

西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资 基金 2016 年半年度报告 摘要

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：西部利得基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：二〇一六年八月二十四日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	西部利得中证 500 等权重指数分级		
场内简称	500 等权		
基金主代码	502000		
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	172,300,033.13 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所		
上市日期	2015 年 4 月 27 日		
下属分级基金的基金简称	西部利得中证 500 等权重指数分级	西部利得中证 500 等权重指数分级 A	西部利得中证 500 等权重指数分级 B
下属分级基金场内简称:	500 等权	500 等权 A	500 等权 B
下属分级基金的交易代码	502000	502001	502002
报告期末下属分级基金份额总额	167,247,961.13 份	2,526,036.00 份	2,526,036.00 份

2.2 基金产品说明

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

	<p>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"> 1) 法律法规的限制； 2) 标的指数成份股流动性严重不足，或因受股票停牌的限制等其他市场因素，使基金管理人无法依指数权重购买某成份股； 3) 本基金资产规模过大导致本基金持有某些股票比例过高； 4) 成份股上市公司存在重大虚假陈述等违规行为、或者面临重大的不利行政处罚或司法诉讼； 5) 预期标的指数的成份股即将调整。 <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β 值相近等原则来选择替代股票。</p> <p>(2) 股票组合调整方法</p> <p>本基金将采用完全复制法构建股票投资组合，根据中证 500 等权重指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。同时，本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增发等因素的变化，对股票投资组合进行适时调整，以保证基金净值增长率与中证 500 等权重指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等流动性好的债券。本基金对债券进行配置的原则是：安全性与流动性优先，且兼顾收益性。</p> <p>本基金在满足安全性与流动性的前提下，通过对国内外宏观经济形势的把握和系统分析国内财政政策与货币市场政策等因素变化对债券市场的影响，审慎研判债券市场风险收益特征的变化趋势，采取自上而下的策略构造组合，进行个券选择。</p>		
业绩比较基准	95%×中证 500 等权重指数收益率+5%×商业银行人民币活期存款利率（税后）		
下属分级基金的风险收益特征	500 等权份额为股票型指数份额，其预期风险大于货币市场基金、债券型基金、混	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。

	合型基金。		
--	-------	--	--

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		西部利得基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐剑钧	张志永
	联系电话	021-38572888	021-62677777-212004
	电子邮箱	service@westleadfund.com	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		4007-007-818;021-38572666	95561
传真		021-38572750	021-62159217

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.westleadfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人处——上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 11 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-601,513.62
本期利润	7,228,751.55
加权平均基金份额本期利润	0.1708
本期基金份额净值增长率	-14.89%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	-0.8376
期末基金资产净值	167,886,092.65
期末基金份额净值	0.974

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.74%	1.23%	2.97%	1.44%	0.77%	-0.21%
过去三个月	3.92%	1.43%	0.41%	1.56%	3.51%	-0.13%
过去六个月	-14.89%	2.34%	-17.09%	2.45%	2.20%	-0.11%
过去一年	-41.76%	2.51%	-27.54%	2.80%	-14.22%	-0.29%
自基金合同生效起至今	-41.70%	2.56%	-19.95%	2.83%	-21.75%	-0.27%

注：本基金的业绩基准为：中证 500 等权重指数收益率*95%+商业银行人民币活期存款利率（税后）*5%

其中：中证 500 等权重指数作为衡量股票投资部分的业绩基准，商业银行人民币活期存款利率作为固定收益类资产、货币资产部分的业绩基准。

本基金的业绩基准指数按照构建公式没交易日进行计算，计算方式如下：

$benchmark(0)=1000;$

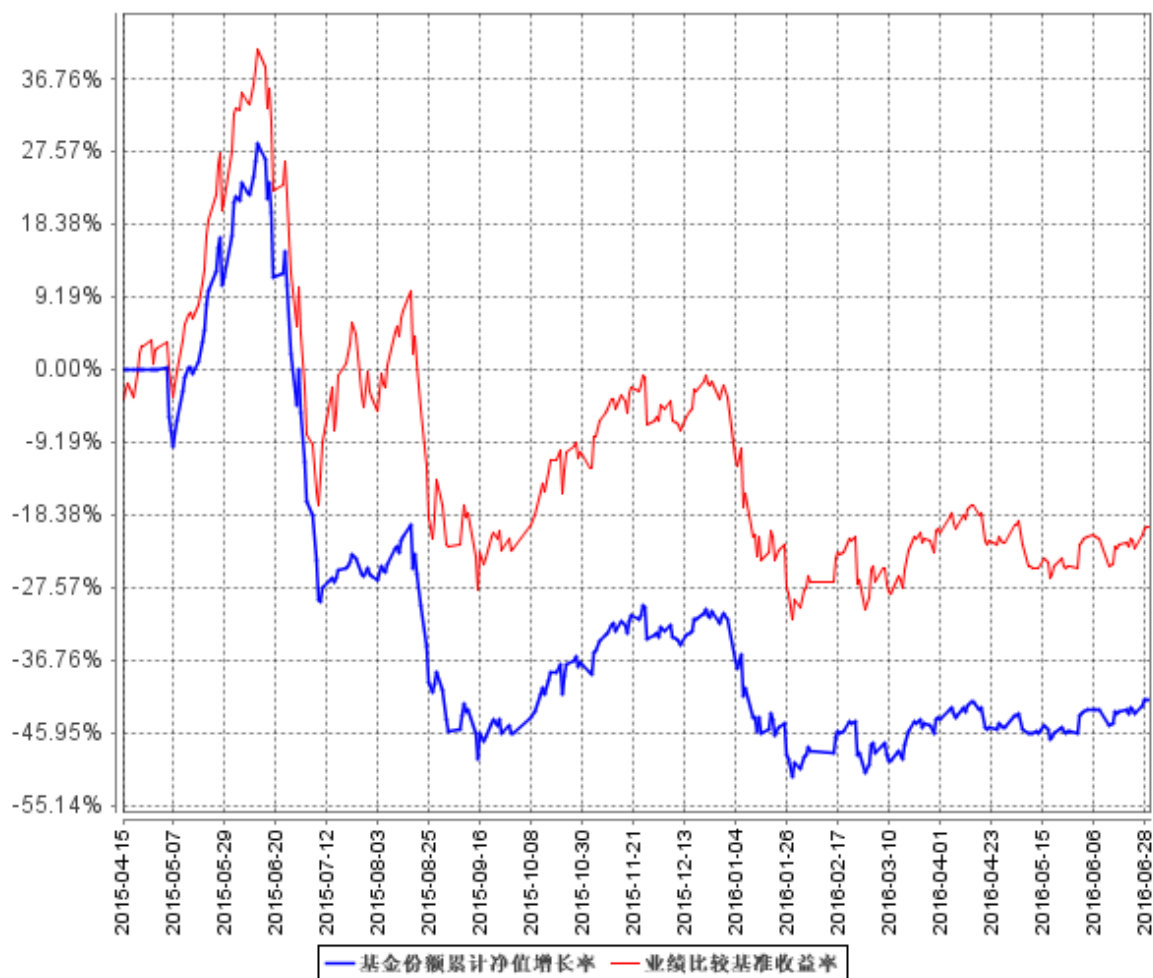
$\%benchmark(t) = 95\% * (中证 500 等权重指数收益率(t) / 中证 500 等权重指数收益率(t-1) - 1) + 5\% * 商业银行人民币活期存款利率 / 365;$

