

西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资 基金 2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 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：二〇二〇年三月三十一日

§ 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 3 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。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	8
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	9
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	9
3.3 其他指标	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§ 5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
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	18
§ 6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息	19
6.2 审计报告的基本内容	19
§ 7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表	22
7.2 利润表	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	25
7.4 报表附注	26
§ 8 投资组合报告	53
8.1 期末基金资产组合情况	53
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	53
8.3 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	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	71
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	73
8.6 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	73

8.7 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	73
8.8 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	74
8.9 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	74
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	74
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	74
8.12 投资组合报告附注	74
§9 基金份额持有人信息	76
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	76
9.2 期末上市基金前十名持有人	76
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	78
9.4 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	78
§10 开放式基金份额变动	79
§11 重大事件揭示	80
11.1 基金份额持有人大会决议	80
11.2 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	80
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	80
11.4 基金投资策略的改变	80
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	80
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	80
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	80
11.8 其他重大事件	82
§12 影响投资者决策的其他重要信息	84
12.1 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	84
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	84
§13 备查文件目录	85
13.1 备查文件目录	85
13.2 存放地点	85
13.3 查阅方式	85

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金		
基金简称	西部利得中证 500 等权重指数分级		
场内简称	500 等权		
基金主代码	502000		
前端交易代码	—		
后端交易代码	—		
基金运作方式	上市契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 4 月 15 日		
基金管理人	西部利得基金管理有限公司		
基金托管人	兴业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	384,776,067.33 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所		
上市日期	—		
下属分级基金的基金简称	西部利得中证 500 等权重指数分级 A	西部利得中证 500 等权重指数分级 B	西部利得中证 500 等权重指数分级
下属分级基金的场内简称	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份额总额	1,440,036.00 份	1,440,036.00 份	381,895,995.33 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，追求对中证 500 等权重指数的有效跟踪。力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内，以分享中国经济的长期增长成果，实现基金资产的长期增值。
------	---

投资策略	本基金主要采用完全复制法，按照在中证 500 等权重指数中的成份股的构成及其基准权重构建股票投资组合，以拟跟踪中证 500 等权重指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，使跟踪误差控制在限定的范围之内。 1、资产配置策略 本基金管理人主要按照中证 500 等权重指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金投资于中证 500 等权重指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%；现金以及到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。基金管理人将综合考虑股票市场情况、基金资产的流动性要求等因素确定各类资产的具体配置比例。在巨额申购赎回发生、成份股大比例分红等情况下，管理人将在综合考虑冲击成本因素和跟踪效果后，及时将股票配置比例调整至合理水平。 2、股票投资策略 （1）股票组合构建原则 本基金通过复制指数的方法，根据中证 500 等权重指数成份股组成及其基准权重构建股票投资组合。当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证 500 等权重指数的效果可能带来影响时，基金管理人将根据市场情况，采取合理措施控制基金的跟踪误差。 在特殊情况下，本基金将选择其他股票或股票组合对标的指数中的股票加以适当替换，这些情况包括但不限于以下情形： 1）法律法规的限制； 2）标的指数成份股流动性严重不足，或因受股票停牌的限制等其
------	--

	他市场因素，使基金管理人无法依指数权重购买某成份股； 3) 本基金资产规模过大导致本基金持有某些股票比例过高； 4) 成份股上市公司存在重大虚假陈述等违规行为、或者面临重大的不利行政处罚或司法诉讼； 5) 预期标的指数的成份股即将调整。 为了减小跟踪误差，本基金按照主营业务相近、市值相近、相关性较高及 β 值相近等原则来选择替代股票。 (2) 股票组合调整方法 本基金将采用完全复制法构建股票投资组合，根据中证 500 等权重指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。同时，本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增发等因素的变化，对股票投资组合进行适时调整，以保证基金净值增长率与中证 500 等权重指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。 3、债券投资策略 本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等流动性好的债券。本基金对债券进行配置的原则是：安全性与流动性优先，且兼顾收益性。 本基金在满足安全性与流动性的前提下，通过对国内外宏观经济形势的把握和系统分析国内财政政策与货币市场政策等因素变化对债券市场的影响，审慎研判债券市场风险收益特征的变化趋势，采取自上而下的策略构造组合，进行个券选择。		
业绩比较基准	$95\% \times \text{中证 500 等权重指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行人民币活期存款利率 (税后)}$		
风险收益特征	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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
注册登记机构	西部利得基金管理有限公司	上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 11 楼

§ 3 主要财务指标、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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019 年	2018 年	2017 年
本期已实现收益	43,835,387.58	-25,555,045.94	19,943,588.11
本期利润	85,200,190.53	-52,505,510.19	8,926,832.94
加权平均基金份额本期利润	0.3084	-0.2405	0.0425
本期加权平均净值利润率	33.96%	-27.25%	4.20%
本期基金份额净值增长率	35.68%	-23.27%	4.30%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
期末可供分配利润	-234,601,678.09	-178,749,581.26	-147,600,260.10
期末可供分配基金份额利润	-0.6097	-0.8433	-0.6953
期末基金资产净值	389,106,677.58	158,506,026.32	216,102,511.80
期末基金份额净值	1.0113	0.7478	1.0180
3.1.3 累计期末指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值增长率	-35.05%	-52.13%	-37.61%

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
过去三个月	8.34%	0.74%	6.18%	0.86%	2.16%	-0.12%
过去六个月	12.72%	0.87%	4.85%	1.01%	7.87%	-0.14%
过去一年	35.68%	1.20%	23.64%	1.41%	12.04%	-0.21%

过去三年	8.43%	1.15%	-17.94%	1.27%	26.37%	-0.12%
自基金合同生效起至今	-35.05%	1.61%	-32.01%	1.78%	-3.04%	-0.17%

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

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

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$\text{benchmark}(0)=1000$;

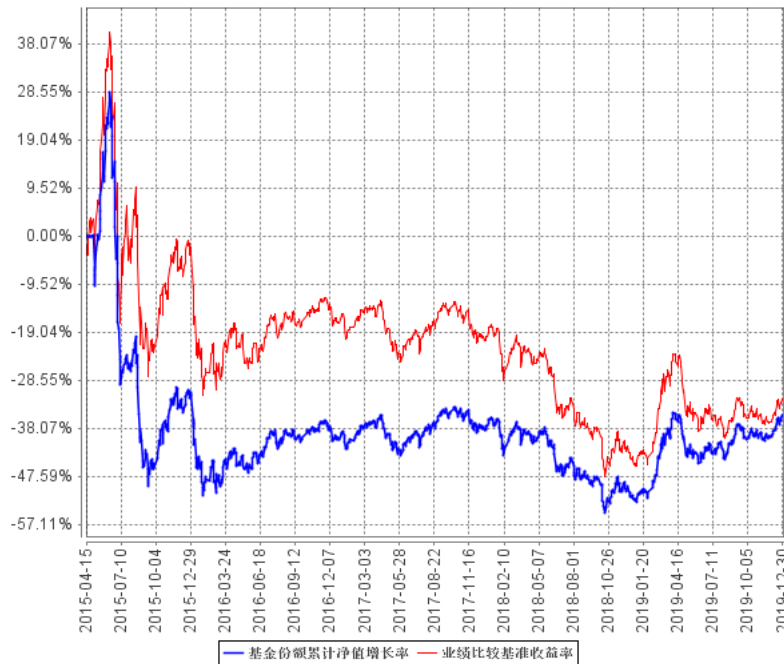
$\%\text{benchmark}(t) = 95\% * (\text{中证 500 等权重指数收益率}(t) / \text{中证 500 等权重指数收益率}(t-1) - 1) + 5\% * \text{商业银行人民币活期存款利率} / 365$;

