

西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金  
（LOF）证券投资基金（原西部利得中  
证 500 等权重指数分级证券投资基金转型）  
2020 年中期报告

2020 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：二〇二〇年八月三十一日

## § 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 2020 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

本基金于 2020 年 2 月 19 日起由原“西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金”正式转型为“西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)”，特此提示。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况 (转型后) .....	6
2.1 基金基本情况 (转型前) .....	6
2.2 基金产品说明 (转型后) .....	7
2.2 基金产品说明 (转型前) .....	7
2.3 基金管理人和基金托管人.....	9
2.4 信息披露方式.....	9
2.5 其他相关资料.....	9
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>10</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	10
3.2 基金净值表现 (转型后) .....	11
3.2 基金净值表现 (转型前) .....	13
3.3 其他指标.....	14
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>15</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	15
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	16
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 .....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	18
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 .....	18
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>19</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	19
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 .....	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	19
<b>§6 半年度财务会计报告 (未经审计) (转型后)</b> .....	<b>20</b>
6.1 资产负债表.....	20
6.2 利润表.....	21
6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表.....	22
6.4 报表附注.....	23
6.3.....	23
6.4.....	23
<b>§6 半年度财务会计报告 (未经审计) (转型前)</b> .....	<b>47</b>
6.1 资产负债表.....	47
6.2 利润表.....	48
6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表.....	49
6.4 报表附注.....	50
<b>§7 投资组合报告 (转型后)</b> .....	<b>73</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	73

7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	73
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 .....	75
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	81
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	82
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 .....	83
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 .....	83
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 .....	83
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 .....	83
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	83
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	83
7.12 投资组合报告附注 .....	83
<b>§7 投资组合报告 (转型前) .....</b>	<b>85</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	85
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	85
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 .....	87
7.3 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	95
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	97
7.5 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 .....	97
7.6 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 .....	97
7.7 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 .....	97
7.8 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 .....	97
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	97
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	97
7.11 投资组合报告附注 .....	98
<b>§8 基金份额持有人信息 (转型后) .....</b>	<b>100</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	100
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	100
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	101
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 .....	101
<b>§8 基金份额持有人信息 (转型前) .....</b>	<b>102</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	102
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	102
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	103
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 .....	103
<b>§9 开放式基金份额变动(转型后) .....</b>	<b>104</b>
<b>§9 开放式基金份额变动(转型前) .....</b>	<b>105</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>106</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	106
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 .....	106
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	106
10.4 基金投资策略的改变 .....	106
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	106
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 .....	106
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型后) .....	106
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前) .....	108

10.9 其他重大事件 (转型后) .....	110
10.9 其他重大事件 (转型前) .....	110
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>111</b>
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 .....	111
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	111
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>113</b>
12.1 备查文件目录.....	113
12.2 存放地点.....	113
12.3 查阅方式.....	113

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况 (转型后)

基金名称	西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)	
基金简称	500 增强 LOF	
场内简称	500 增强 LOF	
基金主代码	502000	
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)	
基金合同生效日	2020 年 2 月 19 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	313,877,851.00 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所 (若有)	上海证券交易所	
上市日期 (若有)	2020 年 2 月 19 日	
下属分级基金的基金简称	西部利得中证 500 指数增强 A	西部利得中证 500 指数增强 C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	502000	009300
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	313,037,533.13 份	840,317.87 份

### 2.1 基金基本情况 (转型前)

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	西部中证利得 500 等权重指数分级		
场内简称	500 等权		
基金主代码	502000		
基金运作方式	上市契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 4 月 15 日		
基金管理人	西部利得基金管理有限公司		
基金托管人	兴业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	357,635,043.89 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所 (若有)	上海证券交易所		
上市日期 (若有)	2015 年 4 月 27 日		
下属分级基金的基金简称	西部利得中证 500 等权重指数分级 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
下属分级基金的场内简称	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的份额总额	0.00 份	0.00 份	357,635,043.89 份

## 2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，追求基金净值增长率与业绩比较基准之间跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，同时力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。	
投资策略	本基金 80%以上非现金资产投资于中证 500 指数成分股，维持高股票仓位，在有效复制标的指数、控制投资组合与业绩比较基准跟踪误差的基础上，兼顾安全边际以及业绩的成长性，以期获得相对于该指数的超额收益。	
业绩比较基准	本基金的标的指数为：中证 500 指数 本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*95%+商业银行活期存款利率（税后）*5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。 本基金为指数型基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。	
	西部利得中证 500 指数增强 A	西部利得中证 500 指数增强 C
下属分级基金的风险收益特征	-	-

## 2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	本基金采用指数化投资策略，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，追求对中证 500 等权重指数的有效跟踪。力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内，以分享中国经济的长期增长成果，实现基金资产的长期增值。
投资策略	<p>本基金主要采用完全复制法，按照在中证 500 等权重指数中的成份股的构成及其基准权重构建股票投资组合，以拟跟踪中证 500 等权重指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，使跟踪误差控制在限定的范围之内。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金管理人主要按照中证 500 等权重指数的成份股组成及</p>

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



风险收益特征 (若有)	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。		
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。	-

## 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	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、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

转型后

金额单位：人民币元

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	2020 年 2 月 19 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日	
	西部利得中证 500 指数增强 A	西部利得中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	16,604,177.13	115,607.56
本期利润	36,302,363.29	160,363.63
加权平均基金份额本期利润	0.1024	0.1335
本期加权平均净值利润率	12.87%	12.98%
本期基金份额净值增长率	13.09%	21.43%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2020 年 6 月 30 日	
期末可供分配利润	-154,262,279.76	-10,233.52
期末可供分配基金份额利润	-0.4928	-0.0122
期末基金资产净值	354,002,111.01	949,568.83
期末基金份额净值	1.1309	1.1300
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2020 年 6 月 30 日	
基金份额累计净值增长率	13.16%	21.43%

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）。

转型前

金额单位：人民币元

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 2 月 18 日	
本期已实现收益	12,343,828.45	
本期利润	15,450,687.95	
加权平均基金份额本期利润	0.0419	
本期加权平均净值利润率	4.04%	
本期基金份额净值增长率	4.37%	
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2020 年 2 月 18 日	
期末可供分配利润	-196,186,586.67	
期末可供分配基金份额利润	-0.5486	
期末基金资产净值	360,370,990.30	
期末基金份额净值	1.0077	
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2020 年 2 月 18 日	
基金份额累计净值增长率	-32.21%	

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 3.2 基金净值表现（转型后）

#### 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

西部利得中证 500 指数增强 A

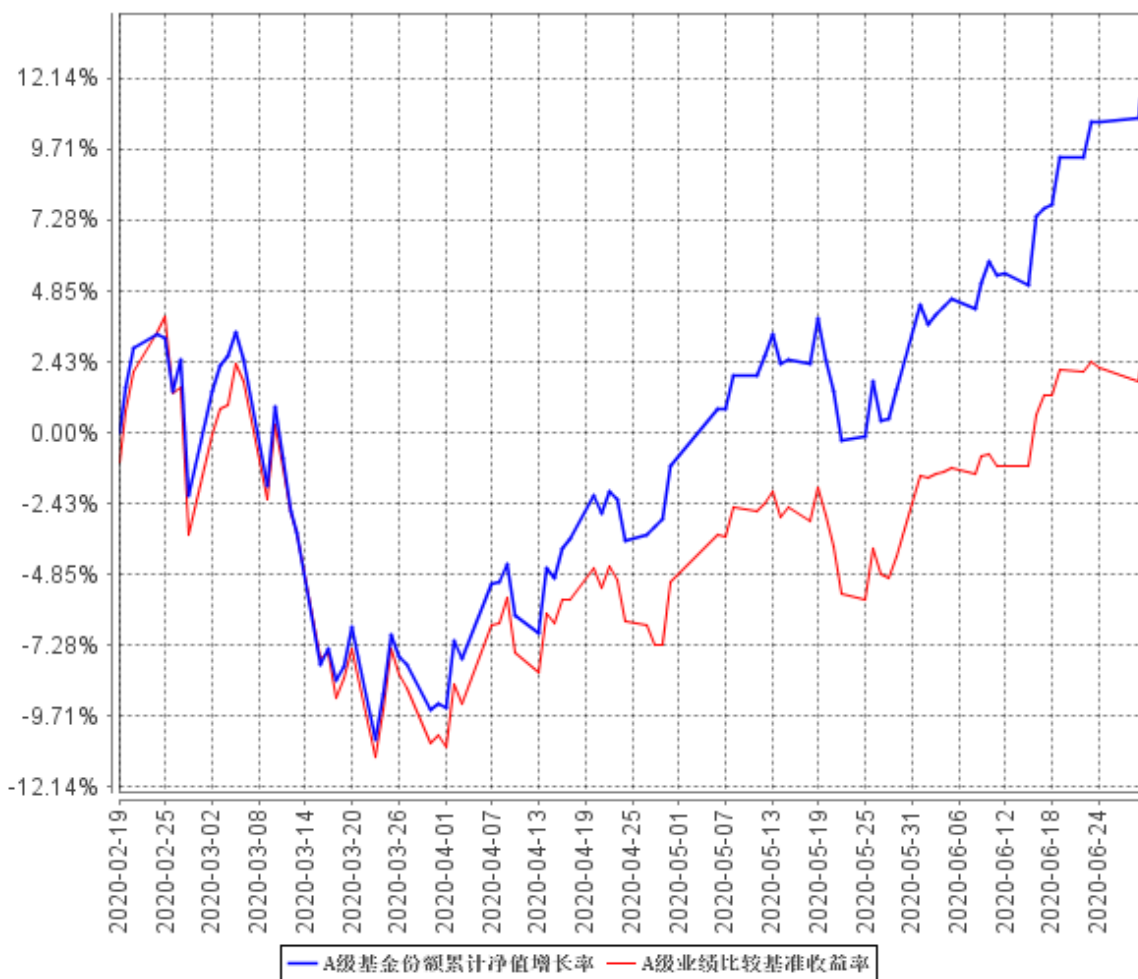
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	11.50%	0.96%	8.04%	0.84%	3.46%	0.12%
过去三个月	24.71%	1.11%	15.47%	1.08%	9.24%	0.03%
自基金合同生效起至今	13.16%	1.54%	3.48%	1.53%	9.68%	0.01%

