.12.4.3 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。

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	198,847,958.32	94.50	188,759,283.42	94.35
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	198,847,958.32	94.50	188,759,283.42	94.35

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%。

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

6.4.12.4.4 采用风险价值法管理风险

(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述的层次，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：除第一层级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) 各层级金融工具公允价值

于 2017 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 198,847,958.32 元，无属于第二层级、第三层级的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层级 34,224,437.97 元，第二层级 2,861,424.91 元，无属于第三层级的余额)。

(ii) 公允价值所属层级间的重大变动 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不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或第三层级。			
(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 2017 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（2016 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。			
假设	1. 置信区间 -		
	2. 观察期 -		
分析	风险价值 (单位：人民币元)	本期末（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）

6.4.13 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 2017 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 198847958.32 元，无第二层次、第三层次的余额（2016 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为 154,994,417.20 元，属于第二层次的余额为 3,020,143.46 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 2017 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（2016 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	198,847,958.32	94.19
	其中：股票	198,847,958.32	94.19
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	1,000,000.00	0.47
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	11,039,901.65	5.23
7	其他各项资产	224,870.07	0.11
8	合计	211,112,730.04	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	2,401,675.70	1.14
B	采矿业	8,268,158.52	3.93
C	制造业	117,441,953.26	55.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,609,584.60	3.14
E	建筑业	5,034,306.50	2.39
F	批发和零售业	12,446,513.72	5.92
G	交通运输、仓储和邮政业	5,267,332.20	2.50
H	住宿和餐饮业	390,104.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,463,085.49	5.92
J	金融业	2,705,418.00	1.29
K	房地产业	11,674,947.38	5.55

L	租赁和商务服务业	4,364,965.30	2.07
M	科学研究和技术服务业	951,201.00	0.45
N	水利、环境和公共设施管理业	1,542,425.00	0.73
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	388,331.00	0.18
Q	卫生和社会工作	373,032.00	0.18
R	文化、体育和娱乐业	3,340,987.65	1.59
S	综合	1,176,539.00	0.56
	合计	196,840,560.32	93.54

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	15,212.26	0.72
C	制造业	1,623,926.28	0.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,650.22	0.01
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	327,581.24	0.16
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	26,028.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,007,398.00	0.95

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	000025	特力A	11,600	600,184.00	0.29
2	002050	三花智控	34,900	569,568.00	0.27
3	000656	金科股份	82,100	536,934.00	0.26
4	600409	三友化工	50,600	509,542.00	0.24
5	600516	方大炭素	35,700	507,654.00	0.24
6	600291	西水股份	21,800	479,600.00	0.23
7	300266	兴源环境	15,400	473,088.00	0.22
8	000050	深天马A	22,700	466,939.00	0.22
9	600643	爱建集团	31,070	465,428.60	0.22
10	600315	上海家化	14,300	464,035.00	0.22
11	002340	格林美	76,632	463,623.60	0.22
12	600338	西藏珠峰	12,200	463,478.00	0.22
13	600120	浙江东方	17,200	462,336.00	0.22
14	002325	洪涛股份	63,050	460,265.00	0.22
15	000960	锡业股份	33,700	458,657.00	0.22
16	000877	天山股份	36,200	458,654.00	0.22
17	600260	凯乐科技	18,100	458,654.00	0.22
18	600884	杉杉股份	27,800	457,866.00	0.22
19	002092	中泰化学	35,800	454,660.00	0.22
20	000786	北新建材	28,600	453,024.00	0.22
21	000830	鲁西化工	65,600	452,640.00	0.22
22	300146	汤臣倍健	32,500	446,550.00	0.21
23	603816	顾家家居	7,500	440,850.00	0.21
24	002709	天赐材料	10,700	440,519.00	0.21
25	300383	光环新网	32,300	437,988.00	0.21

