

# 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 摘要

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

### 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	西部利得中证 500 等权重指数分级		
场内简称	500 等权		
基金主代码	502000		
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。

	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金管理人主要按照中证 500 等权重指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金投资于中证 500 等权重指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%；现金以及到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。基金管理人将综合考虑股票市场情况、基金资产的流动性要求等因素确定各类资产的具体配置比例。在巨额申购赎回发生、成份股大比例分红等情况下，管理人将在综合考虑冲击成本因素和跟踪效果后，及时将股票配置比例调整至合理水平。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）股票组合构建原则</p> <p>本基金通过复制指数的方法，根据中证 500 等权重指数成份股组成及其基准权重构建股票投资组合。当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证 500 等权重指数的效果可能带来影响时，基金管理人将根据市场情况，采取合理措施控制基金的跟踪误差。</p> <p>在特殊情况下，本基金将选择其他股票或股票组合对标的指数中的股票加以适当替换，这些情况包括但不限于以下情形：</p> <ol style="list-style-type: none"> <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	$95\% \times \text{中证 500 等权重指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行人民币活期存款利率 (税后)}$

风险收益特征	-		
下属三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

## 2.4 信息披露方式

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

## § 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

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%
自基金合同生效起至今	-39.48%	1.99%	-19.78%	2.18%	-19.70%	-0.19%

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：

$benchmark(0) = 1000;$

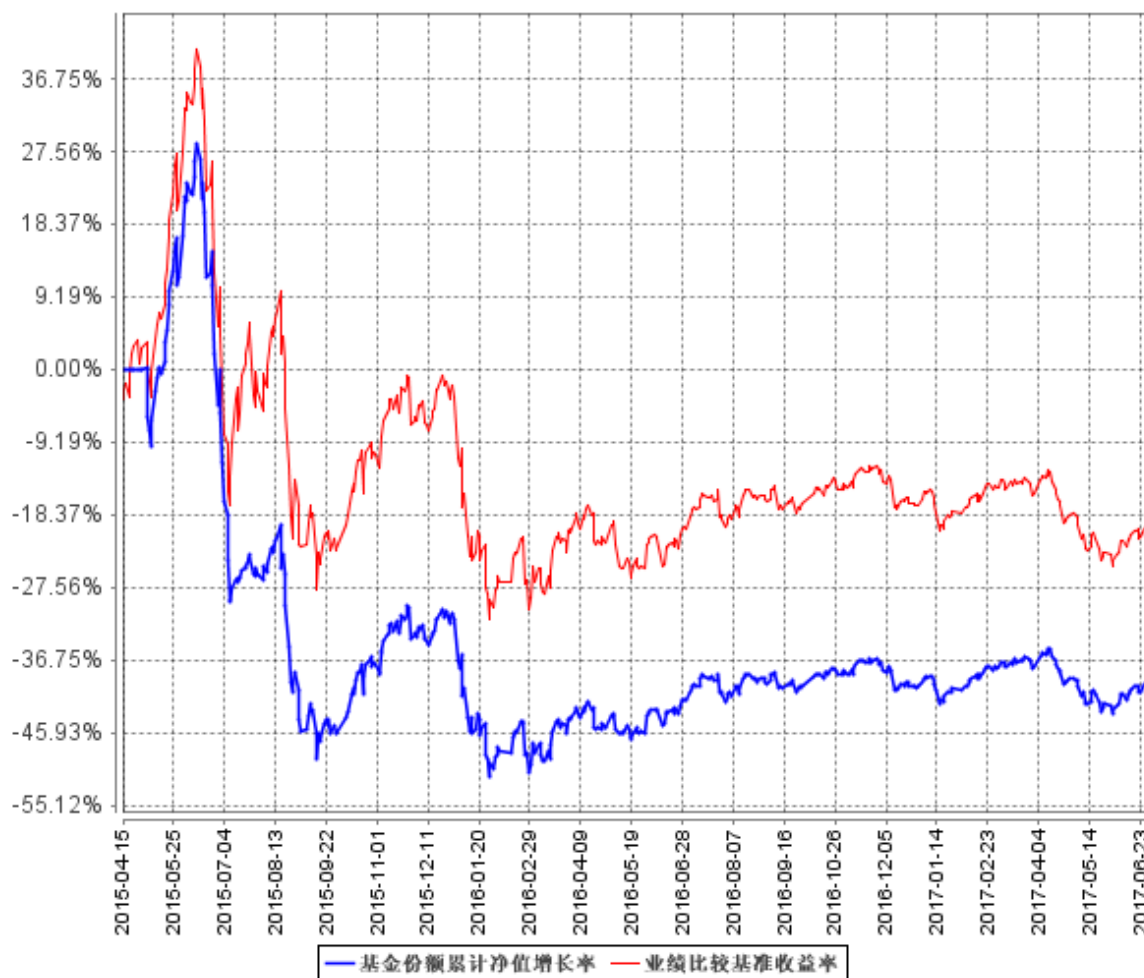
$\%benchmark(t) = 95\% * ( \text{中证 500 等权重指数收益率}(t) / \text{中证 500 等权重指数收益率}(t-1) - 1) + 5\% * \text{商业银行人民币活期存款利率} / 365;$