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

其中 $t=1, 2, 3, \dots$ 。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

西部利得基金管理有限公司（简称“西部利得基金”，下同）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2010]864号）批准成立于 2010 年 7 月 20 日，公司由西部证券股份有限公司和上海利得财富资产管理有限公司合资设立，注册资本 3 亿元人民币，其中西部证券股份有限公司出资 51%，上海利得财富资产管理有限公司出资 49%，注册地上海。

截至 2016 年 6 月 30 日，西部利得基金共管理九只开放式基金——西部利得策略优选混合型证券投资基金、西部利得新动向灵活配置混合型证券投资基金、西部利得稳健双利债券型证券投资

资基金、西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金、西部利得成长精选灵活配置混合型证券投资基金、西部利得多策略优选灵活配置混合型证券投资基金、西部利得新盈灵活配置混合型证券投资基金、西部利得行业主题优选灵活配置混合型证券投资基金和西部利得天添鑫货币市场基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
付琦	本基金基金经理	2015 年 4 月 15 日	-	十五年	加拿大渥太华大学工商管理硕士；曾任海通证券股份有限公司业务董事、招商基金管理有限公司研究部高级研究员。2013 年 7 月加入本公司，现任公司总经理助理兼投资总监兼投资部总监，具有基金从业资格，中国国籍。
原泉	本基金基金经理	2015 年 4 月 15 日	2016 年 5 月 5 日	五年	复旦大学金融工程硕士；曾任万得资讯有限公司项目经理、日邮物流（中国）有限公司经理、太平资产管理有限公司经理、财通基金管理有限公司产品经理。2013 年 8 月加入本公司，曾任公司产品部设计部总监，具有基金从业资格，中国国籍。
曹祥	本基金基金经理	2016 年 5 月 3 日	-	六年	南京大学工学硕士，曾任南证期货有限公司研究员、国泰君安期货有限公司研究员。2015 年 8 月加入本公司，现任高级研究员，具有基金从业资格，中国国籍。
曹祥	本基金基金经理助理	2015 年 12 月 14 日	2016 年 5 月 2 日	六年	南京大学工学硕士，曾任南证期货有限公司研究员、国泰君安期货有限公司研究员。2015 年 8 月加入本公司，现任高级研究员，具有基金从业资格，中国国籍。

于海松	本基金基金经理助理	2016 年 5 月 27 日	-	十九年	复旦大学理学硕士，曾担任华夏证券研究所研究员、天相投资顾问公司研究员、国元证券研究所研究员、兴业证券研究所研究员、富国基金管理有限公司产品设计员、汇添富基金管理股份有限公司产品设计员。2016 年 1 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遵规守信情况的说明

本基金管理人旗下基金 2015 年通过申万宏源西部证券有限公司（下称“申万宏源西部”）交易单元买卖证券的年交易佣金占公司所有基金买卖证券的年交易佣金的比例超过 30%。其原因主要有：一是在部门构架及管理职责的调整过程中未及时、全面地理顺各部门之间的逻辑管控关系。二是人员配备不及时。针对此事件本基金管理人采取的整改措施有：一是适当增加其他机构的租用席位；二是对于今后在产品立项阶段增加对交易单元租用意向的配套管理措施。此外，本基金管理人逐步增加人员配备，并将进一步加强各类内部控制措施，以避免此类事件的再次发生。

除上述情况外，本报告期内本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

同时间窗口同向（1 日、3 日、5 日）交易的交易价差以及 T 检验、银行间交易价格偏离度进行了分析。

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.974 元，本报告期份额净值增长率为-14.89%，同期业绩比较基准增长率为-17.09%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年以来经济政策进行供给侧改革，意在通过对过剩产能进行清理，与此同时需求侧管理托底稳定经济，2016 年 GDP 增速可能温和下行。2016 年是“十三五规划”的开局之年，产业政策将继续引领 A 股市场的结构调整，人口结构变化和人均可支配收入的提高将为新兴产业带来新的消费

需求。

2015 年下半年以来证券市场经历了三波大幅调整，预计在 2016 年宏观经济供给改革、需求托底的背景下，2016 年下半年市场运行过程相比去年将震荡幅度减小，波动平稳。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本基金管理人尚未签订任何与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金合同》的约定，存续期内，本基金（包括 500 等权份额，500 等权 A 份额，500 等权 B 份额）不进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

截至本报告期初，本基金已出现连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，针对该情形，本基金管理人的解决方案为：积极研究营销方案，加大营销力度。

上述方案已按《公开募集证券投资基金运作管理办法》要求向中国证监会备案并落实解决措施。

截至本报告期末，本基金基金资产净值已超过五千万元。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金
报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
----	-----	------------------------	--------------------------

资产：			
银行存款		9,636,750.86	829,281.87
结算备付金		734,233.81	1,873.48
存出保证金		37,517.54	51,256.84
交易性金融资产		158,014,560.66	10,373,589.19
其中：股票投资		158,014,560.66	10,373,589.19
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	219,901.82
应收利息		5,923.83	455.13
应收股利		-	-
应收申购款		105,548.63	4,104.55
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		168,534,535.33	11,480,462.88
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		104,184.20	61,085.04
应付赎回款		170,201.48	90,146.68
应付管理人报酬		101,096.38	9,679.07
应付托管费		20,219.26	1,935.81
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		107,618.26	14,352.10
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		145,123.10	220,339.72
负债合计		648,442.68	397,538.42
所有者权益：			
实收基金		288,128,747.07	16,171,245.52
未分配利润		-120,242,654.42	-5,088,321.06
所有者权益合计		167,886,092.65	11,082,924.46
负债和所有者权益总计		168,534,535.33	11,480,462.88