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

其中 $t=1, 2, 3, \dots$ 。

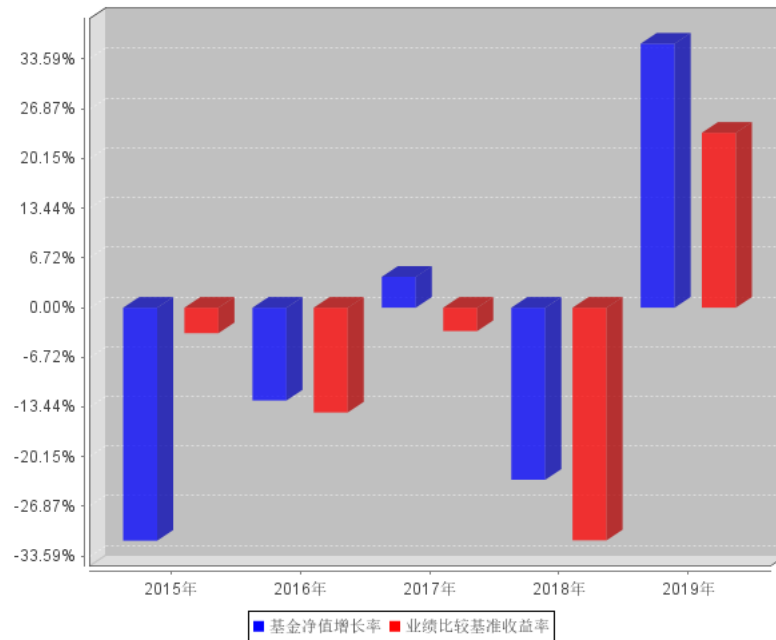
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1. 本基金的基金合同于 2015 年 4 月 15 日生效，截至报告期末，本基金运作未满五年。

2. 本基金基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金过往三年未进行过利润分配。

§ 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于 2010 年 7 月 20 日正式成立，公司总部设在上海，在北京、深圳设有分公司，注册资本人民币 35000.00 万元整，是经中国证监会批准设立的第 60 家全国规范性基金管理公司，自成立以来逐步成长为一家以绝对收益产品为特色的资产管理人。目前公司拥有公募基金、特定客户资产管理业务、受托管理保险资金等资格。

公司在“绝对收益”领域采取稳步推进策略，在“固收+”策略基础上，逐渐完善公司产品线布局，致力成为行业基础产品供应商。西部利得基金始终将投资人利益放首位，为投资人提供多样化的资产配置解决方案。

公司一直坚持“专业、诚信”的经营理念，成立至今已发行了货币型、债券型、混合型、指数型、股票型等多种类型的基金产品共 35 只，形成了较为完善的产品线。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
盛丰衍	基金经理	2016 年 11 月 24 日	—	7 年	复旦大学计算机应用技术硕士，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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人已根据《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》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，制定了公司《投资管理制度》、《交易部部门规章》、《公平交易管理办法》及《异常交易监控办法》并遵守上述制度和流程；严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的各个环节公平对待不同投资组合；严禁直接或者间接通过与第三方的交易安排等在不同投资组合之间进行利益输送，通过系统和人工等方式在各环节严格控制公平交易执行，以公平对待投资人。

控制方法包括：1. 研究环节：公募基金投资和专户投资共用研究平台、共享信息。2. 投资及授权环节：公司建立不同投资组合层面的投资对象与交易对手备选库。公司建立了分层投资授权制度，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。3. 交易环节：为确保交易的公平执行，将公司投资组合的投资决策过程和交易执行过程分开，各投资组合的所有证券买卖活动须通过交易部集中统一完成。（1）所有交易所指令必须通过系统下达，通过系统方式进行公平交易。（2）对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配制度，在参与申购之前，各投资组合经理独立地确定申购价格和数量，并将申购指令下达给交易部。交易部以价格优先、比例分配原则进行分配。（3）对于银行间交易，交易部在银行间市场上按照时间优先、价格优先的原则进行分配。

此外，公司通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。公司建立异常交易监控及报告制度，通过事前监控、事中监控、事后监控三个异常交易监控体系环节，建立异常交易行为日常监控和分析评估制度、异常交易分析报告和信息披露，进一步规范和完善投资和交易管理，以确保公司管理的不同投资组合获得公平对待。

4.3.2 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。

4.3.3 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

在投资管理上，本基金运作严格按照基金合同的各项要求，主要依据指数投资方法进行投资管理。本基金于 2016 年 11 月底开始参与网下打新。2019 年基金规模始终维持在 2 个亿以上，符合网下打新的沪深两市市值要求。公募基金网下打新属于 A 类投资者，新股获配中签率高于 B 类及 C 类投资者。2019 年 7 月 22 日科创板鸣锣开板，本基金增加科创板新股打新策略。在基金规模满足网下打新要求的前提下，本基金将继续参与网下打新，追求低风险的收益增厚。我们根据日常申赎情况，对股票仓位及头寸进行了及时且合理的安排，将跟踪误差控制在合理水平。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内基金业绩表现参见本报告第三部分“主要财务指标和基金净值表现”。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2020 年，预计政策暖风频吹，上市公司盈利探明底部区域。三股正向力量将托底指数并抬升其中枢，两股不确定力量将扰动指数，预计 A 股指数震荡上行，成长风格更受资金追捧。

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

正向力量其二是国内居民大类资产配置将出现拐点，长期增配股票。房地产政策调控还原其居住属性、消弱其金融属性，地产可投资性下降，随着房产税逐步推进，对房地产资产稳定保值增值的预期或扭转；P2P 等保本保息高收益产品风险凸显，风险事件频发，这将降低居民对此类资产的风险偏好；国内居民大类资产配置将逐步流入股市。2019 年公募偏股类基金业绩亮眼，2020 年或有更多的居民财富通过公募渠道入市，这些资金一方面成为增量资金抬升指数中枢，另一方面其对成长股的追捧也会影响 A 股风格。

正向力量其三是中国改革将持续释放红利。中国经济正从高速发展向高质量发展切换，中国制造将逐步升级为中国智造和中国创造。中国深化改革的成果终将逐步提升市场风险偏好。

扰动力量之一新冠肺炎疫情。疫情对中国经济造成负面冲击，且冲击程度或比 2003 年 SARS 更为严重。2020 年是决胜小康的关键一年，政府将出台一系列政策对冲疫情造成的冲击，包括货币政策、财政政策和地产政策。虽然疫情对中国经济的影响是负面的，但由于随之而来的政策面利好及流动性宽松，对 A 股的影响整体偏中性，扰动更多在影响节奏上。

扰动力量之二是中美摩擦。2018 年中美摩擦从贸易领域开始逐步升温 and 扩散，虽然 2019 年四季度中美倾向于在关税问题上达成第一阶段协议，但两国之间的摩擦不会因一次会议一份协议而停止。2019 年 4 季度外部环境缓和是支撑市场上涨的原因之一，但 2020 年或再起波澜。值得欣慰的是从政府到市场对外部冲击已逐步脱敏，政府储备了足够的政策工具箱，市场也从数次探底回升中对未来越发乐观。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人始终坚持基金份额持有人利益优先原则，从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实。公司监察稽核部依据法律法规的规定及公司内部控制的整体要求，独立对公司经营、旗下投资组合及员工行为等的合规性进行了定期和不定期检查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，并定期向监管机构、公司董事会出具监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人的监察稽核主要工作如下：

- 一、结合公司业务开展的实际情况，进一步完善公司各项内部制度和细化各项业务流程；
- 二、落实内部监察稽核工作，对公司业务流程及管理的各项环节进行定期及不定期稽核；
- 三、根据法律法规及时、准确、完整的披露与本基金有关的各项法定信息披露文件，并在指定报刊和公司网站进行披露，确保基金投资人和公众及时、准确和完整地获取公司和本基金的各项公开信息；
- 四、继续加强反洗钱工作力度，进一步落实洗钱风险自评估工作和反洗钱异常报告筛选，并进一步完善工作流程。监察稽核部定期和不定期地向各监管机构按时提交报备各类反洗钱报告，并不断贯彻落实反洗钱法规及监管要求；
- 五、落实各项合规工作，确保公司各项业务及管理符合法律法规要求；
- 六、其他各类监察稽核工作。

4.7 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管理部、风险控制岗、监察稽核部、基金运营部等有关人员组成。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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场债券品种的估值数据及交易所交易的债券品种的估值数据、流通受限股票流动性折扣。

4.8 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“7.4.11 利润分配情况”。

4.9 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以及基金资产

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合规守信情况声明

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合规守信、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2000510 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的第 1 页至第 37 页西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金（以下简称“西部利得中证 500 等权重基金”）财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表、2019 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了西部利得中证 500 等权重基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果及基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于西部利得中证 500 等权重基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	管理人西部利得基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）对其他信息负责。其他信息包括西部利得中证 500 等权重基金 2019 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估西部利得中证 500 等权重基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非西部利得中证 500 等权重基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督西部利得中证 500 等权重基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对西部利得中证 500 等权重