西部利得中证 500 指数增强 C

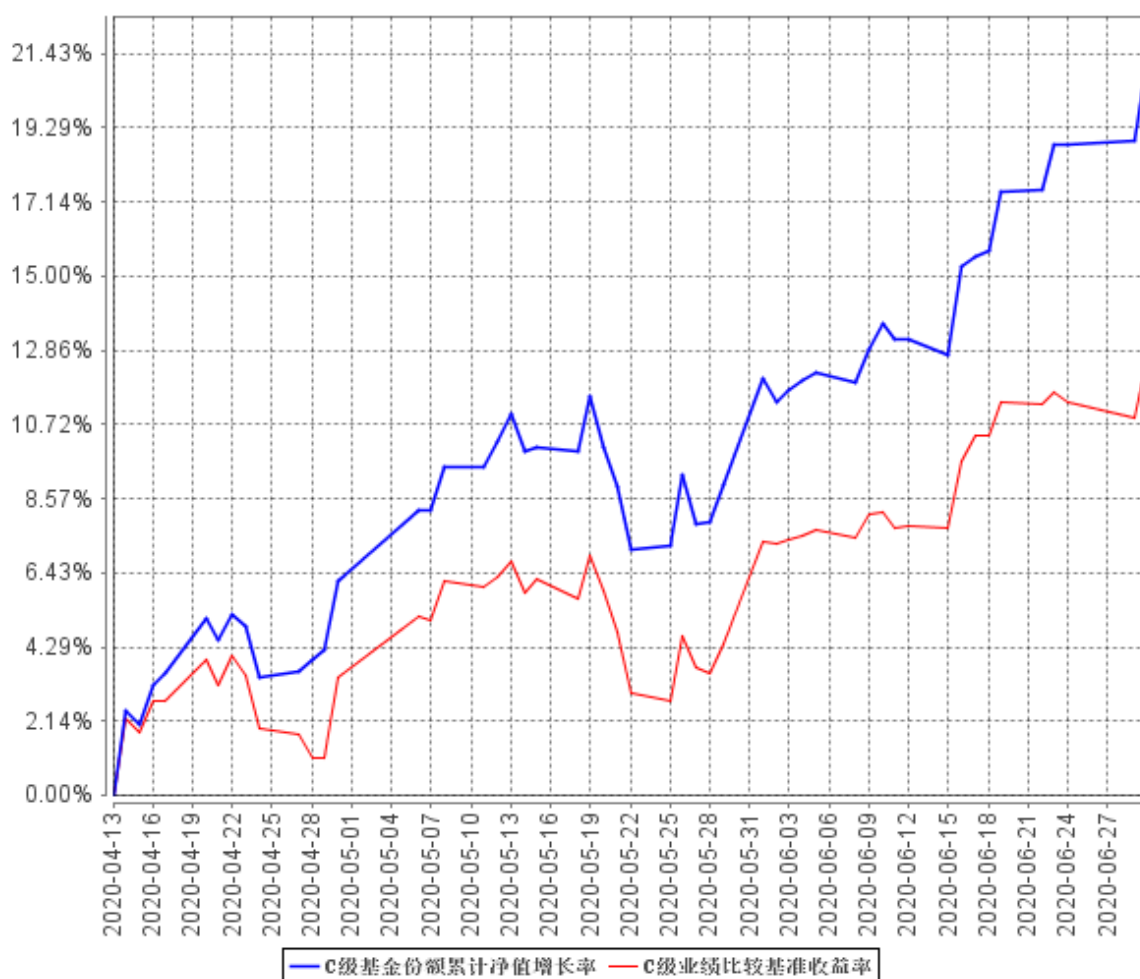
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	11.45%	0.96%	8.04%	0.84%	3.41%	0.12%
自基金合同生效起至今	21.43%	1.03%	11.95%	0.96%	9.48%	0.07%

### 3.2.2 自基金转型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

A级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



## C级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：本基金自 2020 年 2 月 19 日由股票分级类基金转型为指数增强型基金

### 3.2 基金净值表现（转型前）

#### 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	1.01%	2.36%	0.66%	2.74%	0.35%	-0.38%
过去三个月	13.00%	1.34%	12.15%	1.56%	0.85%	-0.22%
过去六个月	18.25%	1.13%	15.27%	1.32%	2.98%	-0.19%
过去一年	28.68%	1.30%	16.28%	1.52%	12.40%	-0.22%
过去三年	11.31%	1.19%	-15.05%	1.32%	26.36%	-0.13%
自基金合同生效起至今	-32.21%	1.62%	-29.14%	1.78%	-3.07%	-0.16%

### 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

西部中证利得500等权重指数分级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：本基金自 2020 年 2 月 19 日由股票分级类基金转型为指数增强型基金

### 3.3 其他指标

无

## § 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2020年6月30日，本基金管理人旗下共管理39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（转型后）

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	基金经理	2020年2月19日	-	7年	复旦大学计算机应用技术学硕士，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，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。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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	基金经理	2016年11月24日	-	7年	复旦大学计算机应用技术学硕士，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，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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

本报告期内，两两组合间单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为 0 的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

##### 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 2020 年半上年，国内外受到新冠疫情冲击后，国内复工复产进度喜人，经济 V 型反弹。A 股在 2 月初短暂下跌后走出了一波以成长股为核心的上涨行情。

投资策略上，本基金始终维持高股票仓位，风格偏成长，行业配置参考中证 500 指数。选股主要在卖方分析师覆盖的股票范围内，选股标准兼顾安全边际以及业绩的向上超预期，同时规避量价指标上显示出超买的个股以及临近解禁的个股，股票数量足够分散，以此弱化个股黑天鹅的影响。2019 年 7 月 22 日科创板鸣锣开板，本基金在基金规模满足科创板网下打新的要求后会增加科创板新股打新策略，以此增厚基金收益。本基金努力通过选股获得相对于中证 500 指数的超额收益，在接下去的投资管理中会坚持类似的投资风格。

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 2020 年三季度，影响 A 股的主要有三股力量。

其一是经济 V 型企稳+货币仍较为宽松的宏观背景。

年初受国内外疫情影响，中国经济下行压力变大、失业率高企。中国政府为了托底经济推出了一系列的政策，使得中国经济 3 月下旬得以 V 型复苏。虽然有阶段性区域疫情反弹带来扰动，但疫情在国内二次爆发概率不大，经济企稳的方向不变，复苏牛可期。在经济得以彻底复苏之前较为宽松的货币政策仍将持续一段时间。两者叠加对权益市场而言是较为友好的宏观背景。

其二上市公司盈利增速。

上市公司盈利增速是 A 股行业配置的重要参考指标。从总量上看，2020 年 Q1 上市公司盈利增速探底，此后逐季回升至 2021 年 Q1。从结构上看，世界进入后疫情时代，新经济、医药增速居前，一定程度上支撑着这些板块的高估值。盈利增速也是周期类行业的重要参考指标，一旦盈利增速变正，部分周期股的低估值或得以修复。

其三是美国大选将近。

美国大选可能造成中美关系出现一定波折，包括经贸领域、舆论领域、科技领域、区域争端等等，A 股市场的风险偏好随之扰动。

#### 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、适用性的情况，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部、研究部、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**

可参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

#### **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) (转型后)

## 6.1 资产负债表

会计主体: 西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)

报告截止日: 2020 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日
<b>资产:</b>		
银行存款	6.4.7.1	24,452,666.16
结算备付金		2,812,250.62
存出保证金		174,911.32
交易性金融资产	6.4.7.2	331,576,167.97
其中: 股票投资		331,576,167.97
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	6,036.68
应收股利		-
应收申购款		124,205.64
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	370.00
资产总计		359,146,608.39
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>
<b>负债:</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		3,050,645.50
应付赎回款		148,652.38
应付管理人报酬		257,383.92
应付托管费		51,476.78
应付销售服务费		408.53
应付交易费用	6.4.7.7	503,502.26
应交税费		17,958.71
应付利息		-

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	164,900.47
负债合计		4,194,928.55
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	458,270,338.33
未分配利润	6.4.7.10	-103,318,658.49
所有者权益合计		354,951,679.84
负债和所有者权益总计		359,146,608.39

注：1. 报告截止日 2020 年 06 月 30 日，西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) A 类份额净值 1.1309 元，A 类份额总额 313,037,533.13 份，C 类份额净值 1.1300 元，C 类份额总额 840,317.87 份。

2. 本基金为本报告期内基金合同生效的基金，无上年度末对比数据。本财务报表的实际编制期间为 2020 年 02 月 19 日(基金合同生效日)至 2020 年 06 月 30 日止期间。

## 6.2 利润表

会计主体：西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2020 年 2 月 19 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020年2月19日(基金合同生效日)至2020 年6月30日
<b>一、收入</b>		39,292,409.90
1. 利息收入		81,869.82
其中：存款利息收入	6.4.7.11	81,869.82
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		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		19,400,408.62
其中：股票投资收益	6.4.7.12	15,276,043.32
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	2,021,788.35
股利收益	6.4.7.16	2,102,576.95
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	19,742,942.23

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	67,189.23
<b>减: 二、费用</b>		2,829,682.98
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,103,474.59
2. 托管费	6.4.10.2.2	220,694.96
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,038.71
4. 交易费用	6.4.7.19	1,340,350.80
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	164,123.92
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		36,462,726.92
减: 所得税费用		-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		36,462,726.92

### 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 指数增强型证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2020 年 2 月 19 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2020 年 2 月 19 日 (基金合同生效日) 至 2020 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)	591,615,656.75	-202,508,979.17	389,106,677.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	51,913,414.87	51,913,414.87
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)	-133,345,318.42	47,276,905.81	-86,068,412.61
其中: 1. 基金申购款	252,592,499.20	-80,633,261.47	171,959,237.73
2. 基金赎回款 (以“-”号填列)	-385,937,817.62	127,910,167.28	-258,027,650.34
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)	458,270,338.33	-103,318,658.49	354,951,679.84

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>张峰骏</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 指数增强型证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”)是由西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金转型而来。原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《关于准予西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金的批复》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》和《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。原基金为契约型开放式基金,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,原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。

根据原基金的基金管理人西部利得基金管理有限公司于 2020 年 2 月 19 日发布的《西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同等法律文件生效的公告》,自 2020 年 2 月 19 日起,原基金更名为西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF),《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同》失效,《西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同》于同日生效。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。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》和《西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括标的指数的成分股、备选成分股、其他国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、国债、央行票据、金融债、地方政府债、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货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(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。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。

基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例不低于 80%,其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%;每个交易日日终在扣除股指期货合

约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更基金投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的标的指数为:中证 500 指数

本基金业绩比较基准为:中证 500 指数收益率\*95%+商业银行活期存款利率(税后)\*5%

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币,编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

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

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



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

## (2) 金融负债的分类

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

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

取得债券投资和资产支持证券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。债券投资和资产支持证券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资和资产支持证券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一估值日评估影子价格(即相关金融工具的公允价值)，以避免债券投资和资产支持证券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近

交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 6.4.4.7 实收基金

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

#### 6.4.4.8 损益平准金

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

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得

税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

本基金的交易费用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可以进行收益分配，具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减

去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 分部报告

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

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

### 6.4.6 税项

#### (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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	24,452,666.16
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：	24,452,666.16

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	298,804,581.50	331,576,167.97	32,771,586.47
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	298,804,581.50	331,576,167.97	32,771,586.47

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于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 2020年6月30日
应收活期存款利息	2,958.33
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	374.80
应收债券利息	-
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	2,624.85
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	78.70
合计	6,036.68

### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
其他应收款	370.00
待摊费用	-
合计	370.00

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	503,502.26
银行间市场应付交易费用	-
合计	503,502.26

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	529.85
预提费用	114,370.62
应付指数使用费	50,000.00
合计	164,900.47

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

西部利得中证 500 指数增强 A		
项目	本期 2020 年 2 月 19 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	357,635,043.89	522,605,646.22
基金份额折算调整	-	-
未领取红利份额折算调整	-	-
集中申购募集资金本金及利息	-	-
基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	169,628,136.23	247,867,169.65
本期赎回(以“-”号填列)	-214,225,646.99	-313,042,795.41
本期末	313,037,533.13	457,430,020.46

金额单位：人民币元

西部利得中证 500 指数增强 C		
项目	本期 2020 年 2 月 19 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	-	-
基金份额折算调整	-	-
未领取红利份额折算调整	-	-
集中申购募集资金本金及利息	-	-
基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	4,628,632.83	4,628,632.83
本期赎回(以“-”号填列)	-3,788,314.96	-3,788,314.96
本期末	840,317.87	840,317.87