26	002601	龙鳞佰利	26,500	434,070.00	0.21
27	601020	华钰矿业	19,600	431,788.00	0.21
28	000970	中科三环	30,600	452,268.00	0.21
29	600879	航天电子	51,400	451,806.00	0.21
30	600618	氯碱化工	42,149	450,151.32	0.21
31	600282	南钢股份	121,300	450,023.00	0.21
32	002405	四维图新	22,700	448,552.00	0.21
33	002640	跨境通	21,100	448,375.00	0.21
34	000581	威孚高科	17,300	448,070.00	0.21
35	601168	西部矿业	58,200	447,558.00	0.21
36	600503	华丽家族	64,700	447,077.00	0.21
37	002366	台海核电	9,500	445,645.00	0.21
38	600563	法拉电子	9,000	444,690.00	0.21
39	002460	赣锋锂业	9,600	444,000.00	0.21
40	600277	亿利洁能	56,600	443,178.00	0.21
41	002670	国盛金控	27,860	442,974.00	0.21
42	600596	新安股份	52,334	442,222.30	0.21
43	000878	云南铜业	33,500	441,865.00	0.21
44	600487	亨通光电	15,750	441,787.50	0.21
45	600251	冠农股份	55,300	440,741.00	0.21
46	300257	开山股份	20,900	440,572.00	0.21
47	000426	兴业矿业	48,800	440,176.00	0.21
48	600392	盛和资源	33,350	439,886.50	0.21
49	600848	上海临港	20,400	439,824.00	0.21
50	000997	新大陆	19,380	439,732.20	0.21
51	600801	华新水泥	46,100	439,333.00	0.21
52	002707	众信旅游	33,400	438,542.00	0.21
53	000501	鄂武商A	23,730	438,055.80	0.21
54	002271	东方雨虹	11,800	437,780.00	0.21
55	002408	齐翔腾达	39,463	437,250.04	0.21
56	002019	亿帆医药	26,200	437,016.00	0.21
57	000669	金鸿能源	24,100	436,933.00	0.21
58	600143	金发科技	72,400	436,572.00	0.21
59	000806	银河生物	32,300	436,050.00	0.21
60	600176	中国巨石	39,676	435,642.48	0.21
61	600511	国药股份	12,000	434,880.00	0.21
62	600298	安琪酵母	16,800	434,616.00	0.21
63	002030	达安基因	19,912	433,882.48	0.21
64	000661	长春高新	3,360	433,809.60	0.21

65	600809	山西汾酒	12,500	433,625.00	0.21
66	601689	拓普集团	12,900	432,021.00	0.21
67	600586	金晶科技	88,000	430,320.00	0.20
68	300116	坚瑞沃能	40,000	430,000.00	0.20
69	002332	仙琚制药	50,000	430,000.00	0.20
70	600183	生益科技	34,800	429,432.00	0.20
71	600971	恒源煤电	52,800	429,264.00	0.20
72	601678	滨化股份	61,760	429,232.00	0.20
73	600416	湘电股份	31,300	428,810.00	0.20
74	002482	广田集团	47,650	428,373.50	0.20
75	002311	海大集团	23,440	428,248.80	0.20
76	601699	潞安环能	54,700	427,754.00	0.20
77	601012	隆基股份	25,000	427,500.00	0.20
78	000488	晨鸣纸业	33,100	426,990.00	0.20
79	600545	新疆城建	35,700	426,972.00	0.20
80	002002	鸿达兴业	54,511	426,821.13	0.20
81	603868	飞科电器	6,900	426,696.00	0.20
82	600872	中炬高新	23,300	426,390.00	0.20
83	600161	天坛生物	10,980	426,133.80	0.20
84	601231	环旭电子	27,100	425,741.00	0.20
85	002354	天神娱乐	19,800	425,700.00	0.20
86	000400	许继电气	23,700	425,652.00	0.20
87	002038	双鹭药业	14,600	425,590.00	0.20
88	002056	横店东磁	56,700	425,250.00	0.20
89	000761	本钢板材	81,300	425,199.00	0.20
90	000066	中国长城	47,186	425,145.86	0.20
91	000810	创维数字	34,900	423,337.00	0.20
92	600633	浙数文化	21,900	423,108.00	0.20
93	000513	丽珠集团	6,210	422,901.00	0.20
94	000596	古井贡酒	8,300	422,885.00	0.20
95	600967	内蒙一机	31,000	422,530.00	0.20
96	600640	号百控股	25,000	422,500.00	0.20
97	000528	柳工	48,900	422,496.00	0.20
98	600300	维维股份	79,000	421,860.00	0.20
99	000703	恒逸石化	29,600	421,504.00	0.20
100	002642	荣之联	16,800	421,008.00	0.20
101	000028	国药一致	5,200	420,680.00	0.20
102	600158	中体产业	24,600	420,660.00	0.20
103	000636	风华高科	49,400	420,394.00	0.20

