

西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资 基金 2019 年半年度报告

2019 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：二〇一九年八月二十四日

§ 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 2019 年 8 月 23 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 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	8
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
§5 托管人报告	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	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
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.....	58
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	58
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.....	58
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.....	59
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59
7.12 投资组合报告附注.....	59
§8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	61
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	61
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	62
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.....	63
§9 开放式基金份额变动	64
§10 重大事件揭示	65
10.1 基金份额持有人大会决议.....	65
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.....	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	65
10.4 基金投资策略的改变.....	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	65
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.....	65
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	65
10.8 其他重大事件.....	67
§11 影响投资者决策的其他重要信息	68
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.....	68

11.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§12 备查文件目录.....	69
12.1 备查文件目录.....	69
12.2 存放地点.....	69
12.3 查阅方式.....	69

§ 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	261,701,214.35 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所		
上市日期	-		
下属分级基金的基金简称	西部利得中证 500 等权重指数分级 A	西部利得中证 500 等权重指数分级 B	西部利得中证 500 等权重指数分级
下属分级基金场内简称:	500 等权 A	500 等权 B	500 等权
下属分级基金的交易代码	502001	502002	502000
报告期末下属分级基金份额总额	1,521,236.00 份	1,521,236.00 份	258,658,742.35 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	龚小武
	联系电话	021-38572888	021-52629999-212056
	电子邮箱	service@westleadfund.com	gongxiaowu@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	上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼
邮政编码		200127	200041
法定代表人		何方	高建平

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	18,873,608.00
本期利润	46,671,412.47
加权平均基金份额本期利润	0.1948
本期加权平均净值利润率	22.29%
本期基金份额净值增长率	20.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	-180,790,837.44
期末可供分配基金份额利润	-0.6908
期末基金资产净值	232,223,919.45
期末基金份额净值	0.8874
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-42.38%

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	1.14%	1.12%	0.32%	1.35%	0.82%	-0.23%
过去三个月	-6.78%	1.49%	-10.57%	1.76%	3.79%	-0.27%
过去六个月	20.37%	1.47%	17.92%	1.74%	2.45%	-0.27%
过去一年	5.17%	1.42%	-2.95%	1.61%	8.12%	-0.19%
过去三年	-1.17%	1.15%	-19.00%	1.25%	17.83%	-0.10%
自基金合同	-42.38%	1.68%	-35.16%	1.85%	-7.22%	-0.17%

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每交易日进行计算，计算方式如下：

$benchmark(0)=1000;$

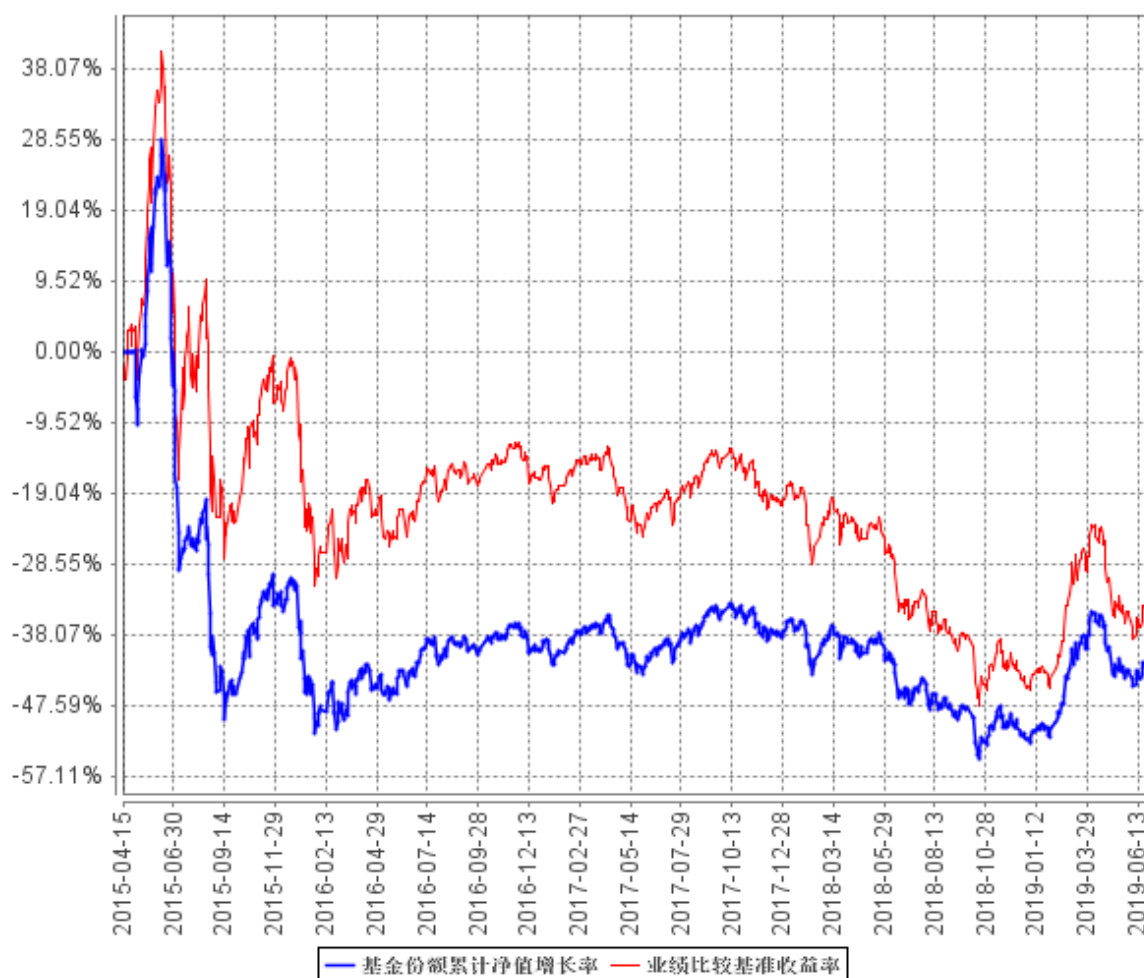
$\%benchmark(t) = 95\% * (中证 500 等权重指数收益率(t) / 中证 500 等权重指数收益率(t-1) - 1) + 5\% * 商业银行人民币活期存款利率 / 365;$

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

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

西部利得基金管理有限公司（简称“西部利得基金”，下同）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2010]864号）批准成立于2010年7月20日。公司由西部证券股份有限公司和利得科技有限公司合资控股，注册资本3.5亿元人民币，其中西部证券股份有限公司占比51%，利得科技有限公司占比49%，注册地上海。

截至2019年6月30日，本基金管理人旗下共管理32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	-	5年	复旦大学理学硕士，曾任光大证券股份有限公司权益投资助理、上海光大证券资产管理有限公司研究员、兴证证券资产管理有限公司量化研究员。2016年10月加入本公司，有基金从业资格，中国国籍。

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

对于场内交易，本基金管理人按照时间优先、价格优先的原则，对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金，采用了系统中的公平交易模块进行操作，实现了公平交易；对于场外交易，本基金管理人按照公司制度和流程执行。

本基金管理人风险管理部负责对各账户公平交易进行事后监察，在每日公平交易报表中记录不同投资组合当天整体收益率、分投资类别（股票、债券）同向（1 日、3 日、5 日）交易价差分析、银行间交易价格偏离度分析；并分别于季度和年度末编制公平交易季度及年度收益率差异分析报告，对本基金管理人管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）不同时间窗口同向（1 日、3 日、5 日）交易的交易价差以及 T 检验、银行间交易价格偏离度进行了分析。