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.974 元，基金份额总额 167,886,092.65 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 4 月 15 日(基金 合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		7,793,034.56	1,421,544.12
1.利息收入		39,315.54	209,258.14
其中：存款利息收入		39,315.54	78,737.02
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	130,521.12
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-121,410.55	1,281,717.62
其中：股票投资收益		-707,690.19	1,121,228.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		586,279.64	160,489.18
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		7,830,265.17	-387,351.91
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		44,864.40	317,920.27
减：二、费用		564,283.01	941,214.66
1. 管理人报酬		186,882.23	228,652.22
2. 托管费		37,376.44	45,730.48
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		145,402.68	624,595.29
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		194,621.66	42,236.67
三、利润总额（亏损总额以“-”		7,228,751.55	480,329.46

号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,228,751.55	480,329.46

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	16,171,245.52	-5,088,321.06	11,082,924.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,228,751.55	7,228,751.55
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 （净值减少以“-”号填列）	271,957,501.55	-122,383,084.91	149,574,416.64
其中：1.基金申购款	281,833,230.31	-126,847,704.95	154,985,525.36
2.基金赎回款	-9,875,728.76	4,464,620.04	-5,411,108.72
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	288,128,747.07	-120,242,654.42	167,886,092.65
项目	上年度可比期间 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	202,990,676.07	-	202,990,676.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	480,329.46	480,329.46
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 （净值减少以“-”号填列）	-149,932,409.78	-432,629.07	-150,365,038.85
其中：1.基金申购款	102,680,914.89	1,286,229.77	103,967,144.66
2.基金赎回款	-252,613,324.67	-1,718,858.84	-254,332,183.51
四、本期向基金份额持有人分配	-	-	-

利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	53,058,266.29	47,700.39	53,105,966.68

注：

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：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014] 1414 号批复核准,由西部利得基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同》和《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金招募说明书》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 202,971,734.99 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 320 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 4 月 15 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 202,990,676.07 份基金份额,其中认购资金利息折合 18,941.08 份基金份额。本基金的基金管理人为西部利得基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

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

本财务报表由本基金的基金管理人西部利得基金管理有限公司于 2016 年 8 月 24 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

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

本报告期内,本基金财务报告所采用的会计政策与 2015 年年度财务报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

6.4.7 关联方关系

7.4.7.1 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。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日

	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
西部证券	75,040,056.30	41.61%	-	-

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
西部证券	39,869.40	36.41%	39,288.52	36.51%
关联方名称	上年度可比期间 2015年4月15日(基金合同生效日)至2015年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
-	-	-	-	-

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年4月15日(基金合同生效日)至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	186,882.23	228,652.22
其中：支付销售机构的客户维护费	2,205.18	10,272.39

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

日基金管理费=前一日基金资产净值×1%/当年天数

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年4月15日(基金合同生效日)至2015年6月30日
当期发生的基金应支付	37,376.44	45,730.48

的托管费		
------	--	--

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

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.2%/当年天数

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.8.5 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日	
	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	9,636,750.86	31,323.79	997,581.51	60,308.22

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

2. 本基金通过“兴业银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2016 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 734,233.81 元。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.9 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

600166	福田汽车	-	临时停牌	5.52	-	-	57,900	310,880.00	319,608.00	-
600773	西藏城投	-	临时停牌	15.67	-	-	19,500	290,579.93	305,565.00	-
300032	金龙机电	-	临时停牌	20.10	-	-	15,200	255,431.00	305,520.00	-
002512	达华智能	-	临时停牌	20.28	-	-	14,100	269,075.00	285,948.00	-
600759	洲际油气	-	临时停牌	7.58	-	-	35,040	276,943.65	265,603.20	-
002249	大洋电机	-	临时停牌	11.97	-	-	19,600	178,817.95	234,612.00	-
002672	东江环保	-	临时停牌	17.33	-	-	11,800	194,910.05	204,494.00	-
601005	重庆钢铁	-	临时停牌	2.52	-	-	73,900	193,918.10	186,228.00	-
600497	驰宏锌锗	-	临时停牌	9.97	-	-	17,700	162,317.06	176,469.00	-
002266	浙富控股	-	临时停牌	5.35	-	-	25,920	147,173.01	138,672.00	-
600545	新疆城建	-	临时停牌	6.91	-	-	19,600	145,677.65	135,436.00	-
600654	中安消	-	临时停牌	18.54	-	-	7,200	143,535.94	133,488.00	-
002373	千方科技	-	临时停牌	14.94	-	-	5,000	81,252.55	74,700.00	-
000975	银泰资源	-	临时停牌	15.00	-	-	1,700	23,539.98	25,500.00	-
000511	*ST 烯碳	-	临时停牌	8.92	-	-	2,600	24,202.96	23,192.00	-
002190	成飞集成	-	临时停牌	35.44	-	-	600	23,179.47	21,264.00	-
000718	苏宁环球	-	临时停牌	13.09	-	-	1,610	17,704.54	21,074.90	-
002663	普邦园林	-	临时停牌	7.36	-	-	2,726	20,877.11	20,063.36	-
600640	号百控股	-	临时停牌	16.79	-	-	1,100	21,235.88	18,469.00	-
601168	西部矿业	-	临时停牌	5.93	-	-	3,000	21,476.63	17,790.00	-
000547	航天发展	-	临时停牌	15.36	-	-	1,100	23,727.25	16,896.00	-
000636	风华高	-	临时	8.84	-	-	1,900	21,066.52	16,796.00	-

	科		停牌							
600511	国药股份	-	临时停牌	27.42	-	-	600	21,913.55	16,452.00	-
000582	北部湾港	-	临时停牌	16.32	-	-	1,000	20,041.11	16,320.00	-
600614	鼎立股份	-	临时停牌	8.14	-	-	1,800	20,358.31	14,652.00	-
600751	天海投资	-	临时停牌	6.11	-	-	2,100	19,321.84	12,831.00	-
000693	ST 华泽	-	临时停牌	12.50	-	-	1,000	18,518.72	12,500.00	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为 154,994,417.20 元，第二层次余额为 3,020,143.46 元，无属于第三层次的余额（2015 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为 9,360,376.15 元，属于第二层次的余额为 1,013,213.04 元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易