## 6.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元



西部利得中证 500 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-196,186,586.67	33,951,930.75	-162,234,655.92
本期利润	16,604,177.13	19,698,186.16	36,302,363.29
本期基金份额交易产生的变动数	25,320,129.78	-2,815,746.60	22,504,383.18
其中：基金申购款	-92,167,160.14	11,465,997.60	-80,701,162.54
基金赎回款	117,487,289.92	-14,281,744.20	103,205,545.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-154,262,279.76	50,834,370.31	-103,427,909.45

金额单位：人民币元

西部利得中证 500 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	115,607.56	44,756.07	160,363.63
本期基金份额交易产生的变动数	-125,841.08	74,728.41	-51,112.67
其中：基金申购款	-306,922.72	407,542.13	100,619.41
基金赎回款	181,081.64	-332,813.72	-151,732.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-10,233.52	119,484.48	109,250.96

#### 6.4.7.11 存款利息收入

项目	本期
	2020 年 2 月 19 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	65,081.53
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	5,211.04
其他	11,577.25
合计	81,869.82

#### 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 2020 年 2 月 19 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	545,028,414.61
减: 卖出股票成本总额	529,752,371.29
买卖股票差价收入	15,276,043.32

### 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

本基金在本报告期内未有债券投资收益。

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金在本报告期内未有买卖债券差价收入。

#### 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

本基金于本报告期内未持有资产支持证券。

### 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

单位: 人民币元

项目	本期收益金额
	2020 年 2 月 19 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	2,021,788.35

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 2 月 19 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,102,576.95
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,102,576.95

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020 年 2 月 19 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	19,742,942.23
——股票投资	19,742,942.23
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	19,742,942.23

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 2 月 19 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	67,189.23

合计	67,189.23
----	-----------

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 2020 年 2 月 19 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,340,350.80
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	1,340,350.80

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 2 月 19 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	18,169.13
信息披露费	43,606.71
上市费用	21,802.69
指数使用费	73,076.95
银行汇划费用	190.00
其他	7,278.44
合计	164,123.92

#### 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
西部证券股份有限公司	基金管理人的股东
利得科技有限公司	基金管理人的股东
兴业银行股份有限公司	基金托管人

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

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股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

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

本基金于本报告期内及上年度期内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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

### 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
	2020 年 2 月 19 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,103,474.59
其中：支付销售机构的客户维护费	40,134.73

注：支付基金管理人西部利得基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.00% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 2 月 19 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	220,694.96

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 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2020 年 2 月 19 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	西部利得中证 500 指数增强 A	西部利得中证 500 指数增强 C	合计
兴业银行	-	-	-
西部利得基金	-	0.76	0.76
西部证券	-	36.32	36.32
合计	-	37.08	37.08

注：1. 支付基金销售机构的销售服务费：

按前一日 C 类基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给西部利得基金，再由西部利得基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

2. 本基金无上年可比数据。

### 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

本基金本报告期及上年度可比期间未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 2020 年 2 月 19 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	24,452,666.16	65,081.53

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 2020 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 24,452,666.16 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****6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2020 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	说明
688568	中科星图	2020年6月30日	2020年7月8日	新股流通受限	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	-
688377	迪威尔	2020年6月29日	2020年7月8日	新股流通受限	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688027	国盾量子	2020年6月30日	2020年7月9日	新股流通受限	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688600	皖仪科技	2020年6月23日	2020年7月3日	新股流通受限	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-
300847	中船汉光	2020年6月29日	2020年7月9日	新股流通受限	6.94	6.94	1,420	9,854.80	9,854.80	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新股流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新股流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新股流通受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新股流通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-



			日							
688157	松井股份	2020年5月29日	2020年12月9日	网下配售摇号锁定	34.48	86.64	3,402	117,300.96	294,749.28	-
688466	金科环境	2020年4月27日	2020年11月8日	网下配售摇号锁定	24.61	36.59	4,907	120,761.27	179,547.13	-
688558	国盛智科	2020年6月19日	2020年12月30日	网下配售摇号锁定	17.37	35.26	8,488	147,436.56	299,286.88	-

#### 6.4.12.17 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。

#### 6.4.12.18 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.18.1 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。

##### 6.4.12.18.2 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

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括信用风险、流动性风险、市场风险等。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人实行全员参与的全面风险管理，董事会及其下设合规审核委员会、监事会、经营管理层及其下设合规及风险管理委员会、督察长、风险管理部、监察稽核部、各业务部门和分支机构均根据公司制度规定履行各自的风险管理职责。

##### 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。

本基金均投资于具有良好信用等级的证券；银行存款均存放于信用良好的银行；在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.3 流动性风险

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 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。

##### 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

本期末 2020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	24,452,666.16	-	-	-	24,452,666.16
结算备付金	2,812,250.62	-	-	-	2,812,250.62
存出保证金	174,911.32	-	-	-	174,911.32
交易性金融资产	-	-	-	331,576,167.97	331,576,167.97
应收利息	-	-	-	6,036.68	6,036.68
应收申购款	-	-	-	124,205.64	124,205.64
其他资产	370.00	-	-	-	370.00
资产总计	27440198.10	-	-	331,706,410.29	359,146,608.39
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,050,645.50	3,050,645.50
应付赎回款	-	-	-	148,652.38	148,652.38
应付管理人报酬	-	-	-	257,383.92	257,383.92
应付托管费	-	-	-	51,476.78	51,476.78
应付销售服务费	-	-	-	408.53	408.53
应付交易费用	-	-	-	503,502.26	503,502.26
应交税费	-	-	-	17,958.71	17,958.71
其他负债	-	-	-	164,900.47	164,900.47
负债总计	-	-	-	4,194,928.55	4,194,928.55
利率敏感度缺口	27440198.10	-	-	-327,511,481.74	354,951,679.84

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 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 2020年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	331,576,167.97	93.41
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	331,576,167.97	93.41

**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 (2020 年 6 月 30 日)
	业绩比较基准上升 5%	17,066,935.00
	业绩比较基准下降 5%	-17,066,935.00

**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) 各层级金融工具公允价值

于 2020 年 06 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 331044262.11 元, 属于第二层级的余额为 531905.86 元, 无属于第三层级的余额(2019 年 12 月 31 日: 第一层级 366436879.77 元, 第二层级 7774251.43 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将相关股票和债券的公允价值列入第一层级; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

## (iii) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

## (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 06 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(2019 年 06 月 30 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。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

### 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：2020 年 2 月 18 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 2 月 18 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	27,490,070.78	45,723,770.36
结算备付金		664,820.88	526,894.10
存出保证金		99,950.76	85,631.97
交易性金融资产	6.4.7.2	331,505,048.62	374,211,131.20
其中：股票投资		331,505,048.62	369,208,131.20
基金投资		-	-
债券投资		-	5,003,000.00
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		1,061,778.79	-
应收利息	6.4.7.5	69,576.95	121,382.50
应收股利		-	-
应收申购款		-	48,666.53
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	370.00	370.00
资产总计		360,891,616.78	420,717,846.66
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 2 月 18 日</b>	<b>上年度末 2019 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	30,664,613.45
应付赎回款		-	105,278.18
应付管理人报酬		176,493.34	293,425.09
应付托管费		35,298.68	58,685.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	151,119.32	268,795.25
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	157,715.14	220,372.10
负债合计		520,626.48	31,611,169.08
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	522,605,646.22	591,615,656.75
未分配利润	6.4.7.10	-162,234,655.92	-202,508,979.17
所有者权益合计		360,370,990.30	389,106,677.58
负债和所有者权益总计		360,891,616.78	420,717,846.66

注：1. 报告截止日 2020 年 02 月 18 日，西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金份额净值 1.0077 元，基金份额总额 357,635,043.89 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 2 月 18 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 2 月 18 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		16,517,430.98	48,630,456.24
1. 利息收入		63,694.45	149,733.74
其中：存款利息收入	6.4.7.11	58,631.44	99,200.58
债券利息收入		5,063.01	50,533.16
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）		13,291,573.17	20,667,400.90
其中：股票投资收益	6.4.7.12	13,317,533.68	18,512,600.22
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	3,600.00	7,500.00
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	-29,560.51	2,147,300.68
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,106,859.50	27,797,804.47
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	55,303.86	15,517.13
<b>减：二、费用</b>		1,066,743.03	1,959,043.77
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	513,667.59	1,028,987.39



2. 托管费	6.4.10.2.2	102,733.56	205,797.52
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	0.00	-
4. 交易费用	6.4.7.19	362,451.74	511,740.91
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	87,890.14	212,517.95
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		15,450,687.95	46,671,412.47
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		15,450,687.95	46,671,412.47

### 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: 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 2 月 18 日

单位: 人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 2 月 18 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)	591,615,656.75	-202,508,979.17	389,106,677.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	15,450,687.95	15,450,687.95
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)	-69,010,010.53	24,823,635.30	-44,186,375.23
其中: 1. 基金申购款	96,696.72	-32,718.34	63,978.38
2. 基金赎回款	-69,106,707.25	24,856,353.64	-44,250,353.61
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)	522,605,646.22	-162,234,655.92	360,370,990.30
项目	上年度可比期间 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)	337,255,607.58	-178,749,581.26	158,506,026.32



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）。

本基金的投资组合比例为：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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等，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。

本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证 500 等权重指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行人民币活期存款利率（税后）}$ 。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 2 月 18 日财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 2 月 18 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 2 月 18 日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

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

和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

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

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

#### (2) 金融负债的分类

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

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时,于资产负债表内确认。

取得债券投资和资产支持证券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。债券投资和资产支持证券投资采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量,即债券投资和资产支持证券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息,按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价;同时于每一估值日评估影子价格(即相关金融工具的公允价值),以避免债券投资和资产支持证券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时,本基金终止确认该金融资产:

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;
- 该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;
- 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外,本基金按下述原则计量公允价值:

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 6.4.4.7 实收基金

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

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金

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

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可以进行收益分配，具体分红方案见基金管

理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 分部报告

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

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”),在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

## 6.4.6 税项

### (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 2020 年 2 月 18 日
活期存款	27,490,070.78
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:	27,490,070.78

注: 定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 2 月 18 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	318,476,404.38	331,505,048.62	13,028,644.24
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	318,476,404.38	331,505,048.62	13,028,644.24

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于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 2020 年 2 月 18 日
应收活期存款利息	64,710.29
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,920.23
应收债券利息	-
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	2,699.92
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	246.51
合计	69,576.95

**6.4.7.6 其他资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2020年2月18日
其他应收款	370.00
待摊费用	-
合计	370.00

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2020年2月18日
交易所市场应付交易费用	151,119.32
银行间市场应付交易费用	-
合计	151,119.32

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2020年2月18日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	80,792.09
应付指数使用费	76,923.05
合计	157,715.14

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年2月18日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	384,776,067.33	591,615,656.75
本期申购	18,926,012.21	96,696.72
本期赎回(以“-”号填列)	-46,067,035.65	-69,106,707.25
- 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	357,635,043.89	522,605,646.22