104	600458	时代新材	36,700	420,215.00	0.20
105	300136	信维通信	10,500	420,210.00	0.20
106	600329	中新药业	23,200	420,152.00	0.20
107	600808	马钢股份	118,600	419,844.00	0.20
108	002396	星网锐捷	21,676	419,430.60	0.20
109	603589	口子窖	10,800	418,932.00	0.20
110	600160	巨化股份	34,800	418,644.00	0.20
111	603883	老百姓	8,600	418,390.00	0.20
112	600582	天地科技	91,100	418,149.00	0.20
113	600267	海正药业	35,800	418,144.00	0.20
114	002120	韵达股份	8,100	417,960.00	0.20
115	002422	科伦药业	25,300	417,956.00	0.20
116	600259	广晟有色	10,700	417,728.00	0.20
117	600993	马应龙	19,170	417,522.60	0.20
118	603355	莱克电气	7,100	417,267.00	0.20
119	002512	达华智能	25,800	416,670.00	0.20
120	000039	中集集团	23,100	416,493.00	0.20
121	600729	重庆百货	15,500	416,020.00	0.20
122	000988	华工科技	28,500	415,815.00	0.20
123	002223	鱼跃医疗	17,555	415,702.40	0.20
124	600859	王府井	25,733	415,587.95	0.20
125	000825	太钢不锈	95,500	415,425.00	0.20
126	002018	华信国际	60,600	415,110.00	0.20
127	002179	中航光电	13,308	415,076.52	0.20
128	002242	九阳股份	21,100	415,037.00	0.20
129	000758	中色股份	59,200	414,992.00	0.20
130	002308	威创股份	31,800	414,990.00	0.20
131	603228	景旺电子	8,600	414,950.00	0.20
132	600395	盘江股份	56,600	414,878.00	0.20
133	600566	济川药业	10,900	414,527.00	0.20
134	600062	华润双鹤	15,100	414,193.00	0.20
135	000563	陕国投 A	80,100	414,117.00	0.20
136	600584	长电科技	25,800	414,090.00	0.20
137	002491	通鼎互联	30,800	413,952.00	0.20
138	002078	太阳纸业	56,300	413,805.00	0.20
139	300156	神雾环保	12,600	412,776.00	0.20
140	000999	华润三九	13,000	412,750.00	0.20
141	600056	中国医药	15,900	412,605.00	0.20
142	600073	上海梅林	43,200	412,560.00	0.20

143	000762	西藏矿业	29,100	412,347.00	0.20
144	002416	爱施德	38,200	412,178.00	0.20
145	600270	外运发展	21,760	411,916.80	0.20
146	002479	富春环保	34,600	411,740.00	0.20
147	002410	广联达	21,900	411,720.00	0.20
148	600557	康缘药业	24,780	411,595.80	0.20
149	002001	新和成	21,200	411,492.00	0.20
150	002437	誉衡药业	56,500	411,320.00	0.20
151	600755	厦门国贸	45,100	411,312.00	0.20
152	002428	云南锗业	38,500	411,180.00	0.20
153	002635	安洁科技	11,350	411,097.00	0.20
154	600348	阳泉煤业	60,600	410,868.00	0.20
155	600699	均胜电子	12,800	410,752.00	0.20
156	002041	登海种业	31,000	410,750.00	0.20
157	600138	中青旅	19,500	410,670.00	0.20
158	600098	广州发展	51,900	410,529.00	0.20
159	000860	顺鑫农业	20,500	410,205.00	0.19
160	000519	中兵红箭	32,555	410,193.00	0.19
161	002190	成飞集成	15,300	410,040.00	0.19
162	600169	太原重工	106,200	409,932.00	0.19
163	000592	平潭发展	74,200	409,584.00	0.19
164	600380	健康元	45,100	409,508.00	0.19
165	002254	泰和新材	30,780	409,374.00	0.19
166	600597	光明乳业	32,100	409,275.00	0.19
167	000712	锦龙股份	25,000	409,250.00	0.19
168	603025	大豪科技	15,500	409,200.00	0.19
169	600500	中化国际	42,800	409,168.00	0.19
170	002345	潮宏基	37,600	408,712.00	0.19
171	002276	万马股份	40,500	408,645.00	0.19
172	002603	以岭药业	23,400	408,564.00	0.19
173	000829	天音控股	37,800	408,240.00	0.19
174	002517	恺英网络	11,600	408,204.00	0.19
175	600628	新世界	35,300	407,715.00	0.19
176	000158	常山股份	25,800	407,640.00	0.19
177	002440	闰土股份	26,700	407,442.00	0.19
178	600648	外高桥	22,000	407,440.00	0.19
179	002048	宁波华翔	19,528	407,354.08	0.19
180	600466	蓝光发展	47,200	407,336.00	0.19
181	600664	哈药股份	70,070	407,106.70	0.19