不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 6 月 30 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日:同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	158,014,560.66	93.76
	其中:股票	158,014,560.66	93.76
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	10,370,984.67	6.15
7	其他各项资产	148,990.00	0.09
8	合计	168,534,535.33	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股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,306,504.00	1.37
B	采矿业	6,039,570.20	3.60
C	制造业	94,454,616.54	56.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,809,120.20	3.46
E	建筑业	4,692,284.06	2.79
F	批发和零售业	9,369,380.62	5.58
G	交通运输、仓储和邮政业	4,752,964.40	2.83
H	住宿和餐饮业	284,410.00	0.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,896,349.94	5.30
J	金融业	646,891.90	0.39
K	房地产业	10,687,940.96	6.37
L	租赁和商务服务业	2,250,297.60	1.34
M	科学研究和技术服务业	938,983.50	0.56
N	水利、环境和公共设施管理业	1,147,912.70	0.68
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	327,821.20	0.20
R	文化、体育和娱乐业	3,355,892.84	2.00
S	综合	2,053,620.00	1.22
	合计	158,014,560.66	94.12

7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	603806	福斯特	8,600	448,834.00	0.27
2	600006	XD 东风汽	48,800	432,856.00	0.26
3	002371	七星电子	9,800	409,836.00	0.24
4	002482	广田集团	53,950	408,941.00	0.24
5	000620	新华联	43,800	400,770.00	0.24

6	002340	格林美	44,640	391,492.80	0.23
7	600458	时代新材	25,100	391,058.00	0.23
8	300026	红日药业	22,400	389,536.00	0.23
9	000021	深科技	35,300	388,653.00	0.23
10	002074	国轩高科	9,800	386,806.00	0.23

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前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	000418	小天鹅 A	465,147.00	4.20
2	600298	安琪酵母	441,000.00	3.98
3	002508	老板电器	440,033.00	3.97
4	002371	七星电子	434,819.00	3.92
5	002155	湖南黄金	432,790.50	3.91
6	000596	古井贡酒	427,839.82	3.86
7	002466	天齐锂业	408,014.00	3.68
8	002299	圣农发展	404,156.00	3.65
9	002482	广田集团	403,957.50	3.64
10	600809	山西汾酒	401,209.00	3.62
11	002311	海大集团	396,766.00	3.58
12	002431	棕榈股份	392,363.00	3.54
13	002048	宁波华翔	391,803.00	3.54
14	000860	顺鑫农业	388,045.00	3.50
15	002074	国轩高科	384,528.00	3.47
16	600259	广晟有色	382,949.00	3.46
17	600216	XD 浙江医	381,848.00	3.45
18	600395	盘江股份	380,263.00	3.43
19	002635	安洁科技	379,532.00	3.42
20	600392	盛和资源	378,148.00	3.41
21	600175	美都能源	375,713.00	3.39
22	000563	陕国投 A	369,012.00	3.33

23	600880	博瑞传播	368,377.00	3.32
24	002001	新 和 成	365,883.00	3.30
25	002168	深圳惠程	365,608.70	3.30
26	600521	华海药业	361,322.00	3.26
27	603806	福斯特	360,160.00	3.25
28	000997	新 大 陆	357,893.00	3.23
29	600736	苏州高新	355,936.00	3.21
30	000969	安泰科技	355,470.00	3.21
31	002366	台海核电	355,132.00	3.20
32	002085	万丰奥威	354,800.97	3.20
33	600418	江淮汽车	352,941.00	3.18
34	600699	均胜电子	352,913.00	3.18
35	000620	新华联	352,178.00	3.18
36	002477	雏鹰农牧	352,043.00	3.18
37	000078	海王生物	352,016.00	3.18
38	600597	光明乳业	348,085.00	3.14
39	000848	承德露露	345,786.04	3.12
40	002056	横店东磁	344,955.10	3.11
41	300257	开山股份	344,599.00	3.11
42	000028	国药一致	343,911.00	3.10
43	002572	索菲亚	342,949.00	3.09
44	600086	东方金钰	342,846.00	3.09
45	600006	东风汽车	342,190.00	3.09
46	000988	华工科技	341,909.00	3.09
47	300072	三聚环保	341,495.86	3.08
48	600366	宁波韵升	341,313.00	3.08
49	002242	九阳股份	341,146.00	3.08
50	600456	宝钛股份	340,247.66	3.07
51	603077	和邦生物	339,854.00	3.07
52	600729	重庆百货	339,755.00	3.07
53	002503	搜于特	339,544.00	3.06
54	000786	北新建材	339,412.27	3.06
55	600618	氯碱化工	339,344.00	3.06
56	002223	鱼跃医疗	338,013.24	3.05
57	601000	唐山港	337,405.00	3.04
58	000762	西藏矿业	336,458.00	3.04

59	002271	东方雨虹	336,372.00	3.04
60	600468	百利电气	336,281.00	3.03
61	600094	大名城	336,263.00	3.03
62	600864	哈投股份	336,141.00	3.03
63	002340	格林美	335,191.35	3.02
64	300026	红日药业	334,884.00	3.02
65	000587	金洲慈航	333,342.88	3.01
66	002353	杰瑞股份	333,278.17	3.01
67	300115	长盈精密	333,219.00	3.01
68	000501	鄂武商 A	332,962.90	3.00
69	000543	皖能电力	332,798.00	3.00
70	600557	康缘药业	332,622.00	3.00
71	002216	三全食品	332,509.00	3.00
72	603568	伟明环保	332,401.87	3.00
73	000581	威孚高科	332,181.00	3.00
74	600655	豫园商城	331,943.00	3.00
75	002327	富安娜	331,649.03	2.99
76	002293	罗莱生活	331,572.50	2.99
77	600067	冠城大通	330,749.00	2.98
78	600348	阳泉煤业	330,569.95	2.98
79	600059	古越龙山	330,344.00	2.98
80	002191	劲嘉股份	330,006.00	2.98
81	600851	海欣股份	329,894.58	2.98
82	600161	天坛生物	329,754.00	2.98
83	603589	口子窖	329,602.60	2.97
84	000426	兴业矿业	329,354.00	2.97
85	002179	中航光电	329,004.54	2.97
86	600200	江苏吴中	328,856.00	2.97
87	600195	中牧股份	328,788.00	2.97
88	600805	悦达投资	328,766.00	2.97
89	600528	中铁二局	328,529.00	2.96
90	600611	大众交通	328,120.00	2.96
91	000012	南 玻 A	327,975.00	2.96
92	600176	中国巨石	327,873.60	2.96
93	300134	大富科技	327,694.75	2.96
94	600884	杉杉股份	327,567.00	2.96