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	-234,601,678.09	32,092,698.92	-202,508,979.17
本期利润	12,343,828.45	3,106,859.50	15,450,687.95
本期基金份额交易产生的变动数	26,071,262.97	-1,247,627.67	24,823,635.30
其中：基金申购款	-38,301.21	5,582.87	-32,718.34
基金赎回款	26,109,564.18	-1,253,210.54	24,856,353.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-196,186,586.67	33,951,930.75	-162,234,655.92

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年2月18日
活期存款利息收入	55,417.90
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	1,659.42
其他	1,554.12
合计	58,631.44

#### 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 2020年1月1日至2020年2月18日
卖出股票成交总额	162,799,529.85
减：卖出股票成本总额	149,481,996.17
买卖股票差价收入	13,317,533.68

### 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 2020年1月1日至2020年2月18日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	3,600.00
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	3,600.00

#### 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 2020年1月1日至2020年2月18日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交金额	5,115,500.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,996,400.00
减：应收利息总额	115,500.00
买卖债券差价收入	3,600.00

#### 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

本基金于本报告期内未持有资产支持证券。

### 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 2 月 18 日
股票投资产生的股利收益	-29,560.51
基金投资产生的股利收益	-
合计	-29,560.51

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 2 月 18 日
1. 交易性金融资产	3,106,859.50
——股票投资	3,113,459.50
——债券投资	-6,600.00
——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	3,106,859.50

### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 2 月 18 日
基金赎回费收入	55,303.86
合计	55,303.86

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
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 2 月 18 日
交易所市场交易费用	362,451.74
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	362,451.74

### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 2 月 18 日
审计费用	6,693.89
信息披露费	16,065.63
其他	30,000.00
上市费用	8,032.57
指数使用费	26,923.05
银行汇划费用	175.00
合计	87,890.14

### 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
西部证券股份有限公司	基金管理人的股东
利得科技有限公司	基金管理人的股东
兴业银行股份有限公司	基金托管人

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

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股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

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

本基金于本报告期内及上年度期内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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

#### 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 2020年1月1日至2020年2 月18日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	513,667.59	1,028,987.39
其中：支付销售机构的客户维护费 <sup>1</sup>	14,473.13	6,324.99

注：支付基金管理人西部利得基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年2 月18日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	102,733.56	205,797.52

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 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

转型前本基金于本报告期内及上年度可比期间未发生应支付关联方的销售服务费。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未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	
	2020年1月1日至2020年2月18日		2019年1月1日至2019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	27,490,070.78	55,417.90	10,908,039.90	90,904.93

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2020年2月18日的相关余额为人民币27,490,070.78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

##### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2020年2月18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	说明	
688169	石头科技	2020年2月13日	2020年2月21日	新股流通受限	271.12	271.12	2,637	714,943.44	714,943.44	-	
688177	百奥	2020年2月	2020年	新股流通	32.76	32.76	15,603	511,154.28	511,154.28	-	

	泰	月 13 日	2 月 21 日	受限							
688396	华润微	2020 年 2 月 14 日	2020 年 2 月 27 日	新股流通受限	12.80	12.80	31,330	401,024.00	401,024.00		-
688233	神工股份	2020 年 2 月 13 日	2020 年 2 月 21 日	新股流通受限	21.67	21.67	11,858	256,962.86	256,962.86		-
601696	中银证券	2020 年 2 月 17 日	2020 年 2 月 26 日	新股流通受限	5.47	5.47	8,373	45,800.31	45,800.31		-
601916	浙商银行	2019 年 11 月 18 日	2020 年 5 月 26 日	IPO 老股转让受限	4.94	4.16	294,195	1,453,323.30	1,223,851.20		-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

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

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括信用风险、流动性风险、市场风险等。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人实行全员参与的全面风险管理，董事会及其下设合规审核委员会、监事会、经营管理层及其下设合规及风险管理委员会、督察长、风险管理部、监察稽核部、各业务部门和分支机构均根据公司制度规定履行各自的风险管理职责。

##### 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。

本基金均投资于具有良好信用等级的证券；银行存款均存放于信用良好的银行；在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

### 6.4.13.3 流动性风险

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### **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。

##### **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

金额单位：人民币元

本期末 2020 年 2 月 18 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	27,490,070.78	-	-	-	27,490,070.78
结算备付金	664,820.88	-	-	-	664,820.88
存出保证金	99,950.76	-	-	-	99,950.76
交易性金融资产	-	-	-	331,505,048.62	331,505,048.62
应收证券清算款	-	-	-	1,061,778.79	1,061,778.79
应收利息	-	-	-	69,576.95	69,576.95
其他资产	370.00	-	-	-	370.00
资产总计	28255212.42	-	-	332636404.36	360,891,616.78
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	176,493.34	176,493.34
应付托管费	-	-	-	35,298.68	35,298.68
应付交易费用	-	-	-	151,119.32	151,119.32
其他负债	-	-	-	157,715.14	157,715.14
负债总计	-	-	-	520,626.48	520,626.48
利率敏感度缺口	28255212.42	-	-	332115777.88	360,370,990.30
上年度末 2019 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	45723770.36	-	-	-	45,723,770.36
结算备付金	526894.10	-	-	-	526,894.10
存出保证金	85631.97	-	-	-	85,631.97
交易性金融资产	5003000.00	-	-	369,208,131.20	374,211,131.20
应收利息	-	-	-	121,382.50	121,382.50
应收申购款	-	-	-	48,666.53	48,666.53
其他资产	370.00	-	-	-	370.00
资产总计	51339666.43	-	-	369,378,180.23	420,717,846.66
负债					
应付证券清算款	-	-	-	30,664,613.45	30,664,613.45
应付赎回款	-	-	-	105,278.18	105,278.18
应付管理人报酬	-	-	-	293,425.09	293,425.09
应付托管费	-	-	-	58,685.01	58,685.01
应付交易费用	-	-	-	268,795.25	268,795.25
其他负债	-	-	-	220,372.10	220,372.10
负债总计	-	-	-	31,611,169.08	31,611,169.08
利率敏感度缺口	51339666.43	-	-	337,767,011.15	389,106,677.58

#### 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，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 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 2020年2月18日		上年度末 2019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	331,505,048.62	91.99	369,208,131.20	94.89
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	5,003,000.00	1.29
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	331,505,048.62	91.99	374,211,131.20	96.17

##### 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（2020年2月18日）	上年度末（2019年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	15,939,564.00	7,060,000.00
业绩比较基准下降 5%	-15,939,564.00	-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 2020 年 2 月 18 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 330571321.12 元，属于第二层次的余额为 933727.50 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层级 366436879.77 元，第二层级 7774251.43 元，无属于第三层级的余额)。

## (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不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或第三层次。

## (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 2020 年 2 月 18 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 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 (转型后)

### 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	331,576,167.97	92.32
	其中：股票	331,576,167.97	92.32
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	27,264,916.78	7.59
8	其他各项资产	305,523.64	0.09
9	合计	359,146,608.39	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	3,170,090.00	0.89
B	采矿业	4,339,370.00	1.22
C	制造业	183,017,630.01	51.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,133,790.00	1.16
E	建筑业	5,844,455.50	1.65
F	批发和零售业	7,338,190.20	2.07
G	交通运输、仓储和邮政业	5,091,723.28	1.43
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,421,360.08	7.73
J	金融业	13,705,280.01	3.86
K	房地产业	6,343,316.20	1.79
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,586,728.00	0.45

N	水利、环境和公共设施管理业	4,683,519.20	1.32
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,114,600.00	0.88
R	文化、体育和娱乐业	2,918,244.00	0.82
S	综合	-	-
	合计	272,708,296.48	76.83

## 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	794,580.00	0.22
B	采矿业	-	-
C	制造业	36,149,056.85	10.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	609,930.00	0.17
F	批发和零售业	1,717,647.00	0.48
G	交通运输、仓储和邮政业	820,500.00	0.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,164,321.77	2.30
J	金融业	1,490,734.00	0.42
K	房地产业	2,907,040.00	0.82
L	租赁和商务服务业	741,924.00	0.21
M	科学研究和技术服务业	1,521,360.00	0.43
N	水利、环境和公共设施管理业	1,676,551.13	0.47
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,261,460.42	0.64
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	58,867,871.49	16.58

## 7.2.1 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	300285	国瓷材料	154,556	5,179,171.56	1.46
2	603444	吉比特	9,200	5,050,892.00	1.42
3	300482	万孚生物	46,800	4,867,200.00	1.37
4	600201	生物股份	173,950	4,842,768.00	1.36
5	002138	顺络电子	180,100	4,493,495.00	1.27
6	002920	德赛西威	72,200	4,428,026.00	1.25
7	002414	高德红外	148,920	4,360,377.60	1.23
8	000513	丽珠集团	90,719	4,355,419.19	1.23
9	002373	千方科技	178,100	4,272,619.00	1.20
10	603233	大参林	51,260	4,163,337.20	1.17
11	600521	华海药业	121,770	4,131,656.10	1.16
12	600298	安琪酵母	83,306	4,121,980.88	1.16
13	002028	思源电气	198,600	4,063,356.00	1.14
14	300088	长信科技	359,539	4,026,836.80	1.13
15	603338	浙江鼎力	52,038	3,942,919.26	1.11
16	601799	星宇股份	30,900	3,924,300.00	1.11
17	002223	鱼跃医疗	107,500	3,913,000.00	1.10
18	002353	杰瑞股份	123,300	3,822,300.00	1.08
19	600195	中牧股份	228,700	3,711,801.00	1.05
20	600862	中航高科	214,000	3,620,880.00	1.02
21	000547	航天发展	264,700	3,618,449.00	1.02
22	600801	华新水泥	151,764	3,598,324.44	1.01
23	002709	天赐材料	106,044	3,583,226.76	1.01
24	600845	宝信软件	60,400	3,568,432.00	1.01
25	603228	景旺电子	101,384	3,567,702.96	1.01
26	600426	华鲁恒升	199,145	3,520,883.60	0.99
27	600315	上海家化	73,400	3,515,860.00	0.99
28	002408	齐翔腾达	565,800	3,513,618.00	0.99
29	000750	国海证券	796,100	3,455,074.00	0.97
30	600380	健康元	208,800	3,390,912.00	0.96
31	603568	伟明环保	143,531	3,329,919.20	0.94
32	603317	天味食品	59,754	3,321,127.32	0.94
33	600125	铁龙物流	592,800	3,307,824.00	0.93