182	002127	南极电商	33,700	407,096.00	0.19
183	002281	光迅科技	18,321	407,092.62	0.19
184	300244	迪安诊断	12,940	407,092.40	0.19
185	600831	广电网络	40,900	406,955.00	0.19
186	002005	德豪润达	85,300	406,881.00	0.19
187	300166	东方国信	30,279	406,646.97	0.19
188	000547	航天发展	38,900	406,505.00	0.19
189	002815	崇达技术	12,300	406,392.00	0.19
190	600880	博瑞传播	62,200	406,166.00	0.19
191	002250	联化科技	28,400	406,120.00	0.19
192	000969	安泰科技	46,500	405,945.00	0.19
193	002572	索菲亚	9,900	405,900.00	0.19
194	603698	航天工程	16,100	405,720.00	0.19
195	600219	南山铝业	119,650	405,613.50	0.19
196	600201	生物股份	11,400	405,498.00	0.19
197	002463	沪电股份	89,100	405,405.00	0.19
198	600587	新华医疗	22,800	405,384.00	0.19
199	600184	光电股份	21,600	405,216.00	0.19
200	600773	西藏城投	36,600	405,162.00	0.19
201	002414	高德红外	22,110	404,613.00	0.19
202	600316	洪都航空	25,170	404,481.90	0.19
203	600280	中央商场	51,000	404,430.00	0.19
204	000930	中粮生化	37,500	404,250.00	0.19
205	600388	龙净环保	26,000	403,780.00	0.19
206	600026	中远海能	60,900	403,767.00	0.19
207	002221	东华能源	37,000	403,670.00	0.19
208	002073	软控股份	47,600	403,648.00	0.19
209	601311	骆驼股份	28,500	403,560.00	0.19
210	600198	大唐电信	31,600	403,532.00	0.19
211	002807	江阴银行	32,200	403,466.00	0.19
212	600195	中牧股份	20,800	403,312.00	0.19
213	002503	搜于特	57,360	403,240.80	0.19
214	600125	铁龙物流	45,000	403,200.00	0.19
215	600651	飞乐音响	47,600	403,172.00	0.19
216	600874	创业环保	20,600	403,142.00	0.19
217	002818	富森美	10,200	402,594.00	0.19
218	002064	华峰氨纶	83,600	402,952.00	0.19
219	600171	上海贝岭	39,610	402,833.70	0.19
220	600312	平高电气	29,300	402,582.00	0.19

221	002285	世联行	50,180	402,443.60	0.19
222	600428	中远海特	64,700	402,434.00	0.19
223	002317	众生药业	32,400	402,408.00	0.19
224	002588	史丹利	52,300	402,187.00	0.19
225	002093	国脉科技	45,700	402,160.00	0.19
226	603198	迎驾贡酒	21,100	401,533.00	0.19
227	300253	卫宁健康	51,410	401,512.10	0.19
228	002468	申通快递	15,800	401,478.00	0.19
229	000680	山推股份	73,652	401,403.40	0.19
230	000517	荣安地产	86,300	401,295.00	0.19
231	600757	长江传媒	53,700	401,139.00	0.19
232	603188	亚邦股份	23,000	401,120.00	0.19
233	002155	湖南黄金	41,900	400,983.00	0.19
234	000552	靖远煤电	112,300	400,911.00	0.19
235	603658	安图生物	9,300	400,830.00	0.19
236	603877	太平鸟	14,300	400,257.00	0.19
237	600499	科达洁能	50,400	400,176.00	0.19
238	600600	青岛啤酒	11,400	400,140.00	0.19
239	600006	东风汽车	68,400	400,140.00	0.19
240	600307	酒钢宏兴	140,400	400,140.00	0.19
241	601880	大连港	135,020	399,659.20	0.19
242	601002	晋亿实业	46,200	399,630.00	0.19
243	002118	紫鑫药业	58,500	399,555.00	0.19
244	600835	上海机电	18,900	399,546.00	0.19
245	600216	浙江医药	40,300	399,373.00	0.19
246	600126	杭钢股份	58,200	399,252.00	0.19
247	002233	塔牌集团	32,800	399,176.00	0.19
248	300026	红日药业	84,700	398,937.00	0.19
249	002444	巨星科技	25,600	398,848.00	0.19
250	600059	古越龙山	43,100	398,675.00	0.19
251	000998	隆平高科	18,100	398,562.00	0.19
252	300296	利亚德	21,200	398,560.00	0.19
253	600053	九鼎投资	11,400	398,544.00	0.19
254	600536	中国软件	20,800	398,528.00	0.19
255	002176	江特电机	45,702	398,521.44	0.19
256	600058	五矿发展	32,100	398,361.00	0.19
257	600754	锦江股份	14,700	398,370.00	0.19
258	000543	皖能电力	68,310	398,247.30	0.19
259	600551	时代出版	25,200	397,908.00	0.19

260	600017	日照港	88,400	397,800.00	0.19
261	000612	焦作万方	49,400	397,670.00	0.19
262	000012	南玻A	42,600	397,458.00	0.19
263	600642	申能股份	63,100	397,530.00	0.19
264	000006	深振业A	45,100	397,331.00	0.19
265	603515	欧普照明	11,000	397,320.00	0.19
266	600039	四川路桥	95,500	397,280.00	0.19
267	600720	祁连山	50,700	396,981.00	0.19
268	600366	宁波韵升	22,500	396,900.00	0.19
269	000536	华映科技	68,300	396,823.00	0.19
270	600418	江淮汽车	37,600	396,680.00	0.19
271	603444	吉比特	1,400	396,662.00	0.19
272	600079	人福医药	20,200	396,324.00	0.19
273	600655	豫园商城	35,000	396,200.00	0.19
274	002249	大洋电机	60,200	396,116.00	0.19
275	300115	长盈精密	13,560	395,680.80	0.19
276	600687	刚泰控股	30,700	395,416.00	0.19
277	002277	友阿股份	61,300	395,385.00	0.19
278	600736	苏州高新	55,900	395,213.00	0.19
279	600435	北方导航	27,600	394,956.00	0.19
280	300147	香雪制药	38,440	394,778.80	0.19
281	603377	东方时尚	10,500	394,695.00	0.19
282	600611	大众交通	71,500	394,680.00	0.19
283	002646	青青稞酒	22,600	394,596.00	0.19
284	603568	伟明环保	18,250	394,565.00	0.19
285	600521	华海药业	18,750	394,500.00	0.19
286	600528	中铁工业	27,600	394,404.00	0.19
287	001696	宗申动力	52,100	394,397.00	0.19
288	000417	合肥百货	47,800	394,350.00	0.19
289	600748	上实发展	54,770	394,344.00	0.19
290	002439	启明星辰	21,200	394,320.00	0.19
291	601001	大同煤业	75,100	394,275.00	0.19
292	002657	中科金财	13,600	394,264.00	0.19
293	603766	隆鑫通用	54,150	394,212.00	0.19
294	600765	中航重机	28,600	394,108.00	0.19
295	002273	水晶光电	19,100	394,033.00	0.19
296	600410	华胜天成	44,460	393,915.60	0.19
297	000939	凯迪生态	77,200	393,720.00	0.19
298	002573	清新环境	20,900	393,338.00	0.19