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

其中  $t=1, 2, 3, \dots$ 。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为 2015 年 4 月 15 日至 2015 年 10 月 14 日，至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

西部利得基金管理有限公司（简称“西部利得基金”，下同）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2010]864号）批准成立于 2010 年 7 月 20 日，公司由西部证券股份有限公司和上海利得财富资产管理有限公司合资设立，注册资本 3.5 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遵规守信情况的说明

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
<b>资产：</b>			
银行存款		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		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		-	-
买入返售金融资产		1,000,000.00	-
应收证券清算款		205,711.20	11,903.02
应收利息		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		-	-
资产总计		211,112,730.04	200,498,802.69
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 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		-	-
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		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		149,241.05	184,000.00
负债合计		687,371.40	430,234.98
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		347,901,841.69	334,275,651.61
未分配利润		-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
<b>一、收入</b>		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		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		10,100,547.49	-707,690.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		1,139,895.08	586,279.64
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-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）		2,778.89	44,864.40

<b>减：二、费用</b>		1,546,057.24	564,283.01
1. 管理人报酬		1,017,179.70	186,882.23
2. 托管费		203,435.97	37,376.44
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		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		219,432.14	194,621.66
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		2,125,610.84	7,228,751.55
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		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（本期净利润）	-	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(本期净利润)	-	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： $95\% \times \text{中证 500 等权重指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行人民币活期存款利率（税后）}$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人西部利得基金管理有限公司批准于 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 关联方关系

### 6.4.6.1 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。

### 6.4.6.2 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。

## 6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.7.1.1 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%

#### 6.4.7.1.2 债券交易

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	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.7.1.3 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%	-	-

#### 6.4.7.1.4 权证交易

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	占当期权证 成交总额的 比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.7.1.5 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%

## 6.4.7.2 关联方报酬

### 6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	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
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

### 6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
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

### 6.4.7.2.3 销售服务费

## 6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2017年1月1日至2017年6月30日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
上年度可比期间						

2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

本基金本报告期末未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	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）持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	-	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-
期末持有的基金份额	-	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-

项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	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）持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	-	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-
期末持有的基金份额	-	-	-

期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-	-
-----------------------	---	---	---

本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 6.4.7.4.2 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

份额单位：份

西部利得中证 500 等权重指数分级 A				
关联方名称	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例

西部利得中证 500 等权重指数分级 B				
关联方名称	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例

西部利得中证 500 等权重指数分级				
关联方名称	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例

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。

#### 6.4.7.5 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 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	
	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。

#### 6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量 (单位: 份)	总金额
上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量 (单位: 份)	总金额

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。

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

##### 6.4.8.1 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

6.4.10.1.1 受限证券类别: 股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位: 股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
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	-

6.4.10.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注

6.4.10.1.3 受限证券类别：权证										
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：份)	期末成本总额	期末估值总额	备注

### 6.4.8.2 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	深圳惠程	2017年1月23日	临时停牌	16.99	-	-	27,000	365,778.62	458,730.00	-
600277	亿利洁能	2017年3月6日	临时停牌	7.83	-	-	56,600	349,550.65	443,178.00	-
002399	海普瑞	2017年6月29日	临时停牌	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	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	24.95	-	-	16,940	369,345.73	422,653.00	-
002642	荣之联	2017年4月10日	临时停牌	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	12.08	-	-	33,700	436,831.00	407,096.00	-
600655	豫园	2017年	临时	11.32	-	-	35,000	398,933.72	396,200.00	-

	商城	5月17日	停牌								
601001	大同煤业	2017年6月22日	临时停牌	5.25	-	-	75,100	400,233.24	394,275.00	-	
600460	士兰微	2017年5月22日	临时停牌	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	8.70	-	-	44,200	337,458.64	384,540.00	-	
300088	长信科技	2017年5月31日	临时停牌	15.75	-	-	24,400	312,271.68	384,300.00	-	
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	森源电气	2017 年 6 月 27 日	临时停牌	17.02	-	-	18,500	312,058.10	314,870.00	-
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	-

### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

-

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
合计				-	-

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。

#### 6.4.8.3.2 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。

### 6.4.9 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	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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采掘业	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

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	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

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	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

## 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	龙麟佰利	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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）

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前十名资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）

## 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

金额单位：人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）

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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险指标说明
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					-
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)

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

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

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）。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金	西部利得中证 500 等	0

投资和研究部门负责人持有本开放式基金	权重指数分级 A	
	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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
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的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
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	-	-	-	-	-	-

## § 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。

西部利得基金管理有限公司  
2017 年 8 月 29 日