95	002078	太阳纸业	327,486.29	2.95
96	000661	长春高新	327,471.80	2.95
97	002277	友阿股份	327,390.00	2.95
98	600143	金发科技	327,364.00	2.95
99	600435	北方导航	327,000.00	2.95
100	000816	智慧农业	326,828.00	2.95
101	600563	法拉电子	326,809.00	2.95
102	002325	洪涛股份	326,628.84	2.95
103	002714	牧原股份	326,158.00	2.94
104	002281	光迅科技	325,995.38	2.94
105	600754	锦江股份	325,969.00	2.94
106	601908	京运通	325,318.00	2.94
107	600132	重庆啤酒	325,089.00	2.93
108	000066	长城电脑	324,907.00	2.93
109	002595	豪迈科技	324,764.00	2.93
110	000552	靖远煤电	324,480.00	2.93
111	600458	时代新材	324,422.00	2.93
112	000513	丽珠集团	324,398.41	2.93
113	601012	隆基股份	324,375.00	2.93
114	600522	中天科技	324,366.00	2.93
115	002698	博实股份	324,340.00	2.93
116	600694	大商股份	324,313.00	2.93
117	002665	首航节能	324,236.00	2.93
118	600664	哈药股份	324,210.81	2.93
119	600970	中材国际	324,108.00	2.92
120	600312	平高电气	323,709.00	2.92
121	000939	凯迪生态	323,563.54	2.92
122	000550	江铃汽车	323,556.00	2.92
123	600466	蓝光发展	323,483.00	2.92
124	000671	阳光城	323,381.00	2.92
125	002317	众生药业	323,242.02	2.92
126	601678	滨化股份	323,181.80	2.92
127	000869	张裕 A	323,170.43	2.92
128	000488	晨鸣纸业	322,999.00	2.91
129	601226	华电重工	322,935.00	2.91
130	000656	金科股份	322,789.00	2.91

131	300001	特锐德	322,658.05	2.91
132	600826	兰生股份	322,614.43	2.91
133	000998	隆平高科	322,492.00	2.91
134	300274	阳光电源	322,373.16	2.91
135	002727	一心堂	322,141.00	2.91
136	000703	恒逸石化	321,983.00	2.91
137	600201	生物股份	321,928.00	2.90
138	002051	中工国际	321,491.00	2.90
139	600138	中青旅	321,394.00	2.90
140	600004	白云机场	321,240.10	2.90
141	002244	滨江集团	321,090.00	2.90
142	601965	中国汽研	320,888.52	2.90
143	600108	亚盛集团	320,770.00	2.89
144	600056	中国医药	320,750.00	2.89
145	601002	晋亿实业	320,671.00	2.89
146	601126	四方股份	320,558.00	2.89
147	603698	航天工程	320,486.00	2.89
148	600872	中炬高新	320,306.00	2.89
149	603001	奥康国际	320,299.46	2.89
150	000897	津滨发展	320,236.00	2.89
151	000600	建投能源	320,008.84	2.89
152	000400	许继电气	319,870.53	2.89
153	600409	三友化工	319,867.00	2.89
154	002461	珠江啤酒	319,721.00	2.88
155	600487	亨通光电	319,709.00	2.88
156	603699	纽威股份	319,569.00	2.88
157	600761	安徽合力	319,553.74	2.88
158	002588	史丹利	319,535.00	2.88
159	600496	精工钢构	319,535.00	2.88
160	002064	华峰氨纶	319,368.00	2.88
161	002285	世联行	319,349.00	2.88
162	601155	新城控股	319,269.40	2.88
163	600572	康恩贝	318,935.00	2.88
164	002701	奥瑞金	318,895.00	2.88
165	002344	海宁皮城	318,793.00	2.88
166	600426	华鲁恒升	318,561.00	2.87

167	600284	浦东建设	318,559.00	2.87
168	000008	神州高铁	318,372.00	2.87
169	000973	佛塑科技	318,346.00	2.87
170	601717	郑煤机	318,182.00	2.87
171	600510	黑牡丹	318,164.17	2.87
172	603169	兰石重装	318,148.22	2.87
173	600325	华发股份	318,090.11	2.87
174	600478	科力远	317,937.00	2.87
175	600280	中央商场	317,857.00	2.87
176	000877	天山股份	317,852.00	2.87
177	601515	东风股份	317,685.92	2.87
178	600811	东方集团	317,682.00	2.87
179	002128	露天煤业	317,566.00	2.87
180	600397	安源煤业	317,277.00	2.86
181	000612	焦作万方	317,254.00	2.86
182	600808	马钢股份	317,213.26	2.86
183	600673	东阳光科	317,198.00	2.86
184	000030	富奥股份	317,051.00	2.86
185	002678	珠江钢琴	316,926.90	2.86
186	002073	软控股份	316,774.00	2.86
187	600498	烽火通信	316,597.00	2.86
188	600416	湘电股份	316,175.00	2.85
189	600039	四川路桥	316,165.00	2.85
190	000667	美好集团	316,049.00	2.85
191	601880	大连港	315,932.00	2.85
192	000900	现代投资	315,910.36	2.85
193	600236	桂冠电力	315,793.00	2.85
194	600509	天富能源	315,647.00	2.85
195	002368	太极股份	315,538.67	2.85
196	000979	中弘股份	315,533.00	2.85
197	002444	巨星科技	315,400.00	2.85
198	002251	步步高	315,366.00	2.85
199	000758	中色股份	315,351.00	2.85
200	000926	福星股份	315,178.68	2.84
201	600125	铁龙物流	315,102.48	2.84
202	601666	平煤股份	314,769.00	2.84