当监控到疑似异常交易时，本基金管理人风险管理部及时要求相关投资组合经理给予解释，该解释经风险管理部辨认后确认该交易无异常情况后留档备查，公平交易季报及年报由投资组合经理、督察长、总经理签署后，由风险管理部妥善保存分析报告备查。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析，公司未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年上半年 A 股整体回暖，本基金作为股票指数基金净值也随之上涨。

在投资管理上，本基金运作严格按照基金合同的各项要求，主要依据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。2019 年基金规模维持在 2 个亿左右，符合网下打新的沪深两市市值要求。公募基金网下打新属于 A 类投资者，新股获配中签率高于 B 类及 C 类投资者。在基金规模满足网下打新要求的前提下，本基金将继续参与网下打新，包括科创板和主板，在指数投资的基础上追求低风险的收益增厚。我们根据日常申赎情况，对股票仓位及头寸

进行了及时且合理的安排，将跟踪误差控制在合理水平。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内基金业绩表现参见本报告第三部分“主要财务指标和基金净值表现”。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾 2019 年上半年，中美贸易战升级，且有向其他领域扩散之势。美国封杀华为等中国高科技企业，在外交领域诋毁中国形象，大幅提高中国货物关税。中国在 2018 年中美贸易战之初使用极尽善意的策略应对美国，在非核心利益上让步，但其结果却是美国变本加厉。面对美国的霸凌行为，中国也用多项举措回应。国务院新闻办发表《关于中美经贸磋商的中方立场》，一方面向全世界揭露了美国霸凌行径已殃及全球，一方面再次阐述了中方“不想打但不怕打”立场；中国建立“不可靠实体清单”制度，以此回应美国对华为的封锁；中国国家发改委暗示中国或用限制稀土出口反击美国；试射了洲际导弹巨浪 3，展示中国强大军事力量。未来中美摩擦将继续扰动 A 股。

展望 2019 年下半年，三股正向力量将托底指数，一股不确定力量将扰动指数，预计 A 股指数震荡上行。

正向力量其一是持续流入的外资。宏观上看 A 股与国外资产相关系数并不高，并且国际资本明显低配中国资产，随着政策持续开放，中国资产对于国际投资者越发具有吸引力。A 股逐步入摩和入富，外资投资 A 股的比例将逐年提升。中国是世界上政治最为稳定的国家之一，拥有世界上最多的外汇储备，拥有人类历史上最大规模的制造业，拥有最大体量的消费市场，这都是中国资产价值所在。世界增持中国，正在路上。

正向力量其二是国内居民大类资产配置将出现拐点，长期增配股票。房地产政策调控还原其居住属性、消弱其金融属性，地产可投资性下降，随着房地产税逐步推进，对房地产资产稳定保值增值的预期或扭转；P2P 等保本保息高收益产品风险凸显，风险事件频发，这将降低居民对此类资产的风险偏好；国内居民大类资产配置将逐步流入股市。

正向力量其三是改革将持续释放红利。中国经济正从高速发展向高质量发展切换，中国制造将逐步升级为中国智造和中国创造。中国特色社会主义市场经济和加入 WTO 拥抱世界的成功改革都曾历经坎坷和波折，如今的改革也是砥砺前行。中国深化改革的成果终将逐步提升市场风险偏

好。

扰动力量是主要是中美摩擦。2018 年中美摩擦从贸易战开始逐步升温 and 扩散，时至今日即使中美可能阶段性达成协议但之间的分歧会一直存在，并且之间的摩擦不会因一次会议一份协议而停止。但其对市场的边际负面影响将逐步淡化，一方面中美摩擦的利空在股市中已逐步定价，随着市场恐美情绪相比 2018 年大为好转，对国家信心的逐步提升，股市风险偏好也将提升；另一方面中国政府也储备了政策工具箱，以应对中美摩擦升级，起到了对冲作用。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据相关法律法规的规定，本基金管理人制订了证券投资基金估值政策和程序，并经本基金管理人总经理办公会议审议通过成立了估值委员会。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。具体职责包括对本基金管理人估值政策和程序的制订和解释；在发生影响估值政策和程序的有效性及应用性的情况，以及在采用新投资策略或投资新品种时，估值委员会负责对所采用的估值模型、假设及参数的适当性进行重新评估或修订，必要时聘请会计师事务所进行审核并出具意见。针对个别投资品种的估值方法调整，均须通过托管银行复核。

估值委员会的成员包括投资管理部、风险管理部、基金运营部等有关人员组成。各成员平均具有 8 年以上的基金相关从业经验，且具有风控、证券研究、会计方面的专业经验并具备必要的专业知识和独立性，参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突，并按照制度规定的专业职责分工和估值流程履行估值程序。

基金经理如认为持仓品种的估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议，通过参与对估值问题的讨论和与估值委员会共同商定估值原则和政策等方式，对估值议案提出反馈意见。作为公司估值委员会委员，基金经理有权投票表决有关议案。

本基金管理人尚未签订任何与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产

净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	10,908,039.90	5,283,083.22
结算备付金		105,464.71	210,084.75
存出保证金		75,995.22	50,992.13
交易性金融资产	6.4.7.2	222,826,892.64	153,237,940.24
其中：股票投资		217,830,892.64	150,240,640.24
基金投资		-	-
债券投资		4,996,000.00	2,997,300.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	48,348.82
应收利息	6.4.7.5	56,916.29	55,161.54
应收股利		-	-
应收申购款		60,963.72	54,808.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		234,034,272.48	158,940,418.89
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 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		1,243,535.42	56,705.62
应付赎回款		9,483.39	7,788.21
应付管理人报酬		172,910.13	138,871.14
应付托管费		34,582.03	27,774.24
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	137,608.12	43,224.01

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	212,233.94	160,029.35
负债合计		1,810,353.03	434,392.57
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	402,381,890.35	337,255,607.58
未分配利润	6.4.7.10	-170,157,970.90	-178,749,581.26
所有者权益合计		232,223,919.45	158,506,026.32
负债和所有者权益总计		234,034,272.48	158,940,418.89

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8874 元，基金份额总额 261,701,214.35 份。其中西部利得中证 500 等权重指数分级 A 的基金份额净值 1.0245 元，基金份额总额 1,521,236.00 份；西部利得中证 500 等权重指数分级 B 的基金份额净值 0.7502 元，基金份额总额 1,521,236.00 份；西部利得中证 500 等权重指数分级的基金份额净值 0.8874 元，基金份额总额 258,658,742.35 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		48,630,456.24	-26,168,815.36
1.利息收入		149,733.74	159,697.84
其中：存款利息收入	6.4.7.11	99,200.58	55,151.07
债券利息收入		50,533.16	104,546.77
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		20,667,400.90	-1,942,834.56
其中：股票投资收益	6.4.7.12	18,512,600.22	-3,505,585.08
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	7,500.00	3,686.50
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	2,147,300.68	1,559,064.02

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	27,797,804.47	-24,387,213.24
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	15,517.13	1,534.60
减：二、费用		1,959,043.77	1,931,715.62
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,028,987.39	1,040,792.16
2. 托管费	6.4.10.2.2	205,797.52	208,158.42
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	511,740.91	498,119.29
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	212,517.95	184,645.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		46,671,412.47	-28,100,530.98
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		46,671,412.47	-28,100,530.98