299	600811	东方集团	60,300	393,156.00	0.19
300	000685	中山公用	35,860	392,667.00	0.19
301	600572	康恩贝	56,700	392,364.00	0.19
302	600422	昆药集团	34,590	392,250.60	0.19
303	002544	杰赛科技	17,200	392,160.00	0.19
304	300032	金龙机电	28,100	391,995.00	0.19
305	002315	焦点科技	15,700	391,558.00	0.19
306	000598	兴蓉环境	69,600	391,152.00	0.19
307	601928	凤凰传媒	40,000	390,400.00	0.19
308	000021	深科技	45,500	390,390.00	0.19
309	000587	金洲慈航	26,200	390,380.00	0.19
310	002373	千方科技	28,600	390,104.00	0.19
311	300113	顺网科技	14,500	390,050.00	0.19
312	002266	浙富控股	79,920	390,009.60	0.19
313	300043	星辉娱乐	47,500	389,975.00	0.19
314	000089	深圳机场	41,700	389,895.00	0.19
315	600805	悦达投资	53,000	389,550.00	0.19
316	600862	中航高科	40,200	389,538.00	0.19
317	600200	江苏吴中	29,500	389,400.00	0.19
318	000979	中弘股份	148,620	389,384.40	0.19
319	000031	中粮地产	51,700	389,301.00	0.19
320	600525	长园集团	28,640	389,217.60	0.18
321	600750	江中药业	11,200	389,200.00	0.18
322	002106	莱宝高科	38,400	388,992.00	0.18
323	600936	广西广电	48,200	388,974.00	0.18
324	300001	特锐德	23,200	388,832.00	0.18
325	603567	珍宝岛	23,100	388,773.00	0.18
326	000078	海王生物	64,450	388,633.50	0.18
327	600565	迪马股份	70,500	388,455.00	0.18
328	000816	智慧农业	52,200	388,368.00	0.18
329	000027	深圳能源	57,704	388,347.92	0.18
330	600108	亚盛集团	90,100	388,331.00	0.18
331	600614	鹏起科技	35,300	388,300.00	0.18
332	600266	北京城建	26,700	388,218.00	0.18
333	600881	亚泰集团	76,400	388,112.00	0.18
334	600284	浦东建设	36,200	388,064.00	0.18
335	600978	宜华生活	38,600	387,930.00	0.18
336	000090	天健集团	34,940	387,834.00	0.18
337	002063	远光软件	37,218	387,811.56	0.18

338	600639	浦东金桥	21,400	387,768.00	0.18
339	600770	综艺股份	51,700	387,750.00	0.18
340	000975	银泰资源	30,700	387,741.00	0.18
341	002191	劲嘉股份	41,400	387,504.00	0.18
342	002371	北方华创	16,200	387,504.00	0.18
343	002004	华邦健康	49,450	387,193.50	0.18
344	000732	泰禾集团	23,200	386,976.00	0.18
345	000418	小天鹅 A	8,270	386,953.30	0.18
346	002194	武汉凡谷	43,700	386,745.00	0.18
347	601233	桐昆股份	27,900	386,694.00	0.18
348	002309	中利集团	30,900	386,559.00	0.18
349	002368	太极股份	13,950	386,275.50	0.18
350	600594	益佰制药	25,300	386,078.00	0.18
351	300122	智飞生物	20,200	386,022.00	0.18
352	600694	大商股份	9,905	385,997.85	0.18
353	000566	海南海药	29,100	385,866.00	0.18
354	600645	中源协和	18,000	385,740.00	0.18
355	600460	士兰微	63,500	385,445.00	0.18
356	002244	滨江集团	55,700	385,444.00	0.18
357	000926	福星股份	31,576	385,227.20	0.18
358	000572	海马汽车	74,500	385,165.00	0.18
359	600240	华业资本	42,500	385,050.00	0.18
360	300199	翰宇药业	25,100	385,034.00	0.18
361	002375	亚厦股份	43,200	384,912.00	0.18
362	600580	卧龙电气	56,400	384,648.00	0.18
363	002128	露天煤业	44,200	384,540.00	0.18
364	600166	福田汽车	135,400	384,536.00	0.18
365	002344	海宁皮城	46,200	384,384.00	0.18
366	300088	长信科技	24,400	384,300.00	0.18
367	600064	南京高科	25,450	384,295.00	0.18
368	603866	桃李面包	10,800	384,264.00	0.18
369	300039	上海凯宝	52,840	384,146.80	0.18
370	600635	大众公用	70,450	383,952.50	0.18
371	600917	重庆燃气	40,700	383,801.00	0.18
372	600826	兰生股份	21,200	383,720.00	0.18
373	601777	力帆股份	47,700	383,508.00	0.18
374	601717	郑煤机	49,200	383,268.00	0.18
375	300324	旋极信息	21,000	383,040.00	0.18
376	601929	吉视传媒	110,700	383,022.00	0.18