203	600320	振华重工	314,711.00	2.84
204	002025	航天电器	314,660.75	2.84
205	300039	上海凯宝	314,654.56	2.84
206	600801	华新水泥	314,628.88	2.84
207	600894	广日股份	314,564.00	2.84
208	600971	恒源煤电	314,529.00	2.84
209	600787	中储股份	314,497.84	2.84
210	000697	炼石有色	314,485.00	2.84
211	002428	云南锗业	314,233.00	2.84
212	600289	亿阳信通	314,167.00	2.83
213	002276	万马股份	314,066.01	2.83
214	000021	深科技	314,009.00	2.83
215	000830	鲁西化工	313,882.00	2.83
216	600270	外运发展	313,832.02	2.83
217	600874	创业环保	313,783.00	2.83
218	600720	祁连山	313,775.65	2.83
219	000685	中山公用	313,764.00	2.83
220	000088	盐田港	313,605.00	2.83
221	600743	华远地产	313,601.00	2.83
222	600425	青松建化	313,594.00	2.83
223	002122	天马股份	313,502.00	2.83
224	600187	国中水务	313,404.50	2.83
225	002342	巨力索具	313,344.88	2.83
226	000572	海马汽车	313,337.00	2.83
227	600026	中海发展	313,325.00	2.83
228	600639	浦东金桥	313,315.00	2.83
229	000983	西山煤电	313,271.00	2.83
230	000417	合肥百货	313,196.13	2.83
231	600017	日照港	313,134.00	2.83
232	600823	世茂股份	313,024.00	2.82
233	002390	信邦制药	312,974.00	2.82
234	600335	国机汽车	312,915.00	2.82
235	002498	汉缆股份	312,869.02	2.82
236	002589	瑞康医药	312,625.88	2.82
237	000049	德赛电池	312,567.00	2.82
238	600835	上海机电	312,533.38	2.82

239	603555	贵人鸟	312,447.66	2.82
240	600628	新世界	312,409.64	2.82
241	600790	轻纺城	312,321.00	2.82
242	002345	潮宏基	312,098.00	2.82
243	600141	兴发集团	312,062.00	2.82
244	600251	冠农股份	311,921.00	2.81
245	002005	德豪润达	311,846.38	2.81
246	002400	省广股份	311,839.00	2.81
247	600717	天津港	311,773.00	2.81
248	002640	跨境通	311,766.00	2.81
249	002308	威创股份	311,691.00	2.81
250	002028	思源电气	311,666.00	2.81
251	600300	维维股份	311,636.00	2.81
252	600517	置信电气	311,559.00	2.81
253	600277	亿利洁能	311,526.00	2.81
254	600180	瑞茂通	311,446.01	2.81
255	600831	广电网络	311,435.00	2.81
256	601001	大同煤业	311,430.00	2.81
257	600580	卧龙电气	311,395.00	2.81
258	002354	天神娱乐	311,366.00	2.81
259	600282	南钢股份	311,366.00	2.81
260	300055	万邦达	311,298.00	2.81
261	002267	陕天然气	311,204.46	2.81
262	601369	陕鼓动力	311,110.37	2.81
263	600169	太原重工	311,102.00	2.81
264	600575	皖江物流	311,099.00	2.81
265	600687	刚泰控股	311,029.00	2.81
266	002254	泰和新材	310,907.00	2.81
267	600166	福田汽车	310,880.00	2.81
268	600482	中国动力	310,876.00	2.80
269	002426	胜利精密	310,860.00	2.80
270	600292	远达环保	310,667.00	2.80
271	300010	立思辰	310,569.00	2.80
272	600422	昆药集团	310,540.00	2.80
273	600483	福能股份	310,437.00	2.80
274	600266	北京城建	310,337.00	2.80

275	600765	中航重机	310,300.81	2.80
276	600428	中远航运	310,228.00	2.80
277	600536	中国软件	310,147.00	2.80
278	000690	宝新能源	310,142.00	2.80
279	600380	健康元	310,075.00	2.80
280	600594	益佰制药	309,999.00	2.80
281	600220	江苏阳光	309,945.00	2.80
282	002414	高德红外	309,937.00	2.80
283	000961	中南建设	309,814.00	2.80
284	600316	洪都航空	309,799.75	2.80
285	600329	中新药业	309,796.00	2.80
286	002004	华邦健康	309,671.00	2.79
287	002392	北京利尔	309,576.00	2.79
288	600503	华丽家族	309,528.00	2.79
289	002029	七匹狼	309,479.50	2.79
290	603025	大豪科技	309,473.00	2.79
291	603198	迎驾贡酒	309,442.50	2.79
292	002233	塔牌集团	309,376.13	2.79
293	000598	兴蓉环境	309,256.00	2.79
294	000681	视觉中国	309,190.00	2.79
295	600219	南山铝业	309,096.00	2.79
296	000031	中粮地产	309,053.00	2.79
297	600499	科达洁能	309,045.00	2.79
298	002050	三花股份	308,923.00	2.79
299	002038	双鹭药业	308,907.00	2.79
300	600657	信达地产	308,884.59	2.79
301	603005	晶方科技	308,868.00	2.79
302	600351	亚宝药业	308,864.00	2.79
303	600596	新安股份	308,845.21	2.79
304	601010	文峰股份	308,781.00	2.79
305	601929	吉视传媒	308,775.57	2.79
306	600183	生益科技	308,614.00	2.78
307	600812	华北制药	308,589.00	2.78
308	600064	南京高科	308,452.00	2.78
309	000726	鲁泰 A	308,437.77	2.78
310	002131	利欧股份	308,388.00	2.78

311	000930	中粮生化	308,349.53	2.78
312	002092	中泰化学	308,316.00	2.78
313	000006	深振业 A	308,279.00	2.78
314	600881	亚泰集团	308,206.00	2.78
315	002238	天威视讯	308,082.00	2.78
316	300202	聚龙股份	307,977.34	2.78
317	600073	上海梅林	307,970.00	2.78
318	600635	大众公用	307,904.00	2.78
319	000878	云南铜业	307,810.87	2.78
320	600410	华胜天成	307,608.50	2.78
321	600151	航天机电	307,605.00	2.78
322	002022	科华生物	307,516.00	2.77
323	000652	泰达股份	307,432.89	2.77
324	601777	力帆股份	307,376.00	2.77
325	601699	潞安环能	307,038.00	2.77
326	600267	海正药业	307,027.00	2.77
327	300088	长信科技	306,954.00	2.77
328	000829	天音控股	306,657.00	2.77
329	600500	中化国际	306,624.00	2.77
330	002332	仙琚制药	306,338.00	2.76
331	002011	盾安环境	306,201.00	2.76
332	000528	柳 工	306,151.84	2.76
333	600184	光电股份	306,112.00	2.76
334	601886	江河集团	306,080.00	2.76
335	600436	片仔癀	306,015.30	2.76
336	600776	东方通信	306,004.00	2.76
337	600240	华业资本	305,967.00	2.76
338	600160	巨化股份	305,897.00	2.76
339	002013	中航机电	305,651.00	2.76
340	001696	宗申动力	305,614.69	2.76
341	600507	方大特钢	305,580.00	2.76
342	600825	新华传媒	305,363.00	2.76
343	000919	金陵药业	305,301.84	2.75
344	000777	中核科技	304,884.00	2.75
345	600079	人福医药	304,747.00	2.75
346	600850	华东电脑	304,570.00	2.75