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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	337,255,607.58	-178,749,581.26	158,506,026.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	46,671,412.47	46,671,412.47
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）	65,126,282.77	-38,079,802.11	27,046,480.66
其中：1.基金申购款	164,038,808.22	-76,561,871.63	87,476,936.59
2.基金赎回款	-98,912,525.45	38,482,069.52	-60,430,455.93
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）	402,381,890.35	-170,157,970.90	232,223,919.45
	上年度可比期间		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
项目	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	346,175,319.33	-130,072,807.53	216,102,511.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-28,100,530.98	-28,100,530.98
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	42,662,806.49	-19,343,357.60	23,319,448.89
其中：1.基金申购款	44,698,194.94	-20,142,516.59	24,555,678.35
2.基金赎回款	-2,035,388.45	799,158.99	-1,236,229.46
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	388,838,125.82	-177,516,696.11	211,321,429.71

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 2019 年 8 月 24 日报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《纽银策略优选股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)的要求,真实、完整地反映了本基金的财

务状况、经营成果和基金净值变动情况。

此外本财务报表同时符合如财务报表附注 6.4.2 所列示的其他有关规定的要求。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 主要税项说明

根据财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015]101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

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

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

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

(d) 对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。

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

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

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

(h)对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的费率计算缴纳教育费附加、地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	10,908,039.90
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	10,908,039.90

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	221,475,706.38	217,830,892.64	-3,644,813.74
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	4,996,400.00	4,996,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	4,996,400.00	4,996,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	226,472,106.38	222,826,892.64	-3,645,213.74

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	4,622.13
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	47.50
应收债券利息	52,212.33
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.13
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	34.20
合计	56,916.29

6.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	137,608.12
银行间市场应付交易费用	-
合计	137,608.12

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	25.99
预提费用	112,207.95
应付指数使用费	100,000.00
合计	212,233.94

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	211,954,297.39	337,255,607.58
本期申购	114,076,335.47	164,038,808.22
本期赎回(以“-”号填列)	-64,329,418.51	-98,912,525.45
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	261,701,214.35	402,381,890.35

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-168,611,702.01	-10,137,879.25	-178,749,581.26
本期利润	18,873,608.00	27,797,804.47	46,671,412.47
本期基金份额交易产生的变动数	-31,052,743.43	-7,027,058.68	-38,079,802.11
其中：基金申购款	-80,378,501.11	3,816,629.48	-76,561,871.63
基金赎回款	49,325,757.68	-10,843,688.16	38,482,069.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-180,790,837.44	10,632,866.54	-170,157,970.90

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	90,904.93
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,867.58
其他	5,428.07
合计	99,200.58

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	213,747,490.87
减：卖出股票成本总额	195,234,890.65
买卖股票差价收入	18,512,600.22

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	7,500.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	7,500.00

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
----	----------------------------

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,076,500.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,992,500.00
减：应收利息总额	76,500.00
买卖债券差价收入	7,500.00

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期未有债券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期未有债券申购差价收入。

6.4.7.13.5 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。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金在本报告期内未持有贵金属。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金在本报告期内未持有贵金属。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内未持有贵金属。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内未持有贵金属。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内未持有衍生工具。

6.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金本报告期内未持有衍生工具。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,147,300.68
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,147,300.68

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	27,797,804.47
——股票投资	27,803,004.47
——债券投资	-5,200.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	27,797,804.47

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	15,517.13
合计	15,517.13

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

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

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	511,740.91
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	511,740.91

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	57,659.98
指数使用费	100,000.00
上市费用	29,752.78
银行汇划费用	310.00
合计	212,517.95

6.4.7.21 分部报告

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

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
西部利得基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
西部证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
利得科技有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
兴业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
西部证券	-	-	22,702,821.73	5.38%

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019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
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
西部证券	12,061.18	4.64%	12,061.18	8.14%

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30 日
	当期发生的基金应支付的管理费	1,028,987.39
其中：支付销售机构的客户维护费	6,324.99	4,046.19

注：支付基金管理人西部利得基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×1%/当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30 日
	当期发生的基金应支付	205,797.52

的托管费		
------	--	--

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

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.2%/当年天数

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1日至2018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	10,908,039.90	90,904.93	8,816,874.43	50,758.07

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 2019 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 105,464.71 元。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019 年 6 月 26 日	2019 年 7 月 5 日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信出版	2019 年 6 月 27 日	2019 年 7 月 5 日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持暂时停牌股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只股票型指数基金分级证券投资基金，采用指数化投资策略，通过严格的投资纪律约

束和数量化的风险管理手段，追求对中证 500 等权重指数的有效跟踪。本基金预期风险大于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额看，西部利得中证 500 等权重 A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；西部利得中证 500 等权重 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行兴业银行，与该银行存款相关的信用风险较低。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	-	-

A-1 以下	-	-
未评级	4,996,000.00	-
合计	4,996,000.00	-

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债、超短期融资券等无信用评级的债券。

6.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	2,997,300.00
合计	-	2,997,300.00

注 1：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债、超短期融资券等无信用评级的债券。

注 2：于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有按长期信用评级列示的交易性债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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 2019 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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金管理人根据法律法规制定了《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理办法》，采用事前预警、事中控制和事后评估调整的多重分级控制机制，通过运用制度规范、业务流程控制、实时监控、稽核检查、应急处置等手段对流动性风险进行监督控制。

报告期内本基金严格遵守流动性管理的相关法律法规及管理人内部规定，主要投资于流动性较好的债券资产，基金 7 日可变现资产始终保持较高水平，基金资产整体具备良好流动性，基金资产的变现能力可有效应对投资者赎回需求。

《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》公布后，本基金未出现接受某一投资者申购申请后导致其份额超过基金总份额 50% 以上的情况。基金管理人对本基金的份额持有人集中度实施严格的监控与管理，根据份额持有人集中度情况对本基金的投资组合实施调整。报告期内本基金主动投资流动性受限资产的市值合计未超过本基金资产净值的 15%。报告期内本基金未出现无法以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项及其他流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

本基金管理人通过监测组合久期、Beta 值等指标来衡量市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 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	10,908,039.90	-	-	-	10,908,039.90
结算备付金	105,464.71	-	-	-	105,464.71
存出保证金	75,995.22	-	-	-	75,995.22
交易性金融资产	4,996,000.00	-	-	-217,830,892.64	222,826,892.64
应收利息	-	-	-	56,916.29	56,916.29
应收申购款	-	-	-	60,963.72	60,963.72
资产总计	16,085,499.83	-	-	-217,948,772.65	234,034,272.48
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,243,535.42	1,243,535.42
应付赎回款	-	-	-	9,483.39	9,483.39
应付管理人报酬	-	-	-	172,910.13	172,910.13
应付托管费	-	-	-	34,582.03	34,582.03
应付交易费用	-	-	-	137,608.12	137,608.12
其他负债	-	-	-	212,233.94	212,233.94
负债总计	-	-	-	1,810,353.03	1,810,353.03
利率敏感度缺口	16,085,499.83	-	-	-216,138,419.62	232,223,919.45
上年度末 2018 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	5,283,083.22	-	-	-	5,283,083.22
结算备付金	210,084.75	-	-	-	210,084.75
存出保证金	50,992.13	-	-	-	50,992.13
交易性金融资产	2,997,300.00	-	-	-150,240,640.24	153,237,940.24
应收证券清算款	-	-	-	48,348.82	48,348.82
应收利息	-	-	-	55,161.54	55,161.54
应收申购款	7.76	-	-	54,800.43	54,808.19
资产总计	8,541,467.86	-	-	-150,398,951.03	158,940,418.89
负债					
应付证券清算款	-	-	-	56,705.62	56,705.62
应付赎回款	-	-	-	7,788.21	7,788.21
应付管理人报酬	-	-	-	138,871.14	138,871.14
应付托管费	-	-	-	27,774.24	27,774.24
应付交易费用	-	-	-	43,224.01	43,224.01
其他负债	-	-	-	160,029.35	160,029.35
负债总计	-	-	-	434,392.57	434,392.57
利率敏感度缺口	8,541,467.86	-	-	-149,964,558.46	158,506,026.32