	基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致西部利得中证 500 等权重基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	黄小熠	欧梦澈
会计师事务所的地址	上海市静安区南京西路 1266 号 2 幢 25 层	
审计报告日期	2020 年 3 月 25 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	45,723,770.36	5,283,083.22
结算备付金		526,894.10	210,084.75
存出保证金		85,631.97	50,992.13
交易性金融资产	7.4.7.2	374,211,131.20	153,237,940.24
其中：股票投资		369,208,131.20	150,240,640.24
基金投资		-	-
债券投资		5,003,000.00	2,997,300.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	48,348.82
应收利息	7.4.7.5	121,382.50	55,161.54
应收股利		-	-
应收申购款		48,666.53	54,808.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	370.00	-
资产总计		420,717,846.66	158,940,418.89
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负 债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		30,664,613.45	56,705.62
应付赎回款		105,278.18	7,788.21
应付管理人报酬		293,425.09	138,871.14
应付托管费		58,685.01	27,774.24
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	268,795.25	43,224.01
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	220,372.10	160,029.35
负债合计		31,611,169.08	434,392.57
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	591,615,656.75	337,255,607.58
未分配利润	7.4.7.10	-202,508,979.17	-178,749,581.26
所有者权益合计		389,106,677.58	158,506,026.32
负债和所有者权益总计		420,717,846.66	158,940,418.89

7.2 利润表

会计主体：西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

一、收入		89,945,630.78	-49,052,750.40
1.利息收入		352,758.76	264,811.72
其中：存款利息收入	7.4.7.11	243,376.59	131,112.35
债券利息收入		109,382.17	133,699.37
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）		48,161,723.70	-22,402,900.07
其中：股票投资收益	7.4.7.12	44,884,404.81	-24,780,184.77
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	42,216.76	4,686.50
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	3,235,102.13	2,372,598.20
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	41,364,802.95	-26,950,464.25
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	66,345.37	35,802.20
减：二、费用		4,745,440.25	3,452,759.79
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,499,591.21	1,923,767.63
2. 托管费	7.4.10.2.2	499,918.29	384,753.54
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,315,225.91	773,608.62
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		2.24	-

7. 其他费用	7.4.7.20	430,702.60	370,630.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		85,200,190.53	-52,505,510.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		85,200,190.53	-52,505,510.19

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	337,255,607.58	-178,749,581.26	158,506,026.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	85,200,190.53	85,200,190.53
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）	254,360,049.17	-108,959,588.44	145,400,460.73
其中：1. 基金申购款	364,728,212.71	-151,864,925.79	212,863,286.92
2. 基金赎回款	-110,368,163.54	42,905,337.35	-67,462,826.19
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）	591,615,656.75	-202,508,979.17	389,106,677.58
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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）	346,175,319.33	-130,072,807.53	216,102,511.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-52,505,510.19	-52,505,510.19
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）	-8,919,711.75	3,828,736.46	-5,090,975.29
其中：1. 基金申购款	49,592,176.86	-22,592,193.80	26,999,983.06
2. 基金赎回款	-58,511,888.61	26,420,930.26	-32,090,958.35
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）	337,255,607.58	-178,749,581.26	158,506,026.32

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 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《关于准予西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金注册的批复》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。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》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》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)。

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%×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)。

7.4.2 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<年度和中期报告>》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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 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 2019 年 12

月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于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。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终

止；(2) 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；或者(3) 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。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管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。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

在存续期内，本基金（包括西部利得中证 500 等权重、西部利得中证 500 等权重 A、西部利得中证 500 等权重 B）不进行收益分配。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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[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]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(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）运营资管产品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。对资管产品在 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、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(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) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，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，暂免征收个人所得税。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% 计入个人所得税应纳税所得额。

(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) 对投资者从证券投资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，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	45,723,770.36	5,283,083.22
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：	45,723,770.36	5,283,083.22

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2019 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		359,292,946.46	369,208,131.20	9,915,184.74
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	4,996,400.00	5,003,000.00	6,600.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	4,996,400.00	5,003,000.00	6,600.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		364,289,346.46	374,211,131.20	9,921,784.74
项目		上年度末 2018 年 12 月 31 日		

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		181,688,458.45	150,240,640.24	-31,447,818.21
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	2,992,500.00	2,997,300.00	4,800.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	2,992,500.00	2,997,300.00	4,800.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		184,680,958.45	153,237,940.24	-31,443,018.21

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	9,292.39	3,054.23
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	260.81	103.95
应收债券利息	110,436.99	51,978.08

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	1,349.96	0.09
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	42.35	25.19
合计	121,382.50	55,161.54

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
其他应收款	370.00	-
待摊费用	-	-
合计	370.00	-

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	268,795.25	43,224.01
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	268,795.25	43,224.01

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	372.10	29.35

预提费用	170,000.00	110,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	220,372.10	160,029.35

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	211,954,297.39	337,255,607.58
本期申购	1,883.39	2,996.75
本期赎回（以“-”号填列）	-13,578.50	-21,605.35
2019 年 1 月 2 日 基金拆分/份额折算前	211,942,602.28	337,236,998.98
基金拆分/份额折算变动份额	7,388,107.50	-
本期申购	237,211,675.09	364,725,215.96
本期赎回（以“-”号填列）	-71,766,317.54	-110,346,558.19
本期末	384,776,067.33	591,615,656.75

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 截至 2019 年 12 月 31 日止，本基金于上交所上市的基金份额为 4,166,343.00 份（其中基础份额 1,286,271.00 份，A 份额 1,440,036.00 份，B 份额 1,440,036.00 份），托管在场外未上市交易的基金份额为 380,609,724.33。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。基础份额与 A 份额、B 份额之间可以按约定的规则进行场内份额配对转换，包括基金份额的分拆和合并两种转换行为。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-168,573,549.37	-10,176,031.89	-178,749,581.26
本期利润	43,835,387.58	41,364,802.95	85,200,190.53

本期基金份额交易产生的变动数	-109,825,363.66	865,775.22	-108,959,588.44
其中：基金申购款	-163,887,323.84	12,022,398.05	-151,864,925.79
基金赎回款	54,061,960.18	-11,156,622.83	42,905,337.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-234,563,525.45	32,054,546.28	-202,508,979.17

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
活期存款利息收入	214,174.61	121,399.75
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	7,310.71	4,867.87
其他	21,891.27	4,844.73
合计	243,376.59	131,112.35

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
卖出股票成交总额	481,505,516.35	345,476,789.20
减：卖出股票成本总额	436,621,111.54	370,256,973.97
买卖股票差价收入	44,884,404.81	-24,780,184.77

7.4.7.13 债券投资收益**7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31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	42,216.76	4,686.50
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	42,216.76	4,686.50

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,741,859.83	9,452,013.60
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,622,500.00	9,143,313.50
减：应收利息总额	77,143.07	304,013.60
买卖债券差价收入	42,216.76	4,686.50

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金于本报告期及上年度可比期间均无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金于本报告期及上年度可比期间均无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未投资资产支持证券，资产支持证券投资收益为零。

7.4.7.14 贵金属投资收益**7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未持有贵金属。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未持有贵金属。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未持有贵金属。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未持有贵金属。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未持有衍生工具。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未持有衍生工具。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	3,235,102.13	2,372,598.20
基金投资产生的股利收益	—	—
合计	3,235,102.13	2,372,598.20

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
------	----	---------

	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	41,364,802.95	-26,950,464.25
——股票投资	41,363,002.95	-26,963,999.75
——债券投资	1,800.00	13,535.50
——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	41,364,802.95	-26,950,464.25

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	66,345.37	35,802.20
合计	66,345.37	35,802.20

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	1,315,225.91	773,608.62
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	1,315,225.91	773,608.62

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	60,000.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
上市费用	60,000.00	60,000.00
银行汇划费用	702.60	630.00
合计	430,702.60	370,630.00

7.4.7.21 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。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同》的规定，本基金对截至 2020 年 1 月 2 日止登记在册的基础份额场外份额、场内份额以及 A 份额进行定期份额折算。份额折算方式为 A 份额和 B 份额按照基金合同规定的净值计算规则进行净值计算，对 A 份额的应得收益进行定期份额折算，每 2 份基础份额将按 1 份 A 份额获得约定应得收益的新增折算份额。折算完成后，A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元，基础份额的基金份额净值相应调整。