34	603000	人民网	164,776	3,267,508.08	0.92
35	002901	大博医疗	27,100	3,232,759.00	0.91
36	600598	北大荒	196,900	3,170,090.00	0.89
37	603882	金域医学	34,800	3,114,600.00	0.88
38	000807	云铝股份	707,900	3,086,444.00	0.87
39	601615	明阳智能	245,500	3,056,475.00	0.86
40	601717	郑煤机	517,300	3,046,897.00	0.86
41	300357	我武生物	47,100	2,931,975.00	0.83
42	300212	易华录	51,275	2,871,400.00	0.81
43	002244	滨江集团	652,200	2,784,894.00	0.78
44	002273	水晶光电	159,501	2,733,847.14	0.77
45	000090	天健集团	381,350	2,635,128.50	0.74
46	603712	七一二	67,800	2,602,164.00	0.73
47	002075	沙钢股份	200,300	2,503,750.00	0.71
48	000686	东北证券	281,700	2,380,365.00	0.67
49	002174	游族网络	90,900	2,370,672.00	0.67
50	600597	光明乳业	159,167	2,365,221.62	0.67
51	603939	益丰药房	25,843	2,351,713.00	0.66
52	002128	露天煤业	301,600	2,337,400.00	0.66
53	603806	福斯特	45,335	2,262,669.85	0.64
54	000932	华菱钢铁	583,200	2,198,664.00	0.62
55	600216	浙江医药	110,600	2,130,156.00	0.60
56	300316	晶盛机电	84,500	2,090,530.00	0.59
57	002233	塔牌集团	171,826	2,067,066.78	0.58
58	002013	中航机电	253,100	1,999,490.00	0.56
59	300558	贝达药业	14,064	1,968,678.72	0.55
60	600325	华发股份	277,100	1,956,326.00	0.55
61	603866	桃李面包	38,100	1,938,909.00	0.55
62	601099	太平洋	611,600	1,938,772.00	0.55
63	002439	启明星辰	45,800	1,926,806.00	0.54
64	600132	重庆啤酒	26,000	1,898,000.00	0.53
65	002385	大北农	206,500	1,881,215.00	0.53
66	002583	海能达	239,200	1,815,528.00	0.51
67	000400	许继电气	137,000	1,808,400.00	0.51
68	600039	四川路桥	448,300	1,712,506.00	0.48
69	002019	亿帆医药	73,600	1,690,592.00	0.48
70	600875	东方电气	185,300	1,639,905.00	0.46
71	300012	华测检测	80,300	1,586,728.00	0.45
72	002511	中顺洁柔	70,400	1,569,920.00	0.44

73	601966	玲珑轮胎	77,300	1,561,460.00	0.44
74	300133	华策影视	209,500	1,518,875.00	0.43
75	002867	周大生	62,800	1,392,276.00	0.39
76	000600	建投能源	273,100	1,390,079.00	0.39
77	603605	珀莱雅	7,646	1,376,432.92	0.39
78	600079	人福医药	50,400	1,371,888.00	0.39
79	601200	上海环境	112,800	1,353,600.00	0.38
80	601128	常熟银行	174,568	1,311,005.68	0.37
81	000712	锦龙股份	103,499	1,293,737.50	0.36
82	600507	方大特钢	242,729	1,259,763.51	0.35
83	600633	浙数文化	126,100	1,233,258.00	0.35
84	000975	银泰黄金	76,400	1,197,952.00	0.34
85	600486	扬农化工	14,400	1,188,000.00	0.33
86	600779	水井坊	18,700	1,167,254.00	0.33
87	600466	蓝光发展	206,780	1,114,544.20	0.31
88	600167	联美控股	75,900	1,088,406.00	0.31
89	600373	中文传媒	90,200	1,062,556.00	0.30
90	002507	涪陵榨菜	27,900	1,004,679.00	0.28
91	002648	卫星石化	60,600	985,962.00	0.28
92	300115	长盈精密	42,900	980,265.00	0.28
93	002500	山西证券	146,100	955,494.00	0.27
94	002212	南洋股份	35,400	940,932.00	0.27
95	002572	索菲亚	38,000	918,460.00	0.26
96	600970	中材国际	172,950	913,176.00	0.26
97	300274	阳光电源	63,400	912,326.00	0.26
98	601689	拓普集团	30,700	856,530.00	0.24
99	603707	健友股份	13,200	852,324.00	0.24
100	002815	崇达技术	41,800	845,614.00	0.24
101	603659	璞泰来	8,200	844,764.00	0.24
102	601233	桐昆股份	65,200	831,952.00	0.23
103	601958	金钼股份	130,100	804,018.00	0.23
104	600804	鹏博士	88,100	791,138.00	0.22
105	002419	天虹股份	81,900	782,145.00	0.22
106	000883	湖北能源	217,500	765,600.00	0.22
107	600060	海信视像	61,400	746,010.00	0.21
108	600908	无锡银行	147,913	726,252.83	0.20
109	000997	新大陆	44,600	712,708.00	0.20
110	600643	爱建集团	89,620	712,479.00	0.20
111	300618	寒锐钴业	10,400	645,008.00	0.18

112	000739	普洛药业	27,000	628,830.00	0.18
113	002839	张家港行	102,600	590,976.00	0.17
114	600820	隧道股份	103,300	583,645.00	0.16
115	600350	山东高速	90,300	554,442.00	0.16
116	300017	网宿科技	63,900	542,511.00	0.15
117	000089	深圳机场	67,400	516,284.00	0.15
118	600549	厦门钨业	42,900	507,936.00	0.14
119	603816	顾家家居	11,200	504,112.00	0.14
120	600376	首开股份	83,200	487,552.00	0.14
121	600863	内蒙华电	193,600	476,256.00	0.13
122	002831	裕同科技	17,200	473,172.00	0.13
123	600728	佳都科技	51,900	472,809.00	0.13
124	000050	深天马 A	30,000	460,800.00	0.13
125	002078	太阳纸业	47,500	452,200.00	0.13
126	600008	首创股份	134,900	406,049.00	0.11
127	000581	威孚高科	19,100	394,988.00	0.11
128	600026	中远海能	56,500	364,990.00	0.10
129	601000	唐山港	156,136	348,183.28	0.10
130	002807	江阴银行	86,800	341,124.00	0.10
131	000156	华数传媒	31,100	336,813.00	0.09
132	603198	迎驾贡酒	15,000	326,550.00	0.09
133	603486	科沃斯	10,700	323,247.00	0.09
134	000717	韶钢松山	76,800	291,840.00	0.08
135	300459	金科文化	79,300	273,585.00	0.08
136	600996	贵广网络	9,400	67,022.00	0.02
137	600859	王府井	900	40,995.00	0.01
138	603983	丸美股份	200	17,206.00	0.00
139	600021	上海电力	1,000	7,400.00	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	600745	闻泰科技	14,100	1,775,895.00	0.50
2	601231	环旭电子	76,300	1,666,392.00	0.47
3	002410	广联达	15,600	1,087,320.00	0.31
4	002475	立讯精密	20,929	1,074,704.15	0.30
5	002697	红旗连锁	94,100	1,027,572.00	0.29

6	600459	贵研铂业	32,300	962,863.00	0.27
7	300136	信维通信	17,700	938,454.00	0.26
8	300725	药石科技	7,500	931,875.00	0.26
9	000157	中联重科	142,900	918,847.00	0.26
10	688202	美迪西	6,600	912,780.00	0.26
11	300124	汇川技术	23,800	904,162.00	0.25
12	601788	光大证券	55,700	894,542.00	0.25
13	688111	金山办公	2,600	888,108.00	0.25
14	688196	卓越新能	16,800	879,648.00	0.25
15	300408	三环集团	31,500	872,550.00	0.25
16	600323	瀚蓝环境	39,700	868,636.00	0.24
17	300031	宝通科技	34,600	866,384.00	0.24
18	300373	扬杰科技	25,800	864,816.00	0.24
19	002594	比亚迪	12,000	861,600.00	0.24
20	600763	通策医疗	5,146	858,198.42	0.24
21	002950	奥美医疗	30,200	857,076.00	0.24
22	300347	泰格医药	8,400	855,792.00	0.24
23	002216	三全食品	35,500	848,450.00	0.24
24	600584	长电科技	27,100	847,417.00	0.24
25	002230	科大讯飞	22,400	838,432.00	0.24
26	002241	歌尔股份	28,500	836,760.00	0.24
27	002126	银轮股份	67,900	831,096.00	0.23
28	002481	双塔食品	47,500	822,700.00	0.23
29	002352	顺丰控股	15,000	820,500.00	0.23
30	000961	中南建设	91,500	814,350.00	0.23
31	603019	中科曙光	21,000	806,400.00	0.23
32	002714	牧原股份	9,690	794,580.00	0.22
33	000951	中国重汽	25,300	790,878.00	0.22
34	000938	紫光股份	18,400	790,832.00	0.22
35	603960	克来机电	28,200	787,344.00	0.22
36	000661	长春高新	1,800	783,540.00	0.22
37	603113	金能科技	65,600	779,984.00	0.22
38	603658	安图生物	4,700	763,468.00	0.22
39	601100	恒立液压	9,500	761,900.00	0.21
40	000656	金科股份	92,400	753,984.00	0.21
41	002027	分众传媒	133,200	741,924.00	0.21
42	300559	佳发教育	34,950	741,639.00	0.21
43	688023	安恒信息	2,400	738,960.00	0.21
44	002531	天顺风能	123,000	735,540.00	0.21

45	600966	博汇纸业	72,400	734,860.00	0.21
46	000063	中兴通讯	18,300	734,379.00	0.21
47	000672	上峰水泥	31,100	734,271.00	0.21
48	300601	康泰生物	4,500	729,720.00	0.21
49	000977	浪潮信息	18,480	724,046.40	0.20
50	300476	胜宏科技	30,000	721,500.00	0.20
51	600309	万华化学	14,400	719,856.00	0.20
52	600760	中航沈飞	21,600	708,912.00	0.20
53	000002	万科 A	26,900	703,166.00	0.20
54	603214	爱婴室	22,500	690,075.00	0.19
55	600556	天下秀	35,600	659,668.00	0.19
56	600048	保利地产	43,000	635,540.00	0.18
57	600585	海螺水泥	12,000	634,920.00	0.18
58	688086	紫晶存储	9,361	634,582.19	0.18
59	600570	恒生电子	5,850	630,045.00	0.18
60	000546	金圆股份	62,400	628,368.00	0.18
61	601390	中国中铁	121,500	609,930.00	0.17
62	603259	药明康德	6,300	608,580.00	0.17
63	600864	哈投股份	99,200	596,192.00	0.17
64	600276	恒瑞医药	6,300	581,490.00	0.16
65	002609	捷顺科技	44,100	562,275.00	0.16
66	300015	爱尔眼科	12,600	547,470.00	0.15
67	300188	美亚柏科	26,100	517,563.00	0.15
68	000651	格力电器	9,000	509,130.00	0.14
69	600480	凌云股份	45,000	504,000.00	0.14
70	300598	诚迈科技	2,340	443,196.00	0.12
71	688002	睿创微纳	8,000	407,840.00	0.11
72	002258	利尔化学	21,700	386,911.00	0.11
73	300750	宁德时代	2,000	348,720.00	0.10
74	002415	海康威视	10,300	312,605.00	0.09
75	688558	国盛智科	8,488	299,286.88	0.08
76	688157	松井股份	3,402	294,749.28	0.08
77	603809	豪能股份	18,000	238,860.00	0.07
78	688466	金科环境	4,907	179,547.13	0.05
79	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.05
80	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.04
81	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.03
82	603087	甘李药业	947	94,984.10	0.03
83	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.02



84	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.01
85	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
86	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
87	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
88	300847	中船汉光	1,420	9,854.80	0.00
89	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
90	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
91	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
92	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600201	生物股份	6,479,381.00	1.83
2	600315	上海家化	6,320,067.00	1.78
3	300482	万孚生物	5,862,897.00	1.65
4	002353	杰瑞股份	5,518,156.80	1.55
5	002507	涪陵榨菜	5,464,854.00	1.54
6	002384	东山精密	5,192,345.00	1.46
7	002812	恩捷股份	5,000,797.00	1.41
8	002223	鱼跃医疗	4,555,649.00	1.28
9	002212	南洋股份	4,492,640.00	1.27
10	002138	顺络电子	4,320,076.00	1.22
11	600845	宝信软件	4,249,999.00	1.20
12	601872	招商轮船	4,097,898.35	1.15
13	002028	思源电气	4,018,268.00	1.13
14	600801	华新水泥	3,954,650.44	1.11
15	002049	紫光国微	3,947,239.00	1.11
16	002920	德赛西威	3,933,496.00	1.11
17	603444	吉比特	3,731,515.00	1.05
18	600426	华鲁恒升	3,727,936.15	1.05
19	300274	阳光电源	3,590,505.00	1.01
20	601799	星宇股份	3,584,688.00	1.01