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

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用完全复制法构建股票投资组合，根据中证 500 等权重指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。债券投资方面，本基金在满足安全性与流动性的前提下，通过对国内外宏观经济形势的把握和系统分析国内财政政策与货币政策等因素变化对债券市场的影响，审慎研判债券市场风险收益特征的变化趋势，采取“自上而下”的策略选择个券，构造组合。此外，本基金的基金管理人还定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：投资于中证 500 等权重指数成分股及备选成分股的资产不低于基金资产净值的 90%且不低于非现金资产的 80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净	公允价值	占基金资 产净值比

		值比例 (%)		例 (%)
交易性金融资产-股票投资	217,830,892.64	93.80	150,240,640.24	94.79
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	4,996,000.00	2.15	2,997,300.00	1.89
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	222,826,892.64	95.95	153,237,940.24	96.68

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

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	10,386,000.00	7,060,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-10,386,000.00	-7,060,000.00

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 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 217,734,312.34 元，第二层次余额为 5,092,580.3 元，无属于第三层次的余额（2018 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为 149,060,419.07 元，属于第二层次的余额为 4,177,521.17 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 2019 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（2018 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	217,830,892.64	93.08
	其中：股票	217,830,892.64	93.08
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,996,000.00	2.13
	其中：债券	4,996,000.00	2.13
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	11,013,504.61	4.71
8	其他各项资产	193,875.23	0.08
9	合计	234,034,272.48	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	1,036,823.80	0.45
B	采矿业	10,007,686.10	4.31
C	制造业	116,305,802.32	50.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,617,829.50	3.28
E	建筑业	6,365,809.81	2.74
F	批发和零售业	16,664,283.58	7.18
G	交通运输、仓储和邮政业	8,592,170.70	3.70
H	住宿和餐饮业	707,168.00	0.30
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,576,324.67	6.71
J	金融业	9,268,069.76	3.99
K	房地产业	9,889,745.13	4.26
L	租赁和商务服务业	4,949,340.22	2.13

M	科学研究和技术服务业	84,819.00	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	1,314,454.64	0.57
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	429,039.00	0.18
Q	卫生和社会工作	266,586.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业	7,008,409.00	3.02
S	综合	1,349,457.85	0.58
	合计	217,433,819.08	93.63

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	125,063.10	0.05
C	制造业	175,430.16	0.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	39,603.76	0.02
J	金融业	33,869.94	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	397,073.56	0.17

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600282	南钢股份	417,600	1,461,600.00	0.63
2	002195	二三四五	287,183	1,117,141.87	0.48
3	601100	恒立液压	32,100	1,007,298.00	0.43
4	600410	华胜天成	92,100	988,233.00	0.43
5	000877	天山股份	84,100	977,242.00	0.42
6	000999	华润三九	32,900	965,286.00	0.42
7	000513	丽珠集团	28,815	957,522.45	0.41
8	600260	凯乐科技	47,700	953,046.00	0.41
9	002128	露天煤业	109,700	948,905.00	0.41
10	002223	鱼跃医疗	38,355	944,300.10	0.41
11	600380	健康元	108,900	941,985.00	0.41
12	002250	联化科技	84,700	939,323.00	0.40
13	300115	长盈精密	88,200	925,218.00	0.40
14	002544	杰赛科技	71,000	923,000.00	0.40
15	600993	马应龙	52,200	921,330.00	0.40
16	603355	莱克电气	42,800	921,056.00	0.40
17	002444	巨星科技	91,700	915,166.00	0.39
18	603806	福斯特	24,860	913,107.80	0.39
19	600971	恒源煤电	155,940	912,249.00	0.39
20	600739	辽宁成大	62,500	908,750.00	0.39
21	300055	万邦达	126,300	900,519.00	0.39
22	600511	国药股份	39,100	898,127.00	0.39
23	002233	塔牌集团	76,600	894,688.00	0.39
24	002152	广电运通	130,400	893,240.00	0.38
25	600315	上海家化	28,500	887,775.00	0.38
26	600062	华润双鹤	70,200	885,222.00	0.38
27	000623	吉林敖东	53,800	881,782.00	0.38
28	002382	蓝帆医疗	63,800	881,716.00	0.38
29	002399	海普瑞	42,000	881,580.00	0.38
30	002249	大洋电机	203,000	881,020.00	0.38
31	600376	首开股份	98,400	878,712.00	0.38
32	600970	中材国际	136,650	878,659.50	0.38
33	600755	厦门国贸	101,700	877,671.00	0.38

34	600039	四川路桥	241,086	877,553.04	0.38
35	600143	金发科技	178,700	875,630.00	0.38
36	600827	百联股份	89,200	875,052.00	0.38
37	600466	蓝光发展	140,680	875,029.60	0.38
38	600845	宝信软件	30,680	873,766.40	0.38
39	000528	柳工	131,010	872,526.60	0.38
40	601717	郑煤机	152,700	871,917.00	0.38
41	603225	新凤鸣	69,700	870,553.00	0.37
42	601001	大同煤业	190,400	870,128.00	0.37
43	600582	天地科技	251,200	866,640.00	0.37
44	600166	福田汽车	364,600	864,102.00	0.37
45	600750	江中药业	66,375	863,538.75	0.37
46	000537	广宇发展	124,600	862,232.00	0.37
47	600486	扬农化工	15,700	858,790.00	0.37
48	000501	鄂武商 A	79,800	857,850.00	0.37
49	600325	华发股份	109,800	857,538.00	0.37
50	002818	富森美	66,780	856,787.40	0.37
51	600694	大商股份	30,605	854,185.55	0.37
52	601311	骆驼股份	78,600	852,810.00	0.37
53	600657	信达地产	206,600	851,192.00	0.37
54	601699	潞安环能	106,900	848,786.00	0.37
55	300383	光环新网	50,600	848,562.00	0.37
56	000997	新大陆	50,100	846,189.00	0.36
57	002251	步步高	106,144	845,967.68	0.36
58	002344	海宁皮城	181,300	844,858.00	0.36
59	600329	中新药业	59,000	843,110.00	0.36
60	600909	华安证券	128,900	843,006.00	0.36
61	600881	亚泰集团	259,200	842,400.00	0.36
62	600348	阳泉煤业	144,100	837,221.00	0.36
63	600557	康缘药业	56,080	833,348.80	0.36
64	603328	依顿电子	81,100	832,897.00	0.36
65	600120	浙江东方	65,255	831,348.70	0.36
66	603556	海兴电力	59,970	828,785.40	0.36
67	002078	太阳纸业	121,600	828,096.00	0.36
68	600623	华谊集团	108,000	825,120.00	0.36
69	002463	沪电股份	60,400	822,648.00	0.35
70	600565	迪马股份	220,500	822,465.00	0.35
71	600835	上海机电	49,500	821,700.00	0.35
72	000686	东北证券	93,100	820,211.00	0.35