根据持有人大会决议，本基金以 2020 年 2 月 17 日为基金份额折算、转换基准日，对在该日登记在册的 500 等权重份额、500 等权重 A 份额及 500 等权重 B 份额办理折算、转换业务。份额转换方式为以 500 等权重份额净值为基准，将 500 等权重 A 份额、500 等权重 B 份额按照各自的基金份额参考净值转换成 500 等权重份额的场内份额，再在保持基金资产净值总额不变的前提下，将 500 等权重份额的场内份额和场外份额统一转换为份额净值为 1.0000 元的 500 增强份额。基金份额转换后，西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金份额持有人成为西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金份额持有人，基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，转换后西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）的份额净值为 1.0000 元，基金份额转换对持有人的权益无实质性影响。

7.4.9 关联方关系

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

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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	-	-	45,592,895.72	6.67%

7.4.10.1.2 债券交易

本基金于本报告期内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。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31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	24,223.04	6.59%	-	-

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

	月 31 日	日
当期发生的基金应支付的管理费	2,499,591.21	1,923,767.63
其中：支付销售机构的客户维护费	37,476.04	12,211.61

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

日基金管理费=前一日基金资产净值×1%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	499,918.29	384,753.54

注：1. 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。

7.4.10.2.3 销售服务费

注：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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本报告期内未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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

本报告期末及上年度期末，无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期		上年度可比期间	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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	45,723,770.36	214,174.61	5,283,083.22	121,399.75

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

2. 本基金通过“兴业银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2019 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 526894.1 元。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2019 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通 受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单位： 股)	期末 成本总额	期末估值总额	备注
688181	八亿 时空	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 6 日	新股 流通 受限	43.98	43.98	4,306	189,377.88	189,377.88	-
688081	兴图 新科	2019 年 12 月	2020 年 1	新股 流通	28.21	28.21	3,153	88,946.13	88,946.13	-

		26 日	月 6	受限						
		日	日							
002973	侨银 环保	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 6 日	新股 流通 受限	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-
601916	浙商 银行	2019 年 11 月 18 日	2019 年 5 月 26 日	IPO 老 股转 让限 售	4.94	4.66	294,195	1,453,323.30	1,370,948.70	-
688321	微芯 生物	2019 年 8 月 2 日	2020 年 2 月 12 日	网下 配售 摇号 锁定	20.43	53.69	13,328	272,291.04	715,580.32	-
688388	嘉元 科技	2019 年 7 月 16 日	2020 年 1 月 22 日	网下 配售 摇号 锁定	28.26	54.83	7,292	206,071.92	399,820.36	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持暂时停牌股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

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

7.4.13.2 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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行——兴业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	—	—
A-1 以下	—	—
未评级	5,003,000.00	—
合计	5,003,000.00	—

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

7.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	45,723,770.36	-	-	-	45,723,770.36
结算备付金	526,894.10	-	-	-	526,894.10
存出保证金	85,631.97	-	-	-	85,631.97
交易性金融资产	5,003,000.00	-	-	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	51,339,666.43	-	-	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	51,339,666.43	-	-	337,767,011.15	389,106,677.58
上年度末 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,283,083.22	-	-	-	5,283,083.22
结算备付金	210,084.75	-	-	-	210,084.75
存出保证金	50,992.13	-	-	-	50,992.13
交易性金融资产	2,997,300.00	-	-	150,240,640.24	153,237,940.24
应收证券清算款	-	-	-	48,348.82	48,348.82
应收利息	-	-	-	55,161.54	55,161.54

应收申购款	7.76	-	-	54,800.43	54,808.19
资产总计	8,541,467.86	-	-	150,398,951.03	158,940,418.89
负债					
应付证券清算款	-	-	-	56,705.62	56,705.62
应付赎回款	-	-	-	7,788.21	7,788.21
应付管理人报酬	-	-	-	138,871.14	138,871.14
应付托管费	-	-	-	27,774.24	27,774.24
应付交易费用	-	-	-	43,224.01	43,224.01
其他负债	-	-	-	160,029.35	160,029.35
负债总计	-	-	-	434,392.57	434,392.57
利率敏感度缺口	8,541,467.86	-	-	149,964,558.46	158,506,026.32

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：投资于中证 500 等权重指数成分股及备选成分股的资产不低于基金资产净值的 90%且不低于非现金资产的 80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运

用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		上年度末 2018 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	369,208,131.20	94.89	150,240,640.24	94.79
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	5,003,000.00	1.29	2,997,300.00	1.89
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	374,211,131.20	96.17	153,237,940.24	96.68

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

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019 年 12 月 31 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	17,409,000.00	7,060,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-17,409,000.00	-7,060,000.00

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为 366,436,879.77 元，属于第二层级的余额为 7,774,251.43 元，无属于第三层级的余额（2018 年 12 月 31 日，第一层级余额为 149,060,419.07 元，属于第二层级的余额为 4,177,521.17 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 2019 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	369,208,131.20	87.76
	其中：股票	369,208,131.20	87.76
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,003,000.00	1.19
	其中：债券	5,003,000.00	1.19
	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	46,250,664.46	10.99
8	其他各项资产	256,051.00	0.06
9	合计	420,717,846.66	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,178,074.00	0.30
B	采矿业	16,261,777.46	4.18
C	制造业	194,614,544.84	50.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,113,383.29	3.37
E	建筑业	9,219,357.02	2.37
F	批发和零售业	21,439,516.76	5.51
G	交通运输、仓储和邮政业	17,077,564.30	4.39
H	住宿和餐饮业	353,646.00	0.09

I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,501,185.29	6.55
J	金融业	17,702,571.67	4.55
K	房地产业	18,075,931.10	4.65
L	租赁和商务服务业	6,339,735.45	1.63
M	科学研究和技术服务业	2,155,588.00	0.55
N	水利、环境和公共设施管理业	3,350,224.18	0.86
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	628,144.00	0.16
Q	卫生和社会工作	2,924,686.50	0.75
R	文化、体育和娱乐业	14,510,269.00	3.73
S	综合	1,934,783.18	0.50
	合计	366,380,982.04	94.16

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	1,449,622.42	0.37
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	1,370,948.70	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	6,578.04	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	2,827,149.16	0.73

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金于本报告期末未持有港股通股票。

8.3 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

8.3.1 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	600486	扬农化工	29,100	1,997,133.00	0.51
2	601233	桐昆股份	126,300	1,893,237.00	0.49
3	002353	杰瑞股份	50,400	1,862,784.00	0.48
4	603712	七一二	75,200	1,818,336.00	0.47
5	601966	玲珑轮胎	77,700	1,781,661.00	0.46
6	600862	中航高科	160,500	1,768,710.00	0.45
7	002064	华峰氨纶	277,700	1,735,625.00	0.45
8	600026	中远海能	267,100	1,704,098.00	0.44
9	002273	水晶光电	105,200	1,700,032.00	0.44
10	002028	思源电气	122,800	1,690,956.00	0.43

11	002048	宁波华翔	108,500	1,677,410.00	0.43
12	600141	兴发集团	162,800	1,673,584.00	0.43
13	000501	鄂武商 A	125,800	1,670,624.00	0.43
14	600737	中粮糖业	197,200	1,668,312.00	0.43
15	000528	柳工	238,910	1,658,035.40	0.43
16	002463	沪电股份	74,500	1,654,645.00	0.43
17	002384	东山精密	71,250	1,649,437.50	0.42
18	000686	东北证券	177,000	1,646,100.00	0.42
19	002128	露天煤业	186,600	1,615,956.00	0.42
20	600058	五矿发展	199,400	1,599,188.00	0.41
21	601717	郑煤机	246,300	1,593,561.00	0.41
22	601139	深圳燃气	202,300	1,584,009.00	0.41
23	600060	海信视像	145,800	1,581,930.00	0.41
24	600380	健康元	151,700	1,570,095.00	0.40
25	600985	淮北矿业	155,600	1,554,444.00	0.40
26	600777	新潮能源	738,900	1,551,690.00	0.40
27	600729	重庆百货	51,800	1,546,230.00	0.40
28	300014	亿纬锂能	30,800	1,544,928.00	0.40
29	000877	天山股份	129,500	1,534,575.00	0.39
30	002051	中工国际	157,248	1,528,450.56	0.39
31	600143	金发科技	209,400	1,524,432.00	0.39
32	300166	东方国信	117,100	1,522,300.00	0.39
33	000401	冀东水泥	89,300	1,518,993.00	0.39
34	002444	巨星科技	141,400	1,518,636.00	0.39
35	600657	信达地产	379,000	1,512,210.00	0.39
36	002152	广电运通	157,200	1,510,692.00	0.39
37	600755	厦门国贸	205,100	1,505,434.00	0.39
38	600373	中文传媒	109,400	1,488,934.00	0.38