377	002505	大康农业	109,410	382,935.00	0.18
378	002261	拓维信息	32,700	382,917.00	0.18
379	002384	东山精密	15,500	382,850.00	0.18
380	600863	内蒙华电	126,900	381,969.00	0.18
381	600776	东方通信	56,300	381,714.00	0.18
382	002489	浙江永强	59,760	381,268.80	0.18
383	603569	长久物流	11,400	381,102.00	0.18
384	600790	轻纺城	55,950	381,019.50	0.18
385	603806	福斯特	11,900	380,919.00	0.18
386	603888	新华网	11,750	380,582.50	0.18
387	002551	尚荣医疗	23,572	380,216.36	0.18
388	600751	天海投资	66,800	380,092.00	0.18
389	002690	美亚光电	19,800	379,764.00	0.18
390	002589	瑞康医药	24,652	379,640.80	0.18
391	600122	宏图高科	34,200	379,620.00	0.18
392	603001	奥康国际	20,200	379,558.00	0.18
393	300002	神州泰岳	45,500	379,470.00	0.18
394	000777	中核科技	19,000	379,240.00	0.18
395	002477	雏鹰农牧	85,600	379,208.00	0.18
396	000848	承德露露	37,975	378,990.50	0.18
397	002269	美邦服饰	101,600	378,968.00	0.18
398	600894	广日股份	32,000	378,880.00	0.18
399	002251	步步高	30,544	378,440.16	0.18
400	300202	聚龙股份	22,900	378,308.00	0.18
401	000600	建投能源	30,800	377,916.00	0.18
402	002701	奥瑞金	59,120	377,776.80	0.18
403	600743	华远地产	89,500	377,690.00	0.18
404	600094	大名城	49,200	377,364.00	0.18
405	000697	炼石有色	18,400	376,648.00	0.18
406	601811	新华文轩	24,200	376,552.00	0.18
407	601000	唐山港	72,100	376,362.00	0.18
408	000099	中信海直	33,400	376,084.00	0.18
409	600996	贵广网络	31,400	375,858.00	0.18
410	300058	蓝色光标	48,000	375,360.00	0.18
411	002022	科华生物	21,607	375,313.59	0.18
412	000778	新兴铸管	56,000	375,200.00	0.18
413	002353	杰瑞股份	23,700	374,934.00	0.18
414	600759	洲际油气	61,840	374,750.40	0.18
415	600187	国中水务	74,100	374,205.00	0.18

416	000726	鲁 泰 A	31,500	373,590.00	0.18
417	600717	天津港	29,900	373,451.00	0.18
418	000049	德赛电池	7,200	373,032.00	0.18
419	002672	东江环保	22,000	371,580.00	0.18
420	000681	视觉中国	23,700	371,142.00	0.18
421	600970	中材国际	42,650	370,628.50	0.18
422	000652	泰达股份	69,900	370,470.00	0.18
423	002123	梦网荣信	33,300	369,963.00	0.18
424	603000	人民网	28,000	368,760.00	0.18
425	000616	海航投资	85,700	368,510.00	0.18
426	600673	东阳光科	50,500	368,145.00	0.17
427	300055	万邦达	20,000	368,000.00	0.17
428	600496	精工钢构	76,040	367,273.20	0.17
429	000401	冀东水泥	23,800	366,282.00	0.17
430	300287	飞利信	39,900	366,282.00	0.17
431	603019	中科曙光	13,000	365,820.00	0.17
432	002028	思源电气	22,900	365,026.00	0.17
433	002727	一心堂	19,800	364,320.00	0.17
434	600517	置信电气	48,100	364,117.00	0.17
435	603005	晶方科技	13,000	363,870.00	0.17
436	002681	奋达科技	28,900	363,851.00	0.17
437	600481	双良节能	68,440	363,416.40	0.17
438	000897	津滨发展	77,200	362,840.00	0.17
439	600537	亿晶光电	72,822	362,653.56	0.17
440	600478	科力远	42,120	362,653.20	0.17
441	600086	东方金钰	33,400	361,054.00	0.17
442	000541	佛山照明	39,570	360,482.70	0.17
443	000766	通化金马	22,500	359,550.00	0.17
444	000667	美好置业	108,400	358,804.00	0.17
445	601016	节能风电	97,400	358,432.00	0.17
446	000727	华东科技	126,400	357,712.00	0.17
447	600657	信达地产	62,000	357,120.00	0.17
448	002431	棕榈股份	32,350	356,497.00	0.17
449	600292	远达环保	33,010	355,847.80	0.17
450	603556	海兴电力	8,100	355,509.00	0.17
451	000062	深圳华强	13,400	355,502.00	0.17
452	002013	中航机电	34,312	354,442.96	0.17
453	002665	首航节能	48,990	352,728.00	0.17
454	300273	和佳股份	28,980	352,396.80	0.17