73	600823	世茂股份	177,461	818,095.21	0.35
74	002489	浙江永强	244,800	817,632.00	0.35
75	002635	安洁科技	60,500	816,145.00	0.35
76	600409	三友化工	143,600	812,776.00	0.35
77	300010	立思辰	86,200	809,418.00	0.35
78	601928	凤凰传媒	99,900	806,193.00	0.35
79	600335	国机汽车	115,900	802,028.00	0.35
80	600859	王府井	52,700	800,513.00	0.34
81	300315	掌趣科技	231,900	800,055.00	0.34
82	002092	中泰化学	100,500	799,980.00	0.34
83	600875	东方电气	75,200	798,624.00	0.34
84	600985	淮北矿业	70,400	798,336.00	0.34
85	600312	平高电气	103,300	794,377.00	0.34
86	000039	中集集团	74,280	793,310.40	0.34
87	000027	深圳能源	127,829	792,539.80	0.34
88	000600	建投能源	117,900	789,930.00	0.34
89	600026	中远海能	121,700	789,833.00	0.34
90	300088	长信科技	155,939	789,051.34	0.34
91	002048	宁波华翔	72,800	787,696.00	0.34
92	600820	隧道股份	124,800	787,488.00	0.34
93	600633	浙数文化	84,000	785,400.00	0.34
94	002299	圣农发展	30,840	780,868.80	0.34
95	600718	东软集团	60,600	776,892.00	0.33
96	600126	杭钢股份	169,900	774,744.00	0.33
97	000061	农产品	142,800	773,976.00	0.33
98	600195	中牧股份	55,879	773,924.15	0.33
99	600699	均胜电子	36,200	773,232.00	0.33
100	002242	九阳股份	37,100	772,051.00	0.33
101	601231	环旭电子	64,000	771,200.00	0.33
102	000541	佛山照明	146,564	767,995.36	0.33
103	000021	深科技	94,400	767,472.00	0.33
104	600373	中文传媒	61,100	767,416.00	0.33
105	600037	歌华有线	74,800	766,700.00	0.33
106	000685	中山公用	89,360	763,134.40	0.33
107	601179	中国西电	205,900	761,830.00	0.33
108	000090	天健集团	154,050	761,007.00	0.33
109	600499	科达洁能	173,700	760,806.00	0.33
110	000156	华数传媒	69,100	760,791.00	0.33
111	600757	长江传媒	111,700	760,677.00	0.33

112	600580	卧龙电驱	90,420	760,432.20	0.33
113	601333	广深铁路	234,600	757,758.00	0.33
114	000983	西山煤电	124,900	756,894.00	0.33
115	600908	无锡银行	133,175	751,107.00	0.32
116	601098	中南传媒	59,400	750,816.00	0.32
117	000869	张裕A	23,300	748,396.00	0.32
118	000848	承德露露	89,175	742,827.75	0.32
119	000778	新兴铸管	167,200	742,368.00	0.32
120	000552	靖远煤电	272,400	738,204.00	0.32
121	600017	日照港	232,300	731,745.00	0.32
122	000826	启迪桑德	61,600	726,264.00	0.31
123	000543	皖能电力	154,110	725,858.10	0.31
124	002603	以岭药业	62,300	721,434.00	0.31
125	600901	江苏租赁	117,500	715,575.00	0.31
126	002470	金正大	196,200	714,168.00	0.31
127	000761	本钢板材	164,900	709,070.00	0.31
128	600754	锦江股份	28,700	707,168.00	0.30
129	002317	众生药业	81,600	694,416.00	0.30
130	000937	冀中能源	179,351	692,294.86	0.30
131	002244	滨江集团	165,900	688,485.00	0.30
132	002004	华邦健康	141,300	686,718.00	0.30
133	002745	木林森	58,400	684,448.00	0.29
134	002221	东华能源	79,490	684,408.90	0.29
135	601866	中远海发	250,600	681,632.00	0.29
136	603766	隆鑫通用	162,150	679,408.50	0.29
137	600563	法拉电子	16,480	678,481.60	0.29
138	002028	思源电气	67,800	675,288.00	0.29
139	600528	中铁工业	58,300	674,531.00	0.29
140	601000	唐山港	244,760	673,090.00	0.29
141	000926	福星股份	96,676	668,997.92	0.29
142	000878	云南铜业	62,800	667,564.00	0.29
143	002920	德赛西威	29,800	667,520.00	0.29
144	002332	仙琚制药	98,700	667,212.00	0.29
145	600811	东方集团	179,050	666,066.00	0.29
146	600073	上海梅林	71,900	661,480.00	0.28
147	601801	皖新传媒	109,700	659,297.00	0.28
148	600056	中国医药	48,700	656,963.00	0.28
149	000690	宝新能源	101,900	656,236.00	0.28
150	600642	申能股份	108,300	650,883.00	0.28

151	002266	浙富控股	135,200	642,200.00	0.28
152	000987	越秀金控	71,000	640,420.00	0.28
153	002074	国轩高科	48,600	637,146.00	0.27
154	002064	华峰氨纶	126,300	634,026.00	0.27
155	600673	东阳光	80,700	633,495.00	0.27
156	002707	众信旅游	104,000	631,280.00	0.27
157	300207	欣旺达	54,700	630,144.00	0.27
158	603444	吉比特	3,000	629,880.00	0.27
159	002831	裕同科技	32,700	626,859.00	0.27
160	600169	太原重工	234,400	625,848.00	0.27
161	603228	景旺电子	15,560	622,555.60	0.27
162	000028	国药一致	14,800	619,084.00	0.27
163	000581	威孚高科	33,200	616,192.00	0.27
164	300058	蓝色光标	143,946	614,649.42	0.26
165	601019	山东出版	79,000	614,620.00	0.26
166	300324	旋极信息	106,000	613,740.00	0.26
167	002129	中环股份	62,700	611,952.00	0.26
168	600782	新钢股份	121,600	608,000.00	0.26
169	600160	巨化股份	85,410	607,265.10	0.26
170	000959	首钢股份	172,400	606,848.00	0.26
171	002589	瑞康医药	79,000	599,610.00	0.26
172	002440	闰土股份	47,900	596,834.00	0.26
173	600500	中化国际	79,700	595,359.00	0.26
174	603517	绝味食品	15,300	595,323.00	0.26
175	600021	上海电力	68,000	590,240.00	0.25
176	002807	江阴银行	125,840	588,931.20	0.25
177	600426	华鲁恒升	39,586	588,247.96	0.25
178	002503	搜于特	213,300	586,575.00	0.25
179	002500	山西证券	72,300	585,630.00	0.25
180	002926	华西证券	55,700	584,850.00	0.25
181	002353	杰瑞股份	25,200	582,120.00	0.25
182	002038	双鹭药业	24,500	577,220.00	0.25
183	000750	国海证券	114,700	576,941.00	0.25
184	000636	风华高科	47,500	574,750.00	0.25
185	002191	劲嘉股份	46,100	572,101.00	0.25
186	002217	合力泰	103,200	570,696.00	0.25
187	002491	通鼎互联	70,400	569,536.00	0.25
188	603369	今世缘	20,400	568,956.00	0.25
189	600171	上海贝岭	34,800	565,500.00	0.24