39	600376	首开股份	186,800	1,488,796.00	0.38
40	002926	华西证券	135,200	1,488,552.00	0.38
41	600597	光明乳业	117,200	1,487,268.00	0.38
42	600763	通策医疗	14,500	1,486,685.00	0.38
43	000983	西山煤电	242,500	1,486,525.00	0.38
44	600908	无锡银行	266,913	1,481,367.15	0.38
45	601179	中国西电	406,600	1,480,024.00	0.38
46	002818	富森美	116,667	1,475,837.55	0.38
47	601001	大同煤业	335,200	1,474,880.00	0.38
48	601969	海南矿业	253,800	1,469,502.00	0.38
49	600557	康缘药业	99,680	1,469,283.20	0.38
50	600307	酒钢宏兴	713,100	1,468,986.00	0.38
51	600582	天地科技	459,400	1,465,486.00	0.38
52	600820	隧道股份	242,000	1,461,680.00	0.38
53	603707	健友股份	35,200	1,460,096.00	0.38
54	601718	际华集团	447,000	1,457,220.00	0.37
55	600823	世茂股份	323,361	1,455,124.50	0.37
56	603939	益丰药房	19,858	1,454,002.76	0.37
57	600694	大商股份	53,005	1,451,806.95	0.37
58	600266	城建发展	178,260	1,443,906.00	0.37
59	000997	新大陆	90,800	1,441,904.00	0.37
60	600166	福田汽车	689,900	1,441,891.00	0.37
61	600718	东软集团	126,700	1,438,045.00	0.37
62	603882	金域医学	28,075	1,438,001.50	0.37
63	600728	佳都科技	153,300	1,437,954.00	0.37
64	002603	以岭药业	115,300	1,433,179.00	0.37
65	000937	冀中能源	390,951	1,430,880.66	0.37
66	002302	西部建设	126,600	1,429,314.00	0.37

67	002745	木林森	104,400	1,420,884.00	0.37
68	000301	东方盛虹	273,300	1,415,694.00	0.36
69	002174	游族网络	60,800	1,414,816.00	0.36
70	600565	迪马股份	393,500	1,408,730.00	0.36
71	603568	伟明环保	61,397	1,408,447.18	0.36
72	002110	三钢闽光	150,450	1,408,212.00	0.36
73	600410	华胜天成	136,200	1,404,222.00	0.36
74	600415	小商品城	361,300	1,398,231.00	0.36
75	603806	福斯特	28,760	1,397,736.00	0.36
76	002221	东华能源	179,790	1,395,170.40	0.36
77	600062	华润双鹤	106,800	1,393,740.00	0.36
78	300251	光线传媒	118,100	1,393,580.00	0.36
79	600528	中铁工业	121,100	1,392,650.00	0.36
80	600120	浙江东方	158,377	1,382,631.21	0.36
81	601811	新华文轩	104,800	1,382,312.00	0.36
82	000402	金融街	170,200	1,382,024.00	0.36
83	002366	台海核电	198,200	1,379,472.00	0.35
84	300207	欣旺达	70,500	1,376,160.00	0.35
85	600348	阳泉煤业	248,300	1,373,099.00	0.35
86	600567	山鹰纸业	364,100	1,372,657.00	0.35
87	000623	吉林敖东	83,000	1,371,990.00	0.35
88	300324	旋极信息	243,700	1,364,720.00	0.35
89	600757	长江传媒	221,500	1,364,440.00	0.35
90	000930	中粮科技	206,600	1,363,560.00	0.35
91	002217	合力泰	245,400	1,361,970.00	0.35
92	600138	中青旅	108,000	1,360,800.00	0.35
93	002244	滨江集团	275,600	1,355,952.00	0.35
94	000078	海王生物	363,175	1,354,642.75	0.35

95	603766	隆鑫通用	362,950	1,353,803.50	0.35
96	002925	盈趣科技	30,800	1,353,660.00	0.35
97	600909	华安证券	185,100	1,351,230.00	0.35
98	002807	江阴银行	289,800	1,350,468.00	0.35
99	000729	燕京啤酒	206,900	1,348,988.00	0.35
100	000050	深天马 A	82,800	1,348,812.00	0.35
101	603198	迎驾贡酒	67,384	1,342,289.28	0.34
102	000027	深圳能源	215,729	1,339,677.09	0.34
103	600325	华发股份	171,000	1,338,930.00	0.34
104	601801	皖新传媒	244,200	1,338,216.00	0.34
105	603225	新凤鸣	108,000	1,333,800.00	0.34
106	601611	中国核建	186,800	1,331,884.00	0.34
107	603983	丸美股份	22,000	1,320,660.00	0.34
108	603233	大参林	25,210	1,317,222.50	0.34
109	000750	国海证券	246,600	1,316,844.00	0.34
110	600563	法拉电子	26,580	1,314,381.00	0.34
111	300009	安科生物	87,020	1,313,131.80	0.34
112	601168	西部矿业	198,300	1,312,746.00	0.34
113	002131	利欧股份	439,900	1,306,503.00	0.34
114	601019	山东出版	187,900	1,305,905.00	0.34
115	601678	滨化股份	255,100	1,303,561.00	0.34
116	600717	天津港	207,560	1,303,476.80	0.33
117	600260	凯乐科技	96,040	1,303,262.80	0.33
118	600827	百联股份	145,035	1,302,414.30	0.33
119	000778	新兴铸管	309,600	1,291,032.00	0.33
120	002180	纳思达	39,200	1,290,464.00	0.33
121	603328	依顿电子	113,800	1,288,216.00	0.33
122	600388	龙净环保	131,500	1,282,125.00	0.33

123	600664	哈药股份	336,400	1,274,956.00	0.33
124	300296	利亚德	166,100	1,273,987.00	0.33
125	601326	秦港股份	397,100	1,266,749.00	0.33
126	601000	唐山港	484,860	1,260,636.00	0.32
127	000061	农产品	224,500	1,254,955.00	0.32
128	000987	越秀金控	129,400	1,251,298.00	0.32
129	600970	中材国际	178,950	1,247,281.50	0.32
130	600094	大名城	213,100	1,246,635.00	0.32
131	002821	凯莱英	9,600	1,243,200.00	0.32
132	603515	欧普照明	44,000	1,236,840.00	0.32
133	002382	蓝帆医疗	101,800	1,235,852.00	0.32
134	600418	江淮汽车	246,000	1,234,920.00	0.32
135	300012	华测检测	81,100	1,209,201.00	0.31
136	603517	绝味食品	26,000	1,207,700.00	0.31
137	600125	铁龙物流	201,600	1,205,568.00	0.31
138	002223	鱼跃医疗	59,255	1,204,061.60	0.31
139	002373	千方科技	66,400	1,197,856.00	0.31
140	000685	中山公用	145,160	1,196,118.40	0.31
141	600901	江苏租赁	189,200	1,195,744.00	0.31
142	600282	南钢股份	345,100	1,190,595.00	0.31
143	601098	中南传媒	99,300	1,185,642.00	0.30
144	000012	南玻 A	235,780	1,181,257.80	0.30
145	000543	皖能电力	254,410	1,180,462.40	0.30
146	000766	通化金马	179,100	1,171,314.00	0.30
147	000883	湖北能源	280,700	1,170,519.00	0.30
148	002440	闰土股份	103,000	1,153,600.00	0.30
149	600132	重庆啤酒	22,000	1,143,120.00	0.29
150	002544	杰赛科技	83,700	1,139,994.00	0.29