注：本表“本期累计买入金额”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。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002812	恩捷股份	9,215,875.00	2.60
2	300014	亿纬锂能	6,263,759.08	1.76
3	002127	南极电商	5,515,841.60	1.55
4	002384	东山精密	5,419,228.00	1.53
5	300529	健帆生物	5,199,700.16	1.46
6	600763	通策医疗	4,926,115.00	1.39
7	002507	涪陵榨菜	4,764,230.00	1.34
8	002049	紫光国微	4,512,458.00	1.27
9	002353	杰瑞股份	4,160,825.00	1.17
10	002152	广电运通	4,145,006.00	1.17
11	600143	金发科技	4,126,143.00	1.16
12	600584	长电科技	4,078,603.00	1.15
13	603939	益丰药房	4,049,963.00	1.14
14	601872	招商轮船	4,019,441.00	1.13
15	002439	启明星辰	3,932,665.00	1.11
16	600745	闻泰科技	3,897,396.90	1.10
17	000932	华菱钢铁	3,681,952.66	1.04
18	300274	阳光电源	3,667,002.86	1.03
19	603816	顾家家居	3,632,427.40	1.02
20	601100	恒立液压	3,612,391.00	1.02

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	510,080,548.41
卖出股票收入（成交）总额	545,028,414.61

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

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

本基金于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

本基金于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

本基金于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

本基金于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

本基金于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

本基金于本报告期内未持有国债期货。

## 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	174,911.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,036.68
5	应收申购款	124,205.64
6	其他应收款	370.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	305,523.64

**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**

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

**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。

## § 7 投资组合报告 (转型前)

### 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	331,505,048.62	91.86
	其中：股票	331,505,048.62	91.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	28,154,891.66	7.80
8	其他资产	1,231,676.50	0.34
9	合计	360,891,616.78	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	1,224,210.00	0.34
B	采矿业	11,192,325.59	3.11
C	制造业	187,155,799.18	51.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,101,748.08	2.53
E	建筑业	8,466,749.92	2.35
F	批发和零售业	20,381,392.95	5.66
G	交通运输、仓储和邮政业	10,510,713.10	2.92
H	住宿和餐饮业	1,003,887.00	0.28
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,505,535.83	8.19
J	金融业	11,079,970.80	3.07
K	房地产业	12,866,916.95	3.57
L	租赁和商务服务业	5,776,347.89	1.60
M	科学研究和技术服务业	2,255,746.00	0.63
N	水利、环境和公共设施管理业	2,870,395.23	0.80

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	299,106.00	0.08
Q	卫生和社会工作	3,318,916.25	0.92
R	文化、体育和娱乐业	10,137,476.00	2.81
S	综合	225,170.00	0.06
	合计	327,372,406.77	90.84

## 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	-	-
C	制造业	2,862,990.34	0.79
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	-	-
J	金融业	1,269,651.51	0.35
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,132,641.85	1.15

## 7.2.1 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	002439	启明星辰	98,000	4,338,460.00	1.20
2	300418	昆仑万维	173,000	4,330,190.00	1.20
3	603712	七一二	165,500	4,329,480.00	1.20
4	002152	广电运通	416,100	4,327,440.00	1.20
5	603233	大参林	76,133	4,282,481.25	1.19
6	002444	巨星科技	321,700	4,198,185.00	1.16
7	002064	华峰氨纶	616,100	4,164,836.00	1.16
8	000513	丽珠集团	104,819	4,133,013.17	1.15
9	600745	闻泰科技	31,900	4,054,490.00	1.13
10	002353	杰瑞股份	99,400	3,990,910.00	1.11
11	603939	益丰药房	45,802	3,925,231.40	1.09
12	000932	华菱钢铁	924,800	3,921,152.00	1.09
13	300014	亿纬锂能	48,300	3,818,115.00	1.06
14	600584	长电科技	116,000	3,665,600.00	1.02
15	600779	水井坊	79,100	3,662,330.00	1.02
16	000547	航天发展	235,500	3,650,250.00	1.01
17	002812	恩捷股份	50,600	3,293,554.00	0.91
18	600486	扬农化工	45,100	3,272,005.00	0.91
19	601100	恒立液压	58,600	3,255,230.00	0.90
20	300529	健帆生物	34,501	3,135,450.88	0.87
21	300285	国瓷材料	117,256	3,073,279.76	0.85
22	002572	索菲亚	152,000	3,047,600.00	0.85
23	002110	三钢闽光	349,450	2,924,896.50	0.81
24	002048	宁波华翔	108,500	2,515,030.00	0.70
25	600536	中国软件	29,200	2,217,448.00	0.62
26	002273	水晶光电	114,101	2,114,291.53	0.59
27	603882	金域医学	36,075	2,040,041.25	0.57
28	002174	游族网络	60,800	1,826,432.00	0.51
29	603707	健友股份	34,200	1,747,620.00	0.48
30	002180	纳思达	39,200	1,732,640.00	0.48
31	300166	东方国信	91,100	1,708,125.00	0.47
32	600060	海信视像	129,800	1,684,804.00	0.47
33	002821	凯莱英	9,000	1,635,930.00	0.45

34	002217	合力泰	245,400	1,629,456.00	0.45
35	600161	天坛生物	43,900	1,587,424.00	0.44
36	600079	人福医药	108,000	1,582,200.00	0.44
37	000686	东北证券	177,000	1,562,910.00	0.43
38	000877	天山股份	144,900	1,534,491.00	0.43
39	002373	千方科技	60,000	1,515,000.00	0.42
40	603556	海兴电力	91,670	1,508,888.20	0.42
41	000061	农产品	247,200	1,488,144.00	0.41
42	000401	冀东水泥	89,300	1,484,166.00	0.41
43	002745	木林森	104,400	1,472,040.00	0.41
44	002051	中工国际	171,248	1,462,457.92	0.41
45	600557	康缘药业	100,380	1,452,498.60	0.40
46	300207	欣旺达	59,500	1,440,495.00	0.40
47	002926	华西证券	135,200	1,437,176.00	0.40
48	601966	玲珑轮胎	59,700	1,434,591.00	0.40
49	601678	滨化股份	264,400	1,433,048.00	0.40
50	002028	思源电气	98,800	1,426,672.00	0.40
51	000050	深天马 A	82,800	1,421,676.00	0.39
52	600565	迪马股份	465,300	1,414,512.00	0.39
53	600376	首开股份	200,800	1,413,632.00	0.39
54	600373	中文传媒	93,400	1,409,406.00	0.39
55	601233	桐昆股份	100,300	1,400,188.00	0.39
56	002941	新疆交建	90,000	1,397,700.00	0.39
57	002128	露天煤业	173,600	1,354,080.00	0.38
58	000426	兴业矿业	241,700	1,351,103.00	0.37
59	600820	隧道股份	242,000	1,350,360.00	0.37
60	600728	佳都科技	130,900	1,344,343.00	0.37
61	600909	华安证券	185,100	1,343,826.00	0.37
62	600260	凯乐科技	103,040	1,340,550.40	0.37
63	600729	重庆百货	49,800	1,339,122.00	0.37
64	600757	长江传媒	221,500	1,335,645.00	0.37
65	600409	三友化工	213,800	1,334,112.00	0.37
66	000528	柳工	206,810	1,333,924.50	0.37
67	000301	东方盛虹	270,600	1,331,352.00	0.37
68	600446	金证股份	65,700	1,331,082.00	0.37
69	600985	淮北矿业	152,200	1,330,228.00	0.37
70	600415	小商品城	367,500	1,326,675.00	0.37
71	601168	西部矿业	199,300	1,319,366.00	0.37
72	603877	太平鸟	85,500	1,311,570.00	0.36



73	601811	新华文轩	104,800	1,301,616.00	0.36
74	000807	云铝股份	278,400	1,297,344.00	0.36
75	600763	通策医疗	12,500	1,278,875.00	0.35
76	000729	燕京啤酒	206,900	1,272,435.00	0.35
77	600694	大商股份	50,705	1,247,343.00	0.35
78	600521	华海药业	59,300	1,239,963.00	0.34
79	601019	山东出版	187,900	1,236,382.00	0.34
80	300012	华测检测	71,100	1,227,186.00	0.34
81	600598	北大荒	94,900	1,224,210.00	0.34
82	601611	中国核建	186,800	1,223,540.00	0.34
83	000501	鄂武商 A	109,800	1,223,172.00	0.34
84	002818	富森美	103,667	1,209,793.89	0.34
85	601098	中南传媒	99,300	1,208,481.00	0.34
86	600266	城建发展	162,260	1,200,724.00	0.33
87	600426	华鲁恒升	64,286	1,196,362.46	0.33
88	600325	华发股份	171,000	1,188,450.00	0.33
89	600166	福田汽车	610,400	1,171,968.00	0.33
90	603198	迎驾贡酒	67,384	1,171,133.92	0.32
91	600755	厦门国贸	169,100	1,170,172.00	0.32
92	601001	大同煤业	298,100	1,168,552.00	0.32
93	000685	中山公用	145,160	1,167,086.40	0.32
94	603883	老百姓	16,200	1,161,540.00	0.32
95	600823	世茂股份	279,361	1,159,348.15	0.32
96	601231	环旭电子	49,500	1,144,440.00	0.32
97	600737	中粮糖业	127,200	1,138,440.00	0.32
98	000883	湖北能源	300,300	1,135,134.00	0.31
99	000543	皖能电力	270,510	1,128,026.70	0.31
100	600466	蓝光发展	163,780	1,120,255.20	0.31
101	601689	拓普集团	43,600	1,111,800.00	0.31
102	600273	嘉化能源	105,400	1,108,808.00	0.31
103	601717	郑煤机	178,300	1,105,460.00	0.31
104	600970	中材国际	178,950	1,093,384.50	0.30
105	000967	盈峰环境	166,700	1,090,218.00	0.30
106	002002	鸿达兴业	216,100	1,089,144.00	0.30
107	600528	中铁工业	110,100	1,080,081.00	0.30
108	603444	吉比特	2,500	1,077,325.00	0.30
109	000983	西山煤电	200,500	1,070,670.00	0.30
110	600959	江苏有线	269,500	1,069,915.00	0.30
111	603225	新风鸣	94,000	1,068,780.00	0.30