455	600787	中储股份	44,300	350,413.00	0.17
456	300291	华录百纳	17,500	350,350.00	0.17
457	002663	普邦股份	64,426	349,833.18	0.17
458	300159	新研股份	26,100	345,564.00	0.16
459	601886	江河集团	33,400	342,350.00	0.16
460	002390	信邦制药	38,900	338,819.00	0.16
461	002011	盾安环境	29,800	338,230.00	0.16
462	600426	华鲁恒升	28,786	337,947.64	0.16
463	600335	国机汽车	28,150	336,674.00	0.16
464	600289	亿阳信通	30,600	334,764.00	0.16
465	603169	兰石重装	27,400	332,910.00	0.16
466	000620	新华联	46,800	332,748.00	0.16
467	600151	航天机电	40,300	331,669.00	0.16
468	002392	北京利尔	55,800	330,894.00	0.16
469	300376	易事特	36,400	330,148.00	0.16
470	002342	巨力索具	32,600	328,282.00	0.16
471	300274	阳光电源	29,460	326,711.40	0.16
472	002051	中工国际	15,648	324,383.04	0.15
473	600220	江苏阳光	94,000	322,420.00	0.15
474	002407	多氟多	14,600	321,054.00	0.15
475	300134	大富科技	13,700	320,032.00	0.15
476	002217	合力泰	32,200	318,136.00	0.15
477	002358	森源电气	18,500	314,870.00	0.15
478	002400	省广股份	38,467	308,890.01	0.15
479	603369	今世缘	23,400	308,880.00	0.15
480	000937	冀中能源	50,100	306,612.00	0.15
481	600141	兴发集团	24,600	304,302.00	0.14
482	600022	山东钢铁	146,280	301,336.80	0.14
483	002122	天马股份	29,000	298,700.00	0.14
484	000690	宝新能源	49,700	297,206.00	0.14
485	300010	立思辰	22,500	291,375.00	0.14
486	600869	智慧能源	42,900	288,717.00	0.14
487	000729	燕京啤酒	41,300	277,536.00	0.13
488	603328	依顿电子	19,600	277,340.00	0.13
489	002268	卫士通	14,040	236,152.80	0.11
490	002699	美盛文化	15,420	212,796.00	0.10
491	600325	华发股份	24,280	202,738.00	0.10
492	002147	新光圆成	12,500	194,250.00	0.09
493	000061	农产品	21,400	193,884.00	0.09

494	002583	海能达	9,000	144,810.00	0.07
495	600839	四川长虹	38,400	139,008.00	0.07
496	603528	多伦科技	9,100	130,767.00	0.06

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	002168	深圳惠程	27,000	458,730.00	0.22
2	002399	海普瑞	21,300	430,899.00	0.21
3	600468	百利电气	46,800	304,200.00	0.14
4	300676	华大基因	1,847	48,280.58	0.02
5	603387	基蛋生物	1,190	46,124.40	0.02
6	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.02
7	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.02
8	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.02
9	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
10	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
11	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
12	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
13	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
14	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
15	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
16	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.01
17	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01
18	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
19	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.01
20	000693	*ST 华泽	1,000	12,500.00	0.01
21	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.01
22	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
23	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
24	603617	君禾股份	832	7,429.76	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	818,149.60	0.41
2	000547	航天发展	571,406.00	0.29
3	002670	国盛金控	461,032.00	0.23
4	002127	南极电商	436,831.00	0.22
5	600848	上海临港	434,977.00	0.22
6	600648	外高桥	405,361.00	0.20
7	002601	龙蟠佰利	402,999.00	0.20
8	600582	天地科技	402,286.00	0.20
9	002709	天赐材料	402,151.00	0.20
10	600566	济川药业	401,360.00	0.20
11	603888	新华网	399,456.00	0.20
12	603569	长久物流	397,948.00	0.20
13	600936	广西广电	397,138.00	0.20
14	300383	光环新网	396,989.00	0.20
15	603444	吉比特	395,734.00	0.20
16	000536	华映科技	395,568.00	0.20
17	601020	华钰矿业	394,929.00	0.20
18	603816	顾家家居	393,836.00	0.20
19	002517	恺英网络	393,159.56	0.20
20	002807	江阴银行	392,871.00	0.20