151	600643	爱建集团	118,620	1,138,752.00	0.29
152	600335	国机汽车	194,500	1,128,100.00	0.29
153	603355	莱克电气	47,600	1,126,692.00	0.29
154	000006	深振业 A	210,200	1,126,672.00	0.29
155	601200	上海环境	101,220	1,123,542.00	0.29
156	002065	东华软件	108,800	1,122,816.00	0.29
157	600859	王府井	80,100	1,120,599.00	0.29
158	603868	飞科电器	29,500	1,111,560.00	0.29
159	600017	日照港	379,300	1,103,763.00	0.28
160	600499	科达洁能	254,400	1,101,552.00	0.28
161	000156	华数传媒	105,400	1,100,376.00	0.28
162	601928	凤凰传媒	143,600	1,092,796.00	0.28
163	601958	金钼股份	136,400	1,092,564.00	0.28
164	600161	天坛生物	38,700	1,081,278.00	0.28
165	600598	北大荒	110,900	1,080,166.00	0.28
166	600959	江苏有线	269,500	1,072,610.00	0.28
167	000848	承德露露	135,775	1,068,549.25	0.27
168	002233	塔牌集团	84,000	1,058,400.00	0.27
169	000825	太钢不锈	258,300	1,056,447.00	0.27
170	002831	裕同科技	39,700	1,054,035.00	0.27
171	603556	海兴电力	63,870	1,041,081.00	0.27
172	600875	东方电气	113,200	1,040,308.00	0.27
173	603883	老百姓	16,200	1,038,096.00	0.27
174	002002	鸿达兴业	249,000	1,035,840.00	0.27
175	300376	易事特	225,200	1,031,416.00	0.27
176	600350	山东高速	209,600	1,029,136.00	0.26
177	601699	潞安环能	141,600	1,028,016.00	0.26
178	600521	华海药业	59,300	1,023,518.00	0.26

179	300133	华策影视	138,100	1,021,940.00	0.26
180	000028	国药一致	22,510	1,021,053.60	0.26
181	000581	威孚高科	53,300	1,015,365.00	0.26
182	600782	新钢股份	197,800	1,014,714.00	0.26
183	000598	兴蓉环境	218,700	1,012,581.00	0.26
184	600623	华谊集团	151,700	1,008,805.00	0.26
185	002491	通鼎互联	150,200	992,822.00	0.26
186	600642	申能股份	170,600	991,186.00	0.25
187	000727	华东科技	471,400	985,226.00	0.25
188	300253	卫宁健康	65,000	973,700.00	0.25
189	600037	歌华有线	107,600	969,476.00	0.25
190	002482	广田集团	220,600	966,228.00	0.25
191	002500	山西证券	116,200	963,298.00	0.25
192	600064	南京高科	98,380	959,205.00	0.25
193	603816	顾家家居	20,960	958,500.80	0.25
194	600428	中远海特	255,800	956,692.00	0.25
195	600835	上海机电	57,600	954,432.00	0.25
196	600006	东风汽车	207,900	952,182.00	0.24
197	600645	中源协和	55,900	946,387.00	0.24
198	000807	云铝股份	182,400	937,536.00	0.24
199	600779	水井坊	18,100	936,675.00	0.24
200	000021	深科技	76,400	930,552.00	0.24
201	000887	中鼎股份	101,500	918,575.00	0.24
202	002936	郑州银行	195,400	908,610.00	0.23
203	000878	云南铜业	66,500	908,390.00	0.23
204	002078	太阳纸业	92,300	908,232.00	0.23
205	600466	蓝光发展	123,180	907,836.60	0.23
206	002085	万丰奥威	129,400	905,800.00	0.23

207	002375	亚厦股份	156,100	905,380.00	0.23
208	000008	神州高铁	248,200	900,966.00	0.23
209	000090	天健集团	169,750	899,675.00	0.23
210	300383	光环新网	44,400	891,108.00	0.23
211	000060	中金岭南	205,000	881,500.00	0.23
212	300182	捷成股份	252,200	880,178.00	0.23
213	603885	吉祥航空	58,400	876,000.00	0.23
214	000400	许继电气	81,200	874,524.00	0.22
215	000988	华工科技	43,100	874,499.00	0.22
216	000869	张裕 A	30,400	872,480.00	0.22
217	002203	海亮股份	84,600	867,150.00	0.22
218	002250	联化科技	50,000	856,500.00	0.22
219	002195	二三四五	262,783	848,789.09	0.22
220	601005	重庆钢铁	454,400	840,640.00	0.22
221	002583	海能达	99,800	839,318.00	0.22
222	002815	崇达技术	48,200	833,378.00	0.21
223	002672	东江环保	92,500	832,500.00	0.21
224	002414	高德红外	39,315	825,615.00	0.21
225	600273	嘉化能源	73,200	823,500.00	0.21
226	601866	中远海发	315,000	815,850.00	0.21
227	000826	启迪环境	88,500	812,430.00	0.21
228	601799	星宇股份	8,500	807,330.00	0.21
229	600021	上海电力	99,400	800,170.00	0.21
230	600409	三友化工	125,400	792,528.00	0.20
231	600478	科力远	178,800	786,720.00	0.20
232	000999	华润三九	24,800	785,664.00	0.20
233	600633	浙数文化	85,800	785,070.00	0.20
234	600879	航天电子	130,400	779,792.00	0.20

235	002408	齐翔腾达	108,000	772,200.00	0.20
236	000513	丽珠集团	22,819	769,000.30	0.20
237	600312	平高电气	118,900	768,094.00	0.20
238	300159	新研股份	195,100	764,792.00	0.20
239	600765	中航重机	74,300	760,089.00	0.20
240	600160	巨化股份	103,210	751,368.80	0.19
241	002358	森源电气	107,400	750,726.00	0.19
242	601333	广深铁路	244,300	747,558.00	0.19
243	600426	华鲁恒升	37,486	744,846.82	0.19
244	002129	中环股份	63,000	744,030.00	0.19
245	002013	中航机电	107,100	743,274.00	0.19
246	002340	格林美	152,432	742,343.84	0.19
247	000547	航天发展	72,500	740,950.00	0.19
248	600759	洲际油气	265,740	736,099.80	0.19
249	600801	华新水泥	27,800	734,754.00	0.19
250	300002	神州泰岳	225,120	733,891.20	0.19
251	600073	上海梅林	91,400	728,458.00	0.19
252	600874	创业环保	100,500	722,595.00	0.19
253	002920	德赛西威	23,800	721,854.00	0.19
254	300316	晶盛机电	45,900	721,548.00	0.19
255	600863	内蒙华电	262,000	720,500.00	0.19
256	000563	陕国投 A	161,730	716,463.90	0.18
257	300134	大富科技	46,300	713,946.00	0.18
258	300274	阳光电源	67,600	711,828.00	0.18
259	000813	德展健康	112,001	704,486.29	0.18
260	600079	人福医药	52,000	702,520.00	0.18
261	600704	物产中大	133,000	698,250.00	0.18
262	002019	亿帆医药	42,800	695,500.00	0.18

263	600317	营口港	272,100	693,855.00	0.18
264	002465	海格通信	64,000	693,120.00	0.18
265	601615	明阳智能	56,200	691,260.00	0.18
266	600881	亚泰集团	216,600	690,954.00	0.18
267	600639	浦东金桥	50,400	680,400.00	0.17
268	600039	四川路桥	202,286	679,680.96	0.17
269	000718	苏宁环球	176,400	673,848.00	0.17
270	000559	万向钱潮	125,200	672,324.00	0.17
271	000089	深圳机场	68,500	669,245.00	0.17
272	600845	宝信软件	20,200	664,580.00	0.17
273	600298	安琪酵母	21,600	662,472.00	0.17
274	002038	双鹭药业	50,050	658,157.50	0.17
275	002424	贵州百灵	75,500	657,605.00	0.17
276	002470	金正大	245,600	653,296.00	0.17
277	000536	华映科技	240,600	649,620.00	0.17
278	000932	华菱钢铁	135,300	646,734.00	0.17
279	002385	大北农	129,400	644,412.00	0.17
280	603317	天味食品	14,300	642,070.00	0.17
281	600787	中储股份	123,200	641,872.00	0.16
282	002690	美亚光电	16,200	633,420.00	0.16
283	002419	天虹股份	59,650	629,307.50	0.16
284	601880	大连港	309,650	628,589.50	0.16
285	603377	东方时尚	34,400	628,144.00	0.16
286	000039	中集集团	62,520	613,946.40	0.16
287	300001	特锐德	35,700	613,326.00	0.16
288	000062	深圳华强	43,000	612,320.00	0.16
289	002439	启明星辰	18,000	608,400.00	0.16
290	000681	视觉中国	35,200	606,848.00	0.16