347	600617	国新能源	304,449.18	2.75
348	300273	和佳股份	304,339.00	2.75
349	600643	爱建集团	304,328.00	2.75
350	000631	顺发恒业	304,182.50	2.74
351	300287	飞利信	304,061.36	2.74
352	002118	紫鑫药业	304,040.81	2.74
353	600748	上实发展	304,018.00	2.74
354	000861	海印股份	303,843.50	2.74
355	002194	武汉凡谷	303,807.00	2.74
356	002440	闰土股份	303,803.00	2.74
357	603019	中科曙光	303,770.00	2.74
358	000937	冀中能源	303,387.00	2.74
359	002250	联化科技	303,335.00	2.74
360	002358	森源电气	303,244.00	2.74
361	600112	天成控股	303,040.30	2.73
362	000931	中关村	302,812.00	2.73
363	002479	富春环保	302,576.00	2.73
364	000680	山推股份	302,186.00	2.73
365	002315	焦点科技	302,162.00	2.73
366	002041	登海种业	301,974.00	2.72
367	600601	方正科技	301,682.00	2.72
368	600869	智慧能源	301,096.00	2.72
369	600682	南京新百	300,981.00	2.72
370	600967	北方创业	300,702.66	2.71
371	002002	鸿达兴业	300,577.00	2.71
372	300147	香雪制药	300,496.00	2.71
373	002396	星网锐捷	300,476.00	2.71
374	002439	启明星辰	300,235.50	2.71
375	000090	天健集团	300,233.93	2.71
376	600516	方大炭素	300,110.00	2.71
377	600388	龙净环保	299,990.00	2.71
378	002603	以岭药业	299,877.00	2.71
379	600481	双良节能	299,834.00	2.71
380	000887	中鼎股份	299,833.00	2.71
381	600565	迪马股份	299,666.00	2.70
382	002221	东华能源	299,458.00	2.70

383	600062	华润双鹤	299,178.00	2.70
384	600433	冠豪高新	299,177.00	2.70
385	002646	青青稞酒	299,010.00	2.70
386	002161	远望谷	298,569.00	2.69
387	600750	江中药业	298,487.00	2.69
388	300182	捷成股份	298,477.00	2.69
389	600537	亿晶光电	298,381.00	2.69
390	601801	皖新传媒	298,215.52	2.69
391	600587	新华医疗	298,206.00	2.69
392	000616	海航投资	298,076.53	2.69
393	603355	莱克电气	297,860.00	2.69
394	000566	海南海药	297,687.36	2.69
395	300199	翰宇药业	297,652.00	2.69
396	600917	重庆燃气	297,568.00	2.68
397	600158	中体产业	297,397.00	2.68
398	002375	亚厦股份	297,361.00	2.68
399	002551	尚荣医疗	297,007.00	2.68
400	002437	誉衡药业	297,002.00	2.68
401	002573	清新环境	296,973.00	2.68
402	002063	远光软件	296,912.36	2.68
403	600586	金晶科技	296,815.00	2.68
404	600755	厦门国贸	296,696.00	2.68
405	000669	金鸿能源	296,540.00	2.68
406	000727	华东科技	296,526.00	2.68
407	002269	美邦服饰	296,480.00	2.68
408	002657	中科金财	296,445.00	2.67
409	600198	大唐电信	296,183.00	2.67
410	600171	上海贝岭	295,759.00	2.67
411	002030	达安基因	295,753.06	2.67
412	600633	浙报传媒	295,620.00	2.67
413	600879	航天电子	295,409.75	2.67
414	000099	中信海直	295,288.00	2.66
415	300244	迪安诊断	295,261.00	2.66
416	603328	依顿电子	295,097.00	2.66
417	603766	隆鑫通用	294,981.00	2.66
418	002310	东方园林	294,699.00	2.66

419	603883	老百姓	293,903.00	2.65
420	601233	桐昆股份	293,332.00	2.65
421	000062	深圳华强	293,257.50	2.65
422	002745	木林森	293,174.00	2.65
423	002489	浙江永强	293,120.00	2.64
424	600757	长江传媒	293,081.00	2.64
425	000541	佛山照明	292,881.60	2.64
426	002405	四维图新	292,621.00	2.64
427	300253	卫宁健康	292,459.23	2.64
428	600773	西藏城投	292,238.00	2.64
429	002261	拓维信息	291,627.21	2.63
430	000970	中科三环	291,558.00	2.63
431	600978	宜华生活	290,858.79	2.62
432	002602	世纪华通	289,849.00	2.62
433	002384	东山精密	289,525.48	2.61
434	002093	国脉科技	289,217.00	2.61
435	002410	广联达	289,165.00	2.61
436	600088	中视传媒	288,885.84	2.61
437	600651	飞乐音响	288,645.00	2.60
438	600551	时代出版	288,618.00	2.60
439	002181	粤传媒	288,241.00	2.60
440	300291	华录百纳	288,101.72	2.60
441	000158	常山股份	287,727.00	2.60
442	002624	完美环球	287,686.00	2.60
443	600525	长园集团	287,485.00	2.59
444	002642	荣之联	287,443.00	2.59
445	600584	长电科技	286,207.00	2.58
446	000050	深天马 A	285,756.00	2.58
447	600759	洲际油气	284,127.00	2.56
448	002268	卫士通	284,070.00	2.56
449	600053	九鼎投资	281,233.92	2.54
450	600770	综艺股份	280,716.00	2.53
451	002699	美盛文化	280,383.00	2.53
452	300113	顺网科技	279,760.00	2.52
453	002309	中利科技	279,367.00	2.52
454	601311	XD 骆驼股	278,622.00	2.51