190	603866	桃李面包	13,520	563,108.00	0.24
191	002131	利欧股份	291,300	556,383.00	0.24
192	603883	老百姓	9,500	555,560.00	0.24
193	600643	爱建集团	57,120	547,209.60	0.24
194	600079	人福医药	52,000	546,000.00	0.24
195	000009	中国宝安	95,335	544,362.85	0.23
196	600729	重庆百货	18,000	544,320.00	0.23
197	300182	捷成股份	123,000	542,430.00	0.23
198	000006	深振业 A	99,400	541,730.00	0.23
199	002665	首航节能	159,200	539,688.00	0.23
200	002375	亚厦股份	90,700	536,037.00	0.23
201	000598	兴蓉环境	117,100	532,805.00	0.23
202	000807	云铝股份	111,900	524,811.00	0.23
203	000078	海王生物	150,050	522,174.00	0.22
204	600053	九鼎投资	22,100	514,930.00	0.22
205	603877	太平鸟	33,100	513,712.00	0.22
206	002505	大康农业	260,000	512,200.00	0.22
207	600863	内蒙华电	163,100	512,134.00	0.22
208	300376	易事特	103,800	511,734.00	0.22
209	002815	崇达技术	32,700	509,793.00	0.22
210	600959	江苏有线	114,500	509,525.00	0.22
211	603816	顾家家居	15,960	509,443.20	0.22
212	000718	苏宁环球	146,400	506,544.00	0.22
213	601168	西部矿业	79,100	504,658.00	0.22
214	603198	迎驾贡酒	28,000	501,480.00	0.22
215	300308	中际旭创	14,700	499,653.00	0.22
216	000980	众泰汽车	117,300	493,833.00	0.21
217	600967	内蒙一机	44,000	492,800.00	0.21
218	002416	爱施德	78,480	490,500.00	0.21
219	002465	海格通信	51,400	490,356.00	0.21
220	002690	美亚光电	15,000	489,000.00	0.21
221	002384	东山精密	33,550	488,823.50	0.21
222	601611	中国核建	62,800	488,584.00	0.21
223	000830	鲁西化工	44,900	488,512.00	0.21
224	000860	顺鑫农业	10,390	484,693.50	0.21
225	600125	铁龙物流	75,000	483,750.00	0.21
226	601678	滨化股份	71,378	482,515.28	0.21
227	603233	大参林	10,710	481,950.00	0.21
228	002507	涪陵榨菜	15,800	481,900.00	0.21

229	600098	广州发展	78,000	480,480.00	0.21
230	600801	华新水泥	23,620	478,305.00	0.21
231	002583	海能达	57,000	478,230.00	0.21
232	600862	中航高科	53,000	476,470.00	0.21
233	000089	深圳机场	53,000	471,170.00	0.20
234	600388	龙净环保	38,000	470,820.00	0.20
235	600266	北京城建	58,360	470,381.60	0.20
236	601005	重庆钢铁	233,500	469,335.00	0.20
237	603568	伟明环保	21,797	469,071.44	0.20
238	002419	天虹股份	35,600	464,936.00	0.20
239	002019	亿帆医药	37,900	464,275.00	0.20
240	600317	营口港	167,600	462,576.00	0.20
241	002340	格林美	97,732	460,317.72	0.20
242	600350	山东高速	95,600	458,880.00	0.20
243	002280	联络互动	125,300	458,598.00	0.20
244	000887	中鼎股份	47,700	457,443.00	0.20
245	000547	航天发展	47,500	454,100.00	0.20
246	002273	水晶光电	39,110	452,893.80	0.20
247	600611	大众交通	97,000	451,050.00	0.19
248	600597	光明乳业	41,900	450,425.00	0.19
249	600779	水井坊	8,800	447,216.00	0.19
250	000519	中兵红箭	57,655	445,673.15	0.19
251	601689	拓普集团	29,000	444,280.00	0.19
252	002174	游族网络	26,200	442,256.00	0.19
253	000975	银泰资源	33,516	442,076.04	0.19
254	000738	航发控制	32,800	439,520.00	0.19
255	600879	航天电子	70,900	436,744.00	0.19
256	601872	招商轮船	99,900	435,564.00	0.19
257	300166	东方国信	35,400	435,066.00	0.19
258	600138	中青旅	34,200	433,998.00	0.19
259	000932	华菱钢铁	90,600	432,162.00	0.19
260	600291	西水股份	42,700	429,562.00	0.18
261	002699	美盛文化	71,100	426,600.00	0.18
262	600141	兴发集团	41,400	425,592.00	0.18
263	300159	新研股份	85,400	425,292.00	0.18
264	600869	智慧能源	94,000	424,880.00	0.18
265	002373	千方科技	24,700	422,370.00	0.18
266	601969	海南矿业	71,800	422,184.00	0.18
267	000960	锡业股份	37,500	418,875.00	0.18

268	000988	华工科技	26,400	417,648.00	0.18
269	000060	中金岭南	88,800	416,472.00	0.18
270	600418	江淮汽车	80,500	415,380.00	0.18
271	600745	闻泰科技	12,500	415,250.00	0.18
272	000012	南 玻 A	98,780	410,924.80	0.18
273	600717	天津港	63,960	410,623.20	0.18
274	002424	贵州百灵	41,500	410,020.00	0.18
275	002916	深南电路	4,014	409,106.88	0.18
276	600435	北方导航	44,800	402,752.00	0.17
277	600060	海信电器	46,500	400,830.00	0.17
278	000559	万向钱潮	66,700	398,866.00	0.17
279	601958	金铂股份	59,300	397,310.00	0.17
280	600183	生益科技	26,375	396,943.75	0.17
281	600216	浙江医药	38,600	395,264.00	0.17
282	600939	重庆建工	80,339	392,857.71	0.17
283	300134	大富科技	25,100	389,803.00	0.17
284	002517	恺英网络	121,400	387,266.00	0.17
285	000717	韶钢松山	87,200	386,296.00	0.17
286	600575	皖江物流	130,500	382,365.00	0.16
287	600545	卓郎智能	52,700	374,697.00	0.16
288	600765	中航重机	40,400	372,892.00	0.16
289	600787	中储股份	65,000	372,450.00	0.16
290	300113	顺网科技	23,600	370,048.00	0.16
291	601718	际华集团	94,600	369,886.00	0.16
292	002670	国盛金控	29,291	369,066.60	0.16
293	603659	璞泰来	7,800	366,756.00	0.16
294	002482	广田集团	75,300	365,958.00	0.16
295	002051	中工国际	31,848	365,296.56	0.16
296	300133	华策影视	54,200	364,766.00	0.16
297	300257	开山股份	32,800	363,424.00	0.16
298	600094	大名城	57,200	359,788.00	0.15
299	600885	宏发股份	14,620	355,266.00	0.15
300	600316	洪都航空	24,770	354,458.70	0.15
301	601128	常熟银行	45,200	348,944.00	0.15
302	000536	华映科技	138,000	347,760.00	0.15
303	000883	湖北能源	79,800	346,332.00	0.15
304	300274	阳光电源	36,760	343,706.00	0.15
305	000158	常山北明	62,100	336,582.00	0.14
306	600567	山鹰纸业	99,300	334,641.00	0.14