291	600575	淮河能源	234,500	602,665.00	0.15
292	600497	驰宏锌锗	135,200	592,176.00	0.15
293	000738	航发控制	44,500	581,615.00	0.15
294	600839	四川长虹	195,700	569,487.00	0.15
295	600329	中新药业	40,900	566,874.00	0.15
296	002127	南极电商	51,400	560,774.00	0.14
297	000758	中色股份	127,800	559,764.00	0.14
298	000600	建投能源	113,500	555,015.00	0.14
299	600291	西水股份	61,500	552,885.00	0.14
300	002665	首航节能	163,800	550,368.00	0.14
301	600435	北方导航	64,200	534,144.00	0.14
302	002503	搜于特	223,200	533,448.00	0.14
303	000830	鲁西化工	50,700	532,857.00	0.14
304	600316	洪都航空	40,670	529,930.10	0.14
305	600158	中体产业	51,600	517,548.00	0.13
306	300529	健帆生物	7,200	517,248.00	0.13
307	002266	浙富控股	119,900	493,988.00	0.13
308	603866	桃李面包	11,620	493,152.80	0.13
309	002056	横店东磁	60,100	492,820.00	0.13
310	002317	众生药业	38,800	492,760.00	0.13
311	601106	中国一重	168,800	491,208.00	0.13
312	603056	德邦股份	43,900	487,729.00	0.13
313	601228	广州港	125,200	479,516.00	0.12
314	002074	国轩高科	32,600	474,330.00	0.12
315	603650	彤程新材	26,400	459,888.00	0.12
316	000636	风华高科	30,400	452,656.00	0.12
317	002387	维信诺	28,400	451,560.00	0.12
318	300115	长盈精密	25,300	450,087.00	0.12

319	600008	首创股份	135,300	445,137.00	0.11
320	000960	锡业股份	41,700	435,348.00	0.11
321	002092	中泰化学	63,300	429,807.00	0.11
322	002635	安洁科技	25,500	425,085.00	0.11
323	000712	锦龙股份	27,399	416,464.80	0.11
324	600745	闻泰科技	4,500	416,250.00	0.11
325	600545	卓郎智能	67,600	410,332.00	0.11
326	600699	均胜电子	22,880	409,552.00	0.11
327	600996	贵广网络	50,600	407,330.00	0.10
328	601598	中国外运	94,800	403,848.00	0.10
329	601016	节能风电	167,500	403,675.00	0.10
330	000690	宝新能源	69,800	394,370.00	0.10
331	600098	广州发展	59,600	389,784.00	0.10
332	002867	周大生	20,400	388,416.00	0.10
333	002093	国脉科技	44,400	357,864.00	0.09
334	601127	小康股份	30,900	352,260.00	0.09
335	300027	华谊兄弟	75,400	349,102.00	0.09
336	002191	劲嘉股份	30,400	346,864.00	0.09
337	002268	卫士通	13,300	343,007.00	0.09
338	600808	马钢股份	109,100	334,937.00	0.09
339	002812	恩捷股份	6,600	333,300.00	0.09
340	600754	锦江酒店	11,600	333,036.00	0.09
341	002030	达安基因	28,300	325,450.00	0.08
342	600171	上海贝岭	20,600	324,450.00	0.08
343	600804	鹏博士	51,700	316,404.00	0.08
344	002368	太极股份	8,000	311,360.00	0.08
345	000031	大悦城	43,100	309,458.00	0.08
346	603888	新华网	14,400	303,840.00	0.08

347	300088	长信科技	28,939	297,203.53	0.08
348	300199	翰宇药业	51,000	295,800.00	0.08
349	002670	国盛金控	23,091	293,486.61	0.08
350	000426	兴业矿业	57,600	286,272.00	0.07
351	002507	涪陵榨菜	10,700	286,011.00	0.07
352	000553	安道麦 A	28,600	286,000.00	0.07
353	002249	大洋电机	73,500	283,710.00	0.07
354	002281	光迅科技	9,521	283,535.38	0.07
355	300113	顺网科技	10,600	272,314.00	0.07
356	600446	金证股份	13,200	271,656.00	0.07
357	600673	东阳光	25,300	259,072.00	0.07
358	600885	宏发股份	7,120	245,284.00	0.06
359	603000	人民网	11,600	229,564.00	0.06
360	002285	世联行	60,200	225,750.00	0.06
361	601608	中信重工	59,500	221,340.00	0.06
362	601872	招商轮船	24,300	200,718.00	0.05
363	600022	山东钢铁	138,680	198,312.40	0.05
364	600511	国药股份	6,400	174,656.00	0.04
365	002049	紫光国微	3,400	172,856.00	0.04
366	600056	中国医药	13,200	172,260.00	0.04
367	002183	怡亚通	40,300	169,663.00	0.04
368	600500	中化国际	31,510	167,003.00	0.04
369	600580	卧龙电驱	13,720	164,914.40	0.04
370	601068	中铝国际	29,600	163,984.00	0.04
371	002212	南洋股份	8,500	161,585.00	0.04
372	002709	天赐材料	7,560	156,492.00	0.04
373	600195	中牧股份	13,411	154,897.05	0.04
374	600507	方大特钢	14,500	145,870.00	0.04

375	600584	长电科技	6,200	136,276.00	0.04
376	600259	广晟有色	3,900	135,603.00	0.03
377	002434	万里扬	14,200	134,616.00	0.03
378	600640	号百控股	5,200	134,212.00	0.03
379	002004	华邦健康	26,600	131,404.00	0.03
380	002797	第一创业	15,700	129,996.00	0.03
381	601689	拓普集团	7,300	127,239.00	0.03
382	600167	联美控股	9,540	125,546.40	0.03
383	300257	开山股份	11,000	119,680.00	0.03
384	300058	蓝色光标	21,146	119,474.90	0.03
385	603444	吉比特	400	119,396.00	0.03
386	600053	九鼎投资	4,600	116,978.00	0.03
387	600315	上海家化	3,700	114,478.00	0.03
388	600338	西藏珠峰	9,060	113,250.00	0.03
389	002572	索菲亚	4,700	98,465.00	0.03
390	601118	海南橡胶	19,900	97,908.00	0.03
391	600917	重庆燃气	11,300	82,038.00	0.02
392	600460	士兰微	4,700	72,709.00	0.02
393	600707	彩虹股份	15,900	66,780.00	0.02
394	002242	九阳股份	2,500	62,900.00	0.02
395	000009	中国宝安	10,022	62,036.18	0.02
396	600770	综艺股份	11,500	61,985.00	0.02
397	601231	环旭电子	3,200	61,536.00	0.02
398	603659	璞泰来	700	59,605.00	0.02
399	300418	昆仑万维	3,000	50,250.00	0.01
400	600748	上实发展	6,700	39,798.00	0.01
401	600939	重庆建工	7,300	35,113.00	0.01
402	600884	杉杉股份	2,500	33,775.00	0.01

403	300168	万达信息	2,100	32,403.00	0.01
404	600739	辽宁成大	2,100	31,983.00	0.01
405	600258	首旅酒店	1,000	20,610.00	0.01
406	603486	科沃斯	600	12,174.00	0.00
407	000158	常山北明	1,200	8,184.00	0.00
408	603228	景旺电子	160	7,011.20	0.00
409	002573	清新环境	900	5,805.00	0.00
410	300010	立思辰	300	3,873.00	0.00
411	603379	三美股份	100	3,735.00	0.00
412	000970	中科三环	300	3,225.00	0.00
413	000537	广宇发展	400	3,108.00	0.00
414	600216	浙江医药	200	2,670.00	0.00
415	600967	内蒙一机	200	2,126.00	0.00
416	600155	华创阳安	100	1,403.00	0.00
417	000519	中兵红箭	155	1,181.10	0.00
418	002280	联络互动	200	774.00	0.00
419	600572	康恩贝	100	615.00	0.00

8.3.2 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	1,370,948.70	0.35
2	688321	微芯生物	13,328	715,580.32	0.18
3	688388	嘉元科技	7,292	399,820.36	0.10
4	688181	八亿时空	4,306	189,377.88	0.05
5	688081	兴图新科	3,153	88,946.13	0.02
6	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.01

7	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.00
8	688108	赛诺医疗	1,000	16,260.00	0.00
9	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600745	闻泰科技	4,301,906.84	2.71
2	002152	广电运通	3,803,797.00	2.40
3	002273	水晶光电	3,708,561.00	2.34
4	603501	韦尔股份	2,907,898.00	1.83
5	002818	富森美	2,779,823.77	1.75
6	601811	新华文轩	2,661,319.00	1.68
7	000987	越秀金控	2,564,434.00	1.62
8	603712	七一二	2,541,864.00	1.60
9	002064	华峰氨纶	2,441,103.00	1.54
10	600141	兴发集团	2,433,887.00	1.54
11	601231	环旭电子	2,413,645.56	1.52
12	002699	美盛文化	2,376,570.00	1.50
13	600985	淮北矿业	2,374,277.00	1.50
14	603233	大参林	2,353,494.00	1.48
15	002821	凯莱英	2,350,727.00	1.48
16	000636	风华高科	2,332,362.00	1.47
17	600410	华胜天成	2,328,914.00	1.47
18	300088	长信科技	2,304,735.67	1.45
19	300324	旋极信息	2,296,007.00	1.45