455	002106	莱宝高科	278,396.00	2.51
456	603188	亚邦股份	278,002.30	2.51
457	002463	沪电股份	277,912.00	2.51
458	600993	马应龙	277,179.00	2.50
459	002049	紫光国芯	276,916.00	2.50
460	002217	合力泰	274,632.00	2.48
461	600058	五矿发展	274,303.00	2.48
462	000810	创维数字	274,177.20	2.47
463	002681	奋达科技	274,173.44	2.47
464	000519	江南红箭	273,497.21	2.47
465	600260	凯乐科技	273,444.00	2.47
466	002273	水晶光电	272,473.00	2.46
467	603567	珍宝岛	270,443.00	2.44
468	002512	达华智能	269,075.00	2.43
469	600623	华谊集团	268,357.00	2.42
470	600429	三元股份	264,711.00	2.39
471	600645	中源协和	264,208.00	2.38
472	000748	长城信息	263,590.00	2.38
473	600122	宏图高科	262,074.00	2.36
474	600859	王府井	260,191.00	2.35
475	002237	恒邦股份	258,018.00	2.33
476	300043	互动娱乐	255,983.00	2.31
477	300032	金龙机电	255,431.00	2.30
478	002408	齐翔腾达	252,489.00	2.28
479	600460	士兰微	251,702.00	2.27
480	002180	艾派克	248,357.80	2.24
481	002174	游族网络	239,393.00	2.16

注：本表“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002237	恒邦股份	336,890.00	3.04
2	002174	游族网络	315,327.50	2.85

3	600429	三元股份	266,465.98	2.40
4	002180	艾派克	260,399.25	2.35
5	000603	盛达矿业	260,129.00	2.35
6	600074	保千里	241,226.00	2.18
7	600885	宏发股份	239,915.00	2.16
8	000933	*ST 神火	230,950.00	2.08
9	603899	晨光文具	227,779.00	2.06
10	600566	济川药业	226,105.00	2.04
11	002419	天虹商场	224,513.00	2.03
12	600816	安信信托	217,726.00	1.96
13	603369	今世缘	216,872.50	1.96
14	600997	开滦股份	216,575.20	1.95
15	002371	七星电子	211,438.00	1.91
16	000951	中国重汽	208,881.64	1.88
17	600376	首开股份	204,296.00	1.84
18	601139	深圳燃气	203,522.00	1.84
19	002140	东华科技	202,009.00	1.82
20	600803	新奥股份	196,668.82	1.77

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	160,425,727.88
卖出股票的收入（成交）总额	19,907,331.39

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

贵金属不在本基金投资范围内。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

股指期货不在本基金投资范围内。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货不在本基金投资范围内。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本基金投资国债期货的投资政策

国债期货不在本基金投资范围内。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

国债期货不在本基金投资范围内。

7.11.3 本基金投资国债期货的投资评价

国债期货不在本基金投资范围内。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	37,517.54
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,923.83
5	应收申购款	105,548.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	148,990.00

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
西部利得中证 500 等权重指数分级 A	179	14,111.93	50,256.00	1.99%	2,475,780.00	98.01%
西部利得中证 500 等权重指数分级 B	772	3,272.07	23,235.00	0.92%	2,502,801.00	99.08%
西部利得中证 500 等权重指数分级	634	263,798.05	163,913,490.02	98.01%	3,334,471.11	1.99%
合计	1,434	120,153.44	163,986,981.02	95.18%	8,313,052.11	4.82%

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

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

8.2 期末上市基金前十名持有人

西部利得中证 500 等权重指数分级 A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	黄松友	1,405,350.00	55.63%
2	左彦升	229,800.00	9.10%
3	夏南凯	106,300.00	4.21%
4	董景秋	92,477.00	3.66%
5	范丽金	77,679.00	3.08%

6	高明桂	69,533.00	2.75%
7	向顺波	56,977.00	2.26%
8	周衡阳	33,000.00	1.31%
9	陈立	30,500.00	1.21%
10	朱清	27,350.00	1.08%

西部利得中证 500 等权重指数分级 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	李莉	250,000.00	9.90%
2	陈兵	140,100.00	5.55%
3	欧才	78,494.00	3.11%
4	王天舒	72,800.00	2.88%
5	李晟	53,076.00	2.10%
6	李秀莲	48,672.00	1.93%
7	张建明	46,900.00	1.86%
8	顾海峰	44,800.00	1.77%
9	巫剑飞	42,828.00	1.70%
10	谭新河	40,000.00	1.58%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	西部利得中证 500 等权重指数分级 A	0
	西部利得中证 500 等权重指数分级 B	0
	西部利得中证 500 等权重指数分级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开	西部利得中证 500 等	0

开放式基金	权重指数分级 A	
	西部利得中证 500 等权重指数分级 B	0
	西部利得中证 500 等权重指数分级	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	西部利得中证 500 等权重指数分级 A	西部利得中证 500 等权重指数分级 B	西部利得中证 500 等权重指数分级
基金合同生效日（2015 年 4 月 15 日）基金份额总额	-	-	202,990,676.07
本报告期期初基金份额总额	2,168,136.00	2,168,136.00	5,244,148.73
本报告期基金总申购份额	-	-	168,535,360.49
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	5,904,485.49
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	357,900.00	357,900.00	-627,062.60
本报告期期末基金份额总额	2,526,036.00	2,526,036.00	167,247,961.13

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开本基金份额持有人大会，无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

本报告期后，本基金管理人于 2016 年 7 月 7 日收到深圳市罗湖区人民法院就原告万科企业

股份有限公司工会委员会诉本基金管理人损害股东利益责任纠纷一案的《民事诉讼状》。截止本公告送出日，本基金管理人正在按照法律程序积极应诉。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
西部证券	2	75,040,056.30	41.61%	39,869.40	36.41%	-
海通证券	1	50,025,930.94	27.74%	26,578.97	24.27%	-
中信建投	1	39,489,037.86	21.90%	36,776.27	33.59%	-
方正证券	2	8,893,305.59	4.93%	4,725.05	4.32%	-
银河证券	2	6,259,725.58	3.47%	1,010.67	0.92%	-
光大证券	1	315,218.00	0.17%	249.45	0.23%	-
申万宏源	2	309,785.00	0.17%	288.62	0.26%	-
平安证券	3	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-

注：1. 基金租用席位的选择标准是：

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

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

2. 报告期内新增交易单元为：

- (1) 平安证券
- (2) 东北证券
- (3) 国泰君安
- (4) 海通证券
- (5) 方正证券
- (6) 中泰证券
- (7) 光大证券
- (8) 中信建投
- (9) 华泰证券

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
西部证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

申万宏源	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

西部利得基金管理有限公司
2016 年 8 月 24 日