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	002508	老板电器	656,889.06	0.33
2	600874	创业环保	532,090.00	0.27
3	600436	片仔癀	510,690.50	0.26
4	600682	南京新百	473,382.00	0.24

5	002595	豪迈科技	456,194.68	0.23
6	000959	首钢股份	448,427.00	0.22
7	000066	中国长城	441,571.00	0.22
8	600522	中天科技	435,201.00	0.22
9	601881	中国银河	420,238.70	0.21
10	601212	白银有色	408,699.76	0.20
11	000973	佛塑科技	404,526.00	0.20
12	000887	中鼎股份	396,400.00	0.20
13	002327	富安娜	392,121.30	0.20
14	002029	七匹狼	391,403.00	0.20
15	600483	福能股份	386,817.80	0.19
16	000869	张裕A	384,421.31	0.19
17	600823	世茂股份	378,368.72	0.19
18	600180	瑞茂通	372,252.00	0.19
19	600067	冠城大通	371,168.00	0.19
20	002581	未名医药	356,595.00	0.18

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	53,652,134.10
卖出股票收入（成交）总额	45,935,716.74

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

本基金投资的前十大证券中，除凯乐科技（600260.SH）因披露涉嫌违反《上市公司信息披露管理办法》于 2016 年 12 月 28 日收到中国证券监督管理委员会湖北监管局出具警示函外，其余证券发行主体本期没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	14,012.09
2	应收证券清算款	205,711.20
3	应收股利	-
4	应收利息	4,921.90
5	应收申购款	224.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	224,870.07

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	000656	金科股份	536,934.00	0.26	临时停牌
2	600643	爱建集团	465,428.60	0.22	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	130	11,729.51	6,300.00	0.41%	1,518,536.00	99.59%
西部利得中证 500 等权重指数分级 B	571	2,670.47	8,227.00	0.54%	1,516,609.00	99.46%
西部利得中证 500 等权重指数分级	533	394,531.29	207,212,840.32	98.54%	3,072,339.22	1.46%
合计	1,234	172,880.75	207,227,367.32	97.14%	6,107,484.22	2.86%

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
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	西部利得中证 500 等权重指数分级 A	西部利得中证 500 等权重指数分级 B	西部利得中证 500 等权重指数分级
基金合同生效日（2015 年 4 月 15 日） 基金份额总额	-	-	202,990,676.07
本报告期期初基金份额总额	2,107,986.00	2,107,986.00	195,691,986.03
本报告期基金总申购份额	-	-	10,594,156.70
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	2,241,931.28
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-583,150.00	-583,150.00	6,240,968.09
本报告期期末基金份额总额	1,524,836.00	1,524,836.00	210,285,179.54

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。

本报告期内，经公司第一届董事会第三十次会议决议，自 2017 年 1 月 9 日起由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）正式改聘为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。详细信息可参见本基金管理人于 2017 年 1 月 10 日披露的《关于旗下基金改聘会计师事务所公告》。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
西部证券	2	47,748,858.95	50.42%	25,369.41	48.70%	-
海通证券	1	16,225,530.09	17.13%	8,620.91	16.55%	-
东吴证券	2	11,557,783.32	12.20%	6,141.08	11.79%	-
光大证券	2	7,162,293.15	7.56%	5,667.65	10.88%	-
华创证券	2	6,778,047.28	7.16%	2,245.46	4.31%	-
中信建投	1	2,160,467.82	2.28%	2,012.08	3.86%	-
广发证券	1	1,718,538.94	1.81%	1,256.82	2.41%	-
华金证券	2	807,852.22	0.85%	348.46	0.67%	-
中泰证券	2	330,081.94	0.35%	274.45	0.53%	-
平安证券	2	217,279.84	0.23%	158.90	0.31%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	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	成交金额	占当期权证成交总额的比例

				的比例		
西部证券	-	-	4,500,000.00	10.23%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	32,500,000.00	73.86%	-	-
华创证券	-	-	7,000,000.00	15.91%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

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旗下基金改聘会计师事务所公告	《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、《上海证券报》、本基金管理人网站	2017年1月10日
2	西部利得基金管理有限公司关于等比例增加注册资本及修改公司章程事项的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、《上海证券报》、本基金管理人网站	2017年1月25日
3	西部利得基金管理有限公司关于正式设立北京分公司的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、《上海证券报》、本基金管理人网站	2017年3月28日

§ 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	192,233,005.50	4,879,834.82	-	197,112,840.32	92.40%
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

2017 年 8 月 29 日