307	603025	大豪科技	32,068	328,376.32	0.14
308	600428	中远海特	88,000	325,600.00	0.14
309	600872	中炬高新	7,600	325,508.00	0.14
310	300459	金科文化	56,900	323,761.00	0.14
311	002812	恩捷股份	6,900	322,575.00	0.14
312	600884	杉杉股份	29,200	310,980.00	0.13
313	603939	益丰药房	4,400	307,956.00	0.13
314	603569	长久物流	26,360	305,512.40	0.13
315	600167	联美控股	28,540	301,953.20	0.13
316	002607	中公教育	21,900	300,687.00	0.13
317	603056	德邦股份	21,100	297,088.00	0.13
318	002366	台海核电	31,700	296,712.00	0.13
319	000681	视觉中国	15,300	296,514.00	0.13
320	600022	山东钢铁	176,080	294,053.60	0.13
321	600839	四川长虹	99,000	292,050.00	0.13
322	002254	泰和新材	27,500	290,950.00	0.13
323	002183	怡亚通	58,300	278,091.00	0.12
324	000400	许继电气	29,700	269,082.00	0.12
325	300244	迪安诊断	15,700	266,586.00	0.11
326	002681	奋达科技	62,800	266,272.00	0.11
327	002434	万里扬	39,200	266,168.00	0.11
328	002385	大北农	49,300	260,797.00	0.11
329	603888	新华网	13,050	260,478.00	0.11
330	600497	驰宏锌锗	50,900	258,572.00	0.11
331	601118	海南橡胶	49,700	255,955.00	0.11
332	002839	张家港行	43,300	243,779.00	0.10
333	600416	湘电股份	40,000	240,800.00	0.10
334	002408	齐翔腾达	30,900	239,475.00	0.10
335	002672	东江环保	20,900	237,006.00	0.10
336	603885	吉祥航空	18,000	235,800.00	0.10
337	000758	中色股份	42,700	234,423.00	0.10
338	002640	跨境通	28,100	234,073.00	0.10
339	002709	天赐材料	9,600	232,320.00	0.10
340	000401	冀东水泥	13,100	230,691.00	0.10
341	002509	天广中茂	107,800	222,068.00	0.10
342	002948	青岛银行	34,000	218,620.00	0.09
343	300253	卫宁健康	15,400	218,372.00	0.09
344	000727	华东科技	100,900	210,881.00	0.09
345	002127	南极电商	18,700	210,188.00	0.09

346	000712	锦龙股份	15,599	200,291.16	0.09
347	300168	万达信息	15,400	199,738.00	0.09
348	300450	先导智能	5,900	198,240.00	0.09
349	603868	飞科电器	5,000	195,750.00	0.08
350	601016	节能风电	71,300	189,658.00	0.08
351	600458	时代新材	18,200	189,098.00	0.08
352	002821	凯莱英	1,900	186,352.00	0.08
353	002407	多氟多	15,700	185,888.00	0.08
354	600572	康恩贝	28,500	182,400.00	0.08
355	600307	酒钢宏兴	89,000	180,670.00	0.08
356	600201	生物股份	11,322	177,642.18	0.08
357	000766	通化金马	26,100	177,480.00	0.08
358	002358	森源电气	17,200	174,580.00	0.08
359	600777	新潮能源	82,500	171,600.00	0.07
360	600151	航天机电	33,300	171,495.00	0.07
361	300027	华谊兄弟	34,700	170,377.00	0.07
362	002368	太极股份	5,400	163,620.00	0.07
363	000426	兴业矿业	30,400	163,248.00	0.07
364	300002	神州泰岳	39,720	158,085.60	0.07
365	603486	科沃斯	5,000	151,250.00	0.07
366	000062	深圳华强	11,225	149,180.25	0.06
367	002281	光迅科技	5,521	146,196.08	0.06
368	600267	海正药业	14,500	145,000.00	0.06
369	600507	方大特钢	14,500	141,810.00	0.06
370	000031	大悦城	22,000	141,240.00	0.06
371	600521	华海药业	10,000	141,000.00	0.06
372	600393	粤泰股份	28,600	132,990.00	0.06
373	002049	紫光国微	3,000	132,330.00	0.06
374	000829	天音控股	22,400	130,368.00	0.06
375	600161	天坛生物	5,160	130,290.00	0.06
376	603377	东方时尚	8,400	128,352.00	0.06
377	600478	科力远	22,500	125,775.00	0.05
378	601127	小康股份	9,600	125,760.00	0.05
379	002372	伟星新材	7,200	125,280.00	0.05
380	600848	上海临港	4,000	124,520.00	0.05
381	000563	陕国投 A	27,530	122,233.20	0.05
382	600008	首创股份	32,900	115,808.00	0.05
383	601200	上海环境	8,220	111,874.20	0.05
384	002285	世联行	24,300	109,593.00	0.05

385	600639	浦东金桥	6,600	106,722.00	0.05
386	600640	号百控股	7,760	103,828.80	0.04
387	600298	安琪酵母	3,200	101,216.00	0.04
388	600280	中央商场	28,000	100,520.00	0.04
389	002797	第一创业	15,500	98,270.00	0.04
390	000729	燕京啤酒	14,400	95,616.00	0.04
391	600338	西藏珠峰	5,460	95,440.80	0.04
392	000930	中粮生化	12,600	94,752.00	0.04
393	600006	东风汽车	17,500	93,275.00	0.04
394	002572	索菲亚	5,000	92,800.00	0.04
395	600874	创业环保	11,000	91,190.00	0.04
396	601326	秦港股份	24,600	89,298.00	0.04
397	601811	新华文轩	7,200	87,912.00	0.04
398	002155	湖南黄金	8,600	86,602.00	0.04
399	600645	中源协和	4,900	84,819.00	0.04
400	002110	三钢闽光	8,850	82,305.00	0.04
401	601880	大连港	38,450	81,898.50	0.04
402	603515	欧普照明	2,500	80,625.00	0.03
403	600584	长电科技	6,200	79,670.00	0.03
404	002390	信邦制药	15,000	79,050.00	0.03
405	600917	重庆燃气	11,300	78,648.00	0.03
406	600460	士兰微	4,700	78,020.00	0.03
407	002371	北方华创	1,100	76,175.00	0.03
408	000025	特力A	3,725	75,319.50	0.03
409	603000	人民网	4,100	73,103.00	0.03
410	600808	马钢股份	21,300	72,633.00	0.03
411	600158	中体产业	7,100	72,633.00	0.03
412	600155	华创阳安	5,100	68,493.00	0.03
413	601003	柳钢股份	10,400	60,216.00	0.03
414	002030	达安基因	5,100	54,723.00	0.02
415	600737	中粮糖业	6,200	53,816.00	0.02
416	600058	五矿发展	6,300	53,235.00	0.02
417	603712	七一二	2,200	46,706.00	0.02
418	300418	昆仑万维	3,000	38,610.00	0.02
419	002431	棕榈股份	3,000	11,850.00	0.01
420	002573	清新环境	900	7,245.00	0.00
421	002414	高德红外	315	6,048.00	0.00
422	000970	中科三环	100	1,135.00	0.00
423	600064	南京高科	80	856.80	0.00