20	000988	华工科技	2,292,131.00	1.45
----	--------	------	--------------	------

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。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	600745	闻泰科技	5,486,194.00	3.46
2	601231	环旭电子	3,645,862.00	2.30
3	300088	长信科技	3,583,835.00	2.26
4	002152	广电运通	3,549,381.72	2.24
5	603501	韦尔股份	3,444,485.00	2.17
6	002273	水晶光电	3,213,244.04	2.03
7	300459	金科文化	3,102,377.10	1.96
8	000009	中国宝安	2,747,798.00	1.73
9	300287	飞利信	2,707,232.10	1.71
10	002416	爱施德	2,591,344.03	1.63
11	000860	顺鑫农业	2,495,542.90	1.57
12	002699	美盛文化	2,437,336.00	1.54
13	300010	立思辰	2,430,344.00	1.53
14	002916	深南电路	2,416,434.98	1.52
15	600801	华新水泥	2,376,134.80	1.50
16	688008	澜起科技	2,368,673.62	1.49
17	300134	大富科技	2,271,870.00	1.43
18	002332	仙琚制药	2,258,140.00	1.42
19	600151	航天机电	2,232,167.00	1.41
20	000636	风华高科	2,198,780.00	1.39

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。

8.4.3 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	616,157,285.81
卖出股票收入（成交）总额	481,505,516.35

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	5,003,000.00	1.29
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	5,003,000.00	1.29

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019611	19 国债 01	50,000	5,003,000.00	1.29

8.7 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

本基金于本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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

本基金于本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.10.1 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合约。

8.10.2 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合约。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金于本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	85,631.97
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	121,382.50
5	应收申购款	48,666.53

6	其他应收款	370.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	256,051.00

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金于本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601916	浙商银行	1,370,948.70	0.35	IPO 老股转让限售
2	688321	微芯生物	715,580.32	0.18	网下配售摇号锁定
3	688388	嘉元科技	399,820.36	0.10	网下配售摇号锁定
4	688181	八亿时空	189,377.88	0.05	新股流通受限
5	688081	兴图新科	88,946.13	0.02	新股流通受限

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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	102	14,118.00	200.00	0.01%	1,439,836.00	99.99%
西部利得中证 500 等权重指数分级 B	420	3,428.66	500.00	0.03%	1,439,536.00	99.97%
西部利得中证 500 等权重指数分级	832	459,009.61	375,875,777.49	98.42%	6,020,217.84	1.58%
合计	1,262	304,893.87	375,876,477.49	97.69%	8,899,589.84	2.31%

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）。

9.2 期末上市基金前十名持有人

西部利得中证 500 等权重指数分级 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	蔡小婉	437,700.00	30.40%

2	李惠莲	222,887.00	15.48%
3	余晓敏	219,064.00	15.21%
4	黄晖	127,901.00	8.88%
5	李文刚	98,615.00	6.85%
6	王少男	96,050.00	6.67%
7	刘辉荣	79,300.00	5.51%
8	鲍刚	58,300.00	4.05%
9	王学军	21,100.00	1.47%
10	张寅则	17,000.00	1.18%

西部利得中证 500 等权重指数分级 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	陈法基	280,000.00	19.44%
2	傅伟铮	180,000.00	12.50%
3	常一丹	84,400.00	5.86%
4	欧才	78,494.00	5.45%
5	王玉英	42,448.00	2.95%
6	李秀莲	28,672.00	1.99%
7	高月娥	27,162.00	1.89%
8	黄健	25,000.00	1.74%
9	程明	23,484.00	1.63%
10	樊容波	17,035.00	1.18%

西部利得中证 500 等权重指数分级

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	董景秋	500,000.00	38.87%
2	郭付元	98,625.00	7.67%
3	董万友	61,831.00	4.81%
4	谢丹萍	49,451.00	3.84%
5	王明辉	37,908.00	2.95%
6	王卓	32,506.00	2.53%
7	陈建红	31,449.00	2.44%
8	傅伟铮	29,244.00	2.27%
9	谢康华	27,360.00	2.13%
10	沈惠琴	25,680.00	2.00%

9.3 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	—	—
	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	248,781.91	0.0651%
	合计	248,781.91	0.0647%

9.4 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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	西部利得中证 500 等权重指数 分级 A	西部利得中证 500 等权重指数 分级 B	西部利得中证 500 等权重指数 分级
基金合同生效日(2015 年 4 月 15 日) 基金份额总额	—	—	202,990,676.07
本报告期期初基金份额总额	1,452,436.00	1,452,436.00	209,049,425.39
本报告期基金总申购份额	—	—	237,213,558.48
减:本报告期基金总赎回份额	—	—	71,779,896.04
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-12,400.00	-12,400.00	7,412,907.50
本报告期期末基金份额总额	1,440,036.00	1,440,036.00	381,895,995.33

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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 2019 年 12 月 12 日上午 9:00 起，至 2020 年 1 月 6 日下午 17:00 止，会议审议通过了《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》（以下简称“本次会议议案”）。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。

11.2 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高级管理人员变动如下：

本基金管理人于 2019 年 3 月 8 日发布了西部利得基金总字【2019】第 78 号文件，根据公司 2019 年第一次股东会和第一届董事会第五十一次会议决议，同意刘建武先生辞去公司董事、董事长和法定代表人职务，任命何方先生担任公司董事长及法定代表人职务。

本报告期内基金托管人高级管理人员变动如下：

自 2019 年 1 月 22 日起，叶文煌先生担任基金托管人资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作，吴若曼女士不再担任基金托管人资产托管部总经理。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金进行审计。本报告期应支付毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计费人民币 50,000 元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
海通证券	1	216,344,852.22	20.08%	114,944.89	16.79%	—
东兴证券	2	198,935,935.38	18.47%	103,995.24	15.19%	—
光大证券	2	192,584,117.87	17.88%	152,177.40	22.23%	—
广发证券	1	164,324,845.19	15.25%	120,169.97	17.55%	—
中信建投	2	71,978,955.51	6.68%	57,094.40	8.34%	—
东北证券	2	55,986,568.60	5.20%	24,147.50	3.53%	—
招商证券	2	46,251,931.37	4.29%	33,824.15	4.94%	—
华创证券	2	32,511,862.04	3.02%	10,770.94	1.57%	—
中泰证券	2	30,844,796.73	2.86%	25,641.13	3.75%	—
太平洋证券	2	23,358,256.41	2.17%	14,746.26	2.15%	—
申万宏源	2	22,583,110.82	2.10%	21,011.30	3.07%	—
银河证券	2	14,433,949.34	1.34%	2,328.31	0.34%	—
东吴证券	2	7,136,740.50	0.66%	3,791.70	0.55%	—
华泰证券	1	—	—	—	—	—
方正证券	2	—	—	—	—	—
华金证券	2	—	—	—	—	—
西部证券	2	—	—	—	—	—
平安证券	2	—	—	—	—	—
华西证券	2	—	—	—	—	—

注：1. 基金租用席位的选择标准是：（1）资质雄厚，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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	2,009,849.86	30.05%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	3,012,751.23	45.05%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	1,664,716.76	24.89%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	西部利得基金管理有限公司	中国证监会指定的	2019 年 3 月 27 日

	关于正式设立深圳分公司的公告	媒介	
--	----------------	----	--

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	2019/2/15-2019/9/25	-	63,725,465.21	-	63,725,465.21	16.56%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品	1	2019/1/1-2019/12/31	202,019,373.16	7,042,193.33	55,000,000.00	154,061,566.49	40.04%
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。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准设立的相关文件；
- (2) 本基金《基金合同》；
- (3) 本基金更新的《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。

13.2 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

13.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资人可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.westleadfund.com> 投资人对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人西部利得基金管理有限公司，咨询电话 4007-007-818（免长途话费）或发电子邮件，E-mail:service@westleadfund.com。

西部利得基金管理有限公司

2020 年 3 月 31 日