112	603355	莱克电气	44,600	1,066,386.00	0.30
113	601928	凤凰传媒	143,600	1,065,512.00	0.30
114	600549	厦门钨业	79,200	1,065,240.00	0.30
115	600901	江苏租赁	189,200	1,057,628.00	0.29
116	600380	健康元	97,100	1,052,564.00	0.29
117	603515	欧普照明	39,100	1,048,271.00	0.29
118	600138	中青旅	95,000	1,045,000.00	0.29
119	000690	宝新能源	188,700	1,030,302.00	0.29
120	600645	中源协和	55,900	1,028,560.00	0.29
121	600717	天津港	179,560	1,021,696.40	0.28
122	603766	隆鑫通用	279,850	1,021,452.50	0.28
123	600410	华胜天成	93,200	1,020,540.00	0.28
124	002244	滨江集团	234,900	1,005,372.00	0.28
125	000930	中粮科技	129,900	1,002,828.00	0.28
126	600348	阳泉煤业	202,300	997,339.00	0.28
127	601000	唐山港	429,560	996,579.20	0.28
128	002831	裕同科技	35,158	988,994.54	0.27
129	600754	锦江酒店	36,900	986,337.00	0.27
130	000581	威孚高科	49,500	985,050.00	0.27
131	000598	兴蓉环境	218,700	981,963.00	0.27
132	000623	吉林敖东	59,200	976,800.00	0.27
133	000402	金融街	135,200	966,680.00	0.27
134	002233	塔牌集团	84,000	962,640.00	0.27
135	600859	王府井	76,100	961,143.00	0.27
136	600875	东方电气	99,200	955,296.00	0.27
137	601200	上海环境	80,220	940,178.40	0.26
138	000937	冀中能源	283,351	932,224.79	0.26
139	002078	太阳纸业	101,200	930,028.00	0.26
140	600307	酒钢宏兴	510,100	928,382.00	0.26
141	600642	申能股份	170,600	926,358.00	0.26
142	603806	福斯特	17,760	923,164.80	0.26
143	000400	许继电气	81,200	920,808.00	0.26
144	002440	闰土股份	83,000	904,700.00	0.25
145	002500	山西证券	116,200	904,036.00	0.25
146	603816	顾家家居	20,960	901,280.00	0.25
147	000006	深振业 A	186,200	895,622.00	0.25
148	300376	易事特	171,200	895,376.00	0.25
149	600782	新钢股份	197,800	894,056.00	0.25
150	600633	浙数文化	85,800	888,888.00	0.25

151	600835	上海机电	57,600	884,160.00	0.25
152	601326	秦港股份	312,100	883,243.00	0.25
153	600282	南钢股份	278,600	883,162.00	0.25
154	600141	兴发集团	85,100	882,487.00	0.24
155	600657	信达地产	251,200	881,712.00	0.24
156	002419	天虹股份	91,650	881,673.00	0.24
157	601801	皖新传媒	168,200	878,004.00	0.24
158	000028	国药一致	18,510	874,042.20	0.24
159	601179	中国西电	263,100	873,492.00	0.24
160	600132	重庆啤酒	18,000	873,000.00	0.24
161	600335	国机汽车	158,500	865,410.00	0.24
162	300274	阳光电源	67,600	861,900.00	0.24
163	603328	依顿电子	68,800	858,624.00	0.24
164	603983	丸美股份	11,676	858,419.52	0.24
165	300383	光环新网	31,400	848,428.00	0.24
166	600862	中航高科	63,000	844,200.00	0.23
167	002815	崇达技术	43,200	839,376.00	0.23
168	002408	齐翔腾达	123,800	835,650.00	0.23
169	603568	伟明环保	29,397	834,580.83	0.23
170	600098	广州发展	137,100	829,455.00	0.23
171	002463	沪电股份	33,500	829,125.00	0.23
172	601699	潞安环能	128,600	828,184.00	0.23
173	000008	神州高铁	248,200	819,060.00	0.23
174	300002	神州泰岳	225,120	814,934.40	0.23
175	600006	东风汽车	198,700	812,683.00	0.23
176	600643	爱建集团	92,620	812,277.40	0.23
177	002375	亚厦股份	156,100	811,720.00	0.23
178	601975	招商南油	315,400	810,578.00	0.22
179	002019	亿帆医药	42,800	808,064.00	0.22
180	002013	中航机电	104,100	807,816.00	0.22
181	600597	光明乳业	69,800	797,116.00	0.22
182	000813	德展健康	132,401	793,081.99	0.22
183	300159	新研股份	195,100	780,400.00	0.22
184	600125	铁龙物流	148,600	780,150.00	0.22
185	300251	光线传媒	68,100	778,383.00	0.22
186	002465	海格通信	64,000	775,680.00	0.22
187	603228	景旺电子	15,560	773,332.00	0.21
188	002195	二三四五	240,483	771,950.43	0.21
189	600567	山鹰纸业	238,500	767,970.00	0.21

190	600037	歌华有线	74,600	757,936.00	0.21
191	000060	中金岭南	191,300	755,635.00	0.21
192	600845	宝信软件	15,200	747,536.00	0.21
193	000738	航发控制	53,300	741,936.00	0.21
194	600017	日照港	279,600	740,940.00	0.21
195	002583	海能达	99,800	738,520.00	0.20
196	600879	航天电子	101,400	719,940.00	0.20
197	000090	天健集团	147,750	716,587.50	0.20
198	002038	双鹭药业	50,050	715,715.00	0.20
199	300253	卫宁健康	31,200	713,856.00	0.20
200	600062	华润双鹤	50,724	711,657.72	0.20
201	601969	海南矿业	137,800	705,536.00	0.20
202	600073	上海梅林	91,400	703,780.00	0.20
203	002203	海亮股份	74,600	702,732.00	0.20
204	600058	五矿发展	96,800	696,960.00	0.19
205	600388	龙净环保	63,500	692,785.00	0.19
206	000987	越秀金控	79,400	690,780.00	0.19
207	000025	特力A	35,345	688,167.15	0.19
208	600765	中航重机	67,000	684,740.00	0.19
209	603868	飞科电器	18,500	682,835.00	0.19
210	000156	华数传媒	52,400	681,200.00	0.19
211	002085	万丰奥威	87,400	666,862.00	0.19
212	000778	新兴铸管	183,200	666,848.00	0.19
213	002470	金正大	245,600	665,576.00	0.18
214	600312	平高电气	106,900	652,090.00	0.18
215	601799	星宇股份	6,700	646,684.00	0.18
216	000848	承德露露	93,775	646,109.75	0.18
217	600704	物产中大	121,000	642,510.00	0.18
218	600801	华新水泥	27,800	634,952.00	0.18
219	300315	掌趣科技	84,700	634,403.00	0.18
220	601003	柳钢股份	122,000	625,860.00	0.17
221	002690	美亚光电	16,200	620,298.00	0.17
222	600575	淮河能源	256,600	613,274.00	0.17
223	600435	北方导航	71,100	604,350.00	0.17
224	603885	吉祥航空	48,400	597,740.00	0.17
225	600298	安琪酵母	21,600	592,920.00	0.16
226	000089	深圳机场	68,500	591,840.00	0.16
227	600787	中储股份	117,500	580,450.00	0.16
228	000718	苏宁环球	176,400	573,300.00	0.16

229	000887	中鼎股份	55,300	572,908.00	0.16
230	600120	浙江东方	61,437	572,592.84	0.16
231	002936	郑州银行	135,400	570,034.00	0.16
232	600329	中新药业	40,900	563,193.00	0.16
233	600350	山东高速	132,600	560,898.00	0.16
234	601866	中远海发	245,000	556,150.00	0.15
235	600418	江淮汽车	118,000	555,780.00	0.15
236	600064	南京高科	60,380	550,665.60	0.15
237	002127	南极电商	51,400	544,326.00	0.15
238	000039	中集集团	62,520	540,172.80	0.15
239	000825	太钢不锈	148,600	530,502.00	0.15
240	603317	天味食品	13,300	525,882.00	0.15
241	000878	云南铜业	44,500	525,100.00	0.15
242	600863	内蒙华电	200,200	524,524.00	0.15
243	002131	利欧股份	146,900	522,964.00	0.15
244	300180	华峰超纤	58,700	518,321.00	0.14
245	000750	国海证券	110,000	514,800.00	0.14
246	000600	建投能源	113,500	511,885.00	0.14
247	600428	中远海特	153,700	508,747.00	0.14
248	002672	东江环保	50,700	502,944.00	0.14
249	603056	德邦股份	43,900	499,582.00	0.14
250	600908	无锡银行	94,913	488,801.95	0.14
251	000830	鲁西化工	50,700	486,720.00	0.14
252	603650	彤程新材	26,400	476,520.00	0.13
253	600996	贵广网络	50,600	452,870.00	0.13
254	600008	首创股份	135,300	439,725.00	0.12
255	000960	锡业股份	41,700	430,761.00	0.12
256	002482	广田集团	100,000	411,000.00	0.11
257	002925	盈趣科技	6,800	409,768.00	0.11
258	600623	华谊集团	64,500	394,740.00	0.11
259	300088	长信科技	28,939	390,676.50	0.11
260	601005	重庆钢铁	237,000	388,680.00	0.11
261	601016	节能风电	167,500	385,250.00	0.11
262	002807	江阴银行	89,800	385,242.00	0.11
263	600827	百联股份	49,035	384,924.75	0.11
264	002093	国脉科技	44,400	377,400.00	0.10
265	600158	中体产业	37,600	376,752.00	0.10
266	000563	陕国投 A	91,730	370,589.20	0.10
267	000712	锦龙股份	27,399	367,968.57	0.10

268	601598	中国外运	94,800	360,240.00	0.10
269	002191	劲嘉股份	30,400	318,896.00	0.09
270	603377	东方时尚	17,400	299,106.00	0.08
271	002281	光迅科技	9,521	289,533.61	0.08
272	000012	南玻A	57,780	286,588.80	0.08
273	601880	大连港	148,150	268,151.50	0.07
274	600699	均胜电子	8,880	255,300.00	0.07
275	000681	视觉中国	12,100	242,847.00	0.07
276	000869	张裕A	9,400	239,982.00	0.07
277	600673	东阳光	25,300	225,170.00	0.06
278	603866	桃李面包	5,620	213,728.60	0.06
279	002049	紫光国微	3,400	208,590.00	0.06
280	002399	海普瑞	8,000	201,920.00	0.06
281	002384	东山精密	6,650	201,162.50	0.06
282	300113	顺网科技	5,700	184,566.00	0.05
283	600022	山东钢铁	138,680	181,670.80	0.05
284	002183	怡亚通	40,300	162,409.00	0.05
285	601872	招商轮船	24,300	140,454.00	0.04
286	300257	开山股份	11,000	109,340.00	0.03
287	600315	上海家化	3,700	104,340.00	0.03
288	600338	西藏珠峰	9,060	100,384.80	0.03
289	600094	大名城	12,400	82,584.00	0.02
290	603659	璞泰来	700	71,946.00	0.02
291	600707	彩虹股份	15,900	66,780.00	0.02
292	600021	上海电力	5,800	41,876.00	0.01
293	600739	辽宁成大	2,100	36,666.00	0.01
294	600497	驰宏锌锗	8,600	34,658.00	0.01
295	600748	上实发展	6,700	34,572.00	0.01
296	600258	首旅酒店	1,000	17,550.00	0.00
297	603486	科沃斯	600	15,330.00	0.00
298	000158	常山北明	1,200	10,944.00	0.00
299	002573	清新环境	900	5,418.00	0.00
300	600563	法拉电子	80	4,857.60	0.00
301	002223	鱼跃医疗	137	3,981.22	0.00
302	000970	中科三环	300	3,525.00	0.00
303	002340	格林美	432	2,756.16	0.00
304	000537	广宇发展	400	2,736.00	0.00
305	600967	内蒙一机	200	2,146.00	0.00
306	600155	华创阳安	100	1,300.00	0.00