424	000488	晨鸣纸业	50	268.00	0.00
425	600759	洲际油气	40	154.40	0.00

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	600968	海油发展	35,122	124,683.10	0.05
2	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.03
3	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.02
4	603863	松炆资源	1,548	35,727.84	0.02
5	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.01
6	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.01
7	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.01
8	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.01
9	000693	华泽退	1,000	380.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002373	千方科技	1,561,594.00	0.99
2	300002	神州泰岳	1,235,959.00	0.78
3	000623	吉林敖东	1,134,987.00	0.72
4	002665	首航节能	1,123,632.00	0.71
5	600600	青岛啤酒	1,095,988.00	0.69
6	600062	华润双鹤	1,092,416.00	0.69
7	600884	杉杉股份	1,077,369.00	0.68
8	600141	兴发集团	1,059,854.00	0.67
9	002465	海格通信	1,044,382.00	0.66
10	002249	大洋电机	1,031,770.00	0.65
11	000969	安泰科技	1,018,016.00	0.64
12	002250	联化科技	1,015,414.00	0.64
13	002195	二三四五	1,012,838.00	0.64
14	002266	浙富控股	1,012,301.00	0.64

15	600718	东软集团	1,012,296.00	0.64
16	002489	浙江永强	1,003,375.00	0.63
17	002368	太极股份	1,002,324.00	0.63
18	002920	德赛西威	999,287.00	0.63
19	600282	南钢股份	977,892.00	0.62
20	002093	国脉科技	976,915.00	0.62

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	002373	千方科技	2,133,261.00	1.35
2	000723	美锦能源	2,118,610.00	1.34
3	600600	青岛啤酒	1,778,079.00	1.12
4	002093	国脉科技	1,686,256.00	1.06
5	300002	神州泰岳	1,627,902.00	1.03
6	603000	人民网	1,584,841.00	1.00
7	000066	中国长城	1,518,410.00	0.96
8	300134	大富科技	1,443,919.00	0.91
9	600006	东风汽车	1,432,398.00	0.90
10	000990	诚志股份	1,372,578.40	0.87
11	600366	宁波韵升	1,369,578.64	0.86
12	600151	航天机电	1,350,152.00	0.85
13	000969	安泰科技	1,331,921.00	0.84
14	600155	华创阳安	1,306,357.00	0.82
15	300026	红日药业	1,242,218.00	0.78
16	600884	杉杉股份	1,171,002.00	0.74
17	600277	亿利洁能	1,164,181.00	0.73
18	300146	汤臣倍健	1,153,765.00	0.73
19	600759	洲际油气	1,151,917.00	0.73
20	601200	上海环境	1,143,759.00	0.72

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	235,022,138.58
卖出股票收入（成交）总额	213,747,490.87

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	4,996,000.00	2.15
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,996,000.00	2.15

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019611	19 国债 01	50,000	4,996,000.00	2.15

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体，除凯乐科技在 2019 年 4 月 26 日，因未及时披露公司重大事项，被证监会出具警示函外，其余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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	75,995.22
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	56,916.29
5	应收申购款	60,963.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	193,875.23

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601236	红塔证券	33,869.94	0.01	新股锁定

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
西部利得中证 500 等权重指数分级 A	118	12,891.83	2,300.00	0.15%	1,518,936.00	99.85%
西部利得中证 500 等权重指数分级 B	429	3,546.00	500.00	0.03%	1,520,736.00	99.97%
西部利得中证 500 等权重指数分级	879	294,264.78	252,560,417.58	97.64%	6,098,324.77	2.36%
合计	1,328	197,064.17	252,563,217.58	96.51%	9,137,996.77	3.49%

注：1. “持有人户数”合计数小于各份额级别持有人户数的总和，是由于一个持有人同时持有多个级别基金份额；

2. 分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末上市基金前十名持有人

西部利得中证 500 等权重指数分级 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	蔡小婉	352,600.00	23.18%
2	余晓敏	172,164.00	11.32%
3	朱俊峰	109,500.00	7.20%
4	李文刚	98,615.00	6.48%
5	王少男	96,050.00	6.31%
6	卢仕卫	81,916.00	5.38%
7	刘辉荣	79,300.00	5.21%
8	李惠莲	66,671.00	4.38%

9	李爱和	51,900.00	3.41%
10	秦建德	51,500.00	3.39%

西部利得中证 500 等权重指数分级 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	陈法基	320,023.00	21.04%
2	傅伟铮	180,000.00	11.83%
3	常一丹	84,400.00	5.55%
4	欧才	78,494.00	5.16%
5	王玉英	42,448.00	2.79%
6	林玉琴	34,070.00	2.24%
7	李秀莲	28,672.00	1.88%
8	高月娥	27,162.00	1.79%
9	黄健	25,000.00	1.64%
10	杨明	18,500.00	1.22%

西部利得中证 500 等权重指数分级

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	董景秋	500,000.00	33.20%
2	郭付元	98,625.00	6.55%
3	雷秀峰	85,800.00	5.70%
4	董万友	61,831.00	4.11%
5	曾亭曦	59,578.00	3.96%
6	曾子鹏	55,760.00	3.70%
7	谢丹萍	49,751.00	3.30%
8	王明辉	37,908.00	2.52%
9	王卓	32,506.00	2.16%
10	陈建红	31,449.00	2.09%

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	319,821.53	0.1236%
	合计	319,821.53	0.1236%

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	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	西部利得中证 500 等权重指数分级 A	0
	西部利得中证 500 等权重指数分级 B	0
	西部利得中证 500 等权重指数分级	0~10
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	西部利得中证 500 等权重指数 分级 A	西部利得中证 500 等权重指数 分级 B	西部利得中证 500 等权重指数 分级
基金合同生效日（2015 年 4 月 15 日）基金份额总额	-	-	202,990,676.07
本报告期期初基金份额总额	1,452,436.00	1,452,436.00	209,049,425.39
本报告期期间基金总申购份额	-	-	106,688,227.97
减:本报告期期间基金总赎回份额	-	-	64,329,418.51
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	68,800.00	68,800.00	7,250,507.50
本报告期期末基金份额总额	1,521,236.00	1,521,236.00	258,658,742.35

注：其中“总申购份额”含红利再投、转换入份额；“总赎回份额”含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开本基金份额持有人大会，无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人董事长兼法定代表人于 2019 年 3 月 8 日起正式变更为何方先生。
本报告期内基金托管人无重大人事变动。

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。

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			
海通证券	1	118,756,590.20	26.70%	63,095.61	24.26%	-
东兴证券	2	115,617,315.07	26.00%	59,096.91	22.72%	-
中信建投	2	41,441,224.83	9.32%	32,767.02	12.60%	-
华创证券	2	32,511,862.04	7.31%	10,770.94	4.14%	-
中泰证券	2	30,844,796.73	6.94%	25,641.13	9.86%	-
招商证券	2	29,527,711.37	6.64%	21,593.68	8.30%	-
广发证券	1	24,636,723.58	5.54%	18,016.81	6.93%	-
光大证券	2	20,558,065.65	4.62%	16,267.80	6.25%	-
太平洋证券	2	15,858,616.08	3.57%	10,011.39	3.85%	-
银河证券	2	14,433,949.34	3.25%	2,328.31	0.90%	-
申万宏源	2	567,000.00	0.13%	528.05	0.20%	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-

注：1. 基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资力雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
海通证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	2,009,849.86	40.02%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华创证券	3,012,751.23	59.98%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

本报告期内本基金未发生其他重大事件。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	>6 个月	202,019,373.16	-	47,957,806.67	154,061,566.49	58.87%
	2	3-6 个月	-	63,725,465.21	-	63,725,465.21	24.35%
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

2019 年 8 月 24 日