307	000519	中兵红箭	155	1,188.85	0.00
308	002221	东华能源	90	835.20	0.00
309	600572	康恩贝	100	668.00	0.00
310	300009	安科生物	20	324.00	0.00
311	000027	深圳能源	29	162.98	0.00
312	002423	中粮资本	1	8.84	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	601916	浙商银行	294,195	1,223,851.20	0.34
2	688321	微芯生物	13,328	879,381.44	0.24
3	688169	石头科技	2,637	714,943.44	0.20
4	688177	百奥泰	15,603	511,154.28	0.14
5	688396	华润微	31,330	401,024.00	0.11
6	688233	神工股份	11,858	256,962.86	0.07
7	601696	中银证券	8,373	45,800.31	0.01
8	603290	斯达半导	956	45,524.72	0.01
9	603893	瑞芯微	810	22,007.70	0.01
10	688108	赛诺医疗	1,000	20,830.00	0.01
11	300817	双飞股份	422	11,161.90	0.00

## 7.3 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.3.1 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	300418	昆仑万维	4,345,937.35	1.12
2	002439	启明星辰	3,898,893.00	1.00
3	600745	闻泰科技	3,508,708.00	0.90
4	000932	华菱钢铁	3,506,601.00	0.90
5	000513	丽珠集团	3,131,863.00	0.80
6	002812	恩捷股份	2,908,742.00	0.75
7	300285	国瓷材料	2,907,694.76	0.75
8	603233	大参林	2,865,483.64	0.74

9	601100	恒立液压	2,854,995.00	0.73
10	002572	索菲亚	2,850,429.00	0.73
11	600584	长电科技	2,837,963.48	0.73
12	600779	水井坊	2,798,019.00	0.72
13	002152	广电运通	2,578,135.00	0.66
14	600536	中国软件	2,482,415.00	0.64
15	603939	益丰药房	2,390,600.33	0.61
16	603712	七一二	2,382,423.00	0.61
17	002444	巨星科技	2,233,642.00	0.57
18	300529	健帆生物	2,183,468.61	0.56
19	002064	华峰氨纶	2,170,182.00	0.56
20	000547	航天发展	2,135,471.00	0.55

注：本表“本期累计买入金额”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。

### 7.3.2 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	000997	新大陆	2,914,149.00	0.75
2	600143	金发科技	2,321,956.00	0.60
3	002382	蓝帆医疗	2,315,470.00	0.60
4	002221	东华能源	1,915,573.00	0.49
5	002384	东山精密	1,871,172.00	0.48
6	601718	际华集团	1,844,390.00	0.47
7	601139	深圳燃气	1,787,745.00	0.46
8	002603	以岭药业	1,765,483.00	0.45
9	300324	旋极信息	1,741,233.23	0.45
10	600563	法拉电子	1,722,161.00	0.44
11	002223	鱼跃医疗	1,680,441.00	0.43
12	600026	中远海能	1,678,280.00	0.43
13	300009	安科生物	1,671,835.00	0.43
14	600777	新潮能源	1,663,431.00	0.43
15	600664	哈药股份	1,656,792.00	0.43
16	002373	千方科技	1,587,096.00	0.41
17	002065	东华软件	1,551,128.00	0.40
18	600718	东软集团	1,453,747.00	0.37



19	300182	捷成股份	1,439,771.95	0.37
20	002302	西部建设	1,427,960.00	0.37

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。

### 7.3.3 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	108,665,454.09
卖出股票收入（成交）总额	162,799,529.85

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。

### 7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金报告期末未持有债券。

### 7.5 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。

### 7.7 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。

### 7.8 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

本基金于本报告期末未持有权证。

### 7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金于本报告期末未持有股指期货。

#### 7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金于本报告期末未持有股指期货。

### 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金于本报告期末未持有国债期货。

#### 7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金于本报告期末未持有国债期货。

### 7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金于本报告期内未持有国债期货。

### 7.11 投资组合报告附注

#### 7.11.1 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。

#### 7.11.2 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。

#### 7.11.3 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	99,950.76
2	应收证券清算款	1,061,778.79
3	应收股利	-
4	应收利息	69,576.95
5	应收申购款	-
6	其他应收款	370.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,231,676.50

#### 7.11.4 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。

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 7.11.5.2 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	601916	浙商银行	1,223,851.20	0.34	流通受限
2	688169	石头科技	714,943.44	0.20	新股锁定
3	688177	百奥泰	511,154.28	0.14	新股锁定

4	688396	华润微	401,024.00	0.11	新股锁定
---	--------	-----	------------	------	------

#### 7.11.6 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 (转型后)

### 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 指数增强 A	1,204	259,997.95	307,735,496.02	98.31%	5,302,037.11	1.69%
西部利得中证 500 指数增强 C	200	4,201.59	0.00	-	840,317.87	100.00%
合计	1,399	224,358.72	307,735,496.02	98.04%	6,142,354.98	1.96%

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 指数增强 A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	韩昕桐	213,800.00	12.60%
2	李文刚	99,248.00	5.85%
3	欧才	82,162.00	4.84%
4	谢丹萍	52,033.00	3.07%
5	王玉英	44,431.00	2.62%
6	王明辉	39,886.00	2.35%
7	王卓	34,202.00	2.02%
8	陈建红	33,090.00	1.95%
9	李秀莲	30,012.00	1.77%
10	樊容波	29,529.00	1.74%

西部利得中证 500 指数增强 C

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

## 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 指数增强 A	226,978.63	0.0725%
	西部利得中证 500 指数增强 C	55,194.75	6.5683%
	合计	282,173.38	0.0899%

## 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 指 数增强 A	0~10
	西部利得中证 500 指 数增强 C	0
	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 指 数增强 A	0
	西部利得中证 500 指 数增强 C	0
	合计	0

## § 8 基金份额持有人信息 (转型前)

### 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	0	0.00	0.00	0.00%	0.00	0.00%
西部利得中 证 500 等权 重指数分级 B	0	0.00	0.00	0.00%	0.00	0.00%
西部利得中 证 500 等权 重指数分级	1,155	309,640.73	350,253,206.85	97.94%	7,381,837.04	2.06%
合计	1,155	309,640.73	350,253,206.85	97.94%	7,381,837.04	2.06%

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
----	-------	----------	----------

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
----	-------	----------	----------

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	526,100.00	12.25%
2	陈法基	297,868.00	6.93%
3	蔡小婉	236,509.00	5.51%
4	李惠莲	222,703.00	5.18%
5	余晓敏	220,470.00	5.13%
6	傅伟铮	188,410.00	4.39%
7	黄德林	180,481.00	4.20%
8	黄晖	132,471.00	3.08%
9	郭付元	103,773.00	2.42%

10	李文刚	99,248.00	2.31%
----	-----	-----------	-------

### 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	200,347.31	0.0560%
	合计	200,347.31	0.0560%

### 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
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

项目	西部利得中证 500 指数增强 A	西部利得中证 500 指数增强 C
基金合同生效日基金份额总额	357,635,043.89	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购 份额	169,628,136.23	4,628,632.83
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎 回份额	214,225,646.99	3,788,314.96
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变 动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期末基金份额总额	313,037,533.13	840,317.87

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。



## § 9 开放式基金份额变动(转型前)

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	1,440,036.00	1,440,036.00	381,895,995.33
本报告期基金总申购份额	-	-	63,254.65
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	46,067,035.65
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-1,440,036.00	-1,440,036.00	21,742,829.56
本报告期期末基金份额总额	-	-	357,635,043.89

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

本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会表决投票时间自为 2019 年 12 月 12 日起至 2020 年 1 月 6 日 17:00 止，会议审议了《关于修改西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同有关事项的议案》。依据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。本次基金份额持有人大会于 2020 年 1 月 7 日表决通过了本次会议议案，本次大会决议自该日起生效。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人无重大人事变动。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

2020 年 2 月 19 日本基金转换基金运作方式，同时投资策略也有调整。调整的主要内容如下：

1) 行业配置的变化：2 月 19 日前行业配置主要参考中证 500 等权重指数，之后主要参考中证 500 指数。

2) 股票选择的变化：2 月 19 日前 100% 的非现金基金资产必须投资于中证 500 指数成分股及其备选成份股（新股除外）；之后 80% 的非现金基金资产必须投资于中证 500 指数成分股及其备选成份股，另有不超过 20% 的非现金基金资产可投资于非中证 500 指数成分股。

### 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（转型后）

#### 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			
东兴证券	2	202,732,789.57	19.29%	97,939.56	14.37%	-
华金证券	3	202,396,105.00	19.26%	113,761.37	16.69%	-
光大证券	2	175,850,721.69	16.74%	139,150.33	20.41%	-
华西证券	2	174,333,219.46	16.59%	92,624.29	13.59%	-
广发证券	1	97,741,523.63	9.30%	71,478.01	10.49%	-
申万宏源	2	79,059,104.67	7.52%	73,628.26	10.80%	-
中信建投	2	60,569,783.66	5.76%	56,409.33	8.28%	-
太平洋证券	2	58,076,403.11	5.53%	36,662.91	5.38%	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 基金租用席位的选择标准是：（1）资历雄厚，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

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

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

### 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	
东兴证券	2	98,596,132.37	36.57%	32,664.68	21.62%	-
光大证券	2	66,341,052.31	24.61%	52,495.74	34.74%	-
东北证券	2	56,652,920.05	21.01%	24,433.93	16.17%	-
申万宏源	2	34,005,057.59	12.61%	31,668.09	20.96%	-
广发证券	1	12,930,936.77	4.80%	9,398.43	6.22%	-
华金证券	3	1,062,936.00	0.39%	458.45	0.30%	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

中泰证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-

注：1. 基金租用席位的选择标准是：（1）财力雄厚，信誉良好；（2）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营情况稳定；（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
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-

华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

### 10.9 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 增加 C 类份额并修改基金合同相应条款的公告	证券日报	2020 年 4 月 10 日

### 10.9 其他重大事件（转型前）

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	2020/3/4-2020/4/27	63,725,465.21	3,326,427.44	0.00	67,051,892.65	21.36%
	2	2020/4/29-2020/6/30	0.00	67,412,362.58	0.00	67,412,362.58	21.48%
	3	2020/4/29-2020/6/30	63,725,465.21	3,326,427.44	0.00	67,051,892.65	21.36%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品	1	2020/1/1-2020/4/27	154,061,566.49	8,041,912.65	162,103,479.14	0.00	0.00%
产品	2	2020/4/29-2020/6/30	0.00	67,412,362.58	0.00	67,412,362.58	21.48%

#### 产品特有风险

报告期内,本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20% 的情况,由此可能导致的特有风险主要包括:当投资者持有份额占比较为集中时,个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响;极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请,可能带来流动性风险;如个别投资者大额赎回引发巨额赎回,基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请,可能影响投资者赎回业务办理;若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元,基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金于 2020 年 2 月 19 日起由原“西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金”正式转型为“西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)”,《西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同》、《西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 托管协议》等法律文件自 2020 年 2 月 19 日起生效,原《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同》、《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金托管协议》等法律文件自同一起失效。

根据 2020 年 4 月 10 日《关于西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 增加 C 类

份额并修改基金合同相应条款的公告》，本基金于 2020 年 4 月 13 日起增加 C 类基金份额。



## § 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](mailto:service@westleadfund.com)。

西部利得基金管理有限公司

2020 年 8 月 31 日