

# 西部利得多策略优选灵活配置混合型证券 投资基金 2016 年年度报告 摘要

2016 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：二〇一七年三月三十一日

## § 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 30 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 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	西部利得多策略优选混合
场内简称	西部利得多策略优选混合
基金主代码	673030
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 7 月 27 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	482,653,091.40 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过构建有效的投资组合，在严格控制风险的前提下，力求获得长期稳定的收益。
投资策略	<p>1. 大类资产配置策略:本基金采取积极的大类资产配置策略，通过对宏观经济、微观经济运行态势、政策环境、利率走势、证券市场走势及证券市场现阶段的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，实现投资组合动态管理最优化。</p> <p>2. 股票投资策略:本基金以价值投资理念为导向，灵活运用多种股票投资策略，深度挖掘经济结构转型过程中具有核心竞争力和发展潜力的行业和公司，实现基金资产的长期稳定增值。</p> <p>3. 债券投资策略:本基金可投资于国债、金融债、公司债、企业债、可转换债券（含可交换债券）、央行票据、次级债、地方政府债券等债券品种，基金经理通过对收益率、流动性、信用风险和风险溢价等因素的综合评估，合理分配固定收益类证券组合中投资于国债、金融债、企业债、短期金融工具等产品的比例，构造债券组合。</p> <p>4. 股指期货投资策略:在股指期货投资上，本基金以避险保值和有效管理为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。</p> <p>5. 资产支持证券投资策略:本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定</p>

	价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，在通常情况下其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于证券投资基金中等风险水平的投资品种。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

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

## 2.4 信息披露方式

登载基金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

## § 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	2016 年	2015年7月27日(基金合同生效日)-2015年12月31日	2014 年
本期已实现收益	20,024,033.86	-26,779,243.32	-
本期利润	10,238,542.88	-16,295,418.94	-
加权平均基金份额本期利润	0.0058	-0.0027	-
本期基金份额净值增长率	2.01%	-0.30%	-
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0173	-0.0044	-
期末基金资产净值	491,013,658.38	5,485,449,273.54	-
期末基金份额净值	1.017	0.997	-

## 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	0.49%	0.11%	0.00%	0.39%	0.49%	-0.28%
过去六个月	0.89%	0.09%	2.72%	0.40%	-1.83%	-0.31%
过去一年	2.01%	0.09%	-4.29%	0.71%	6.30%	-0.62%
自基金合同生效起至今	1.70%	0.09%	-6.80%	0.90%	8.50%	-0.81%

注：本基金的业绩基准指数=沪深 300 指数收益率\*50%+中证全债指数收益率\*50%

沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场，不同发型主体和期限，能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$benchmark(0) = 1000;$

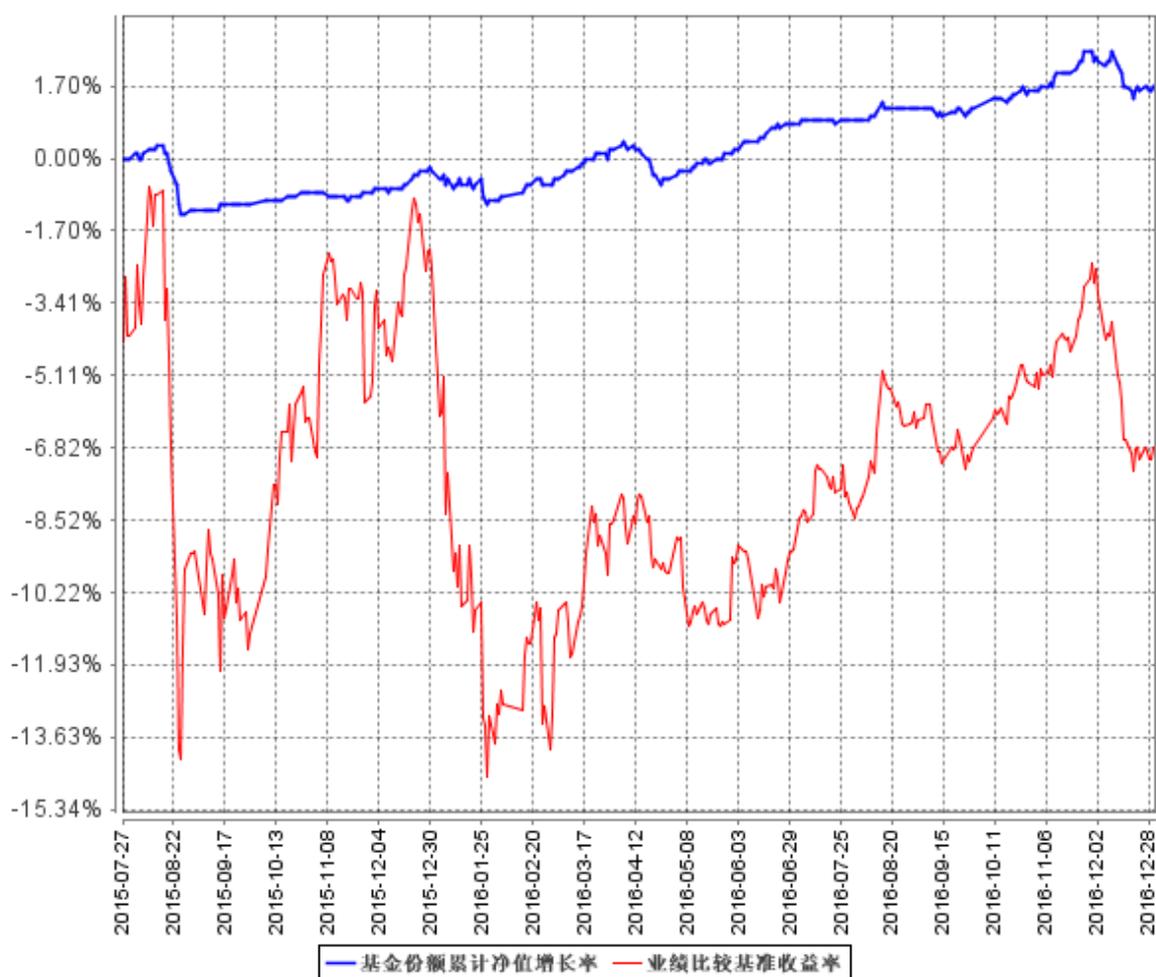
$\%benchmark(t) = 50\% * ( \text{沪深 300 指数收益率}(t) / \text{沪深 300 指数收益率}(t-1) - 1) + 50\% * ( \text{中证全债指数收益率}(t) / \text{中证全债指数收益率}(t-1) - 1);$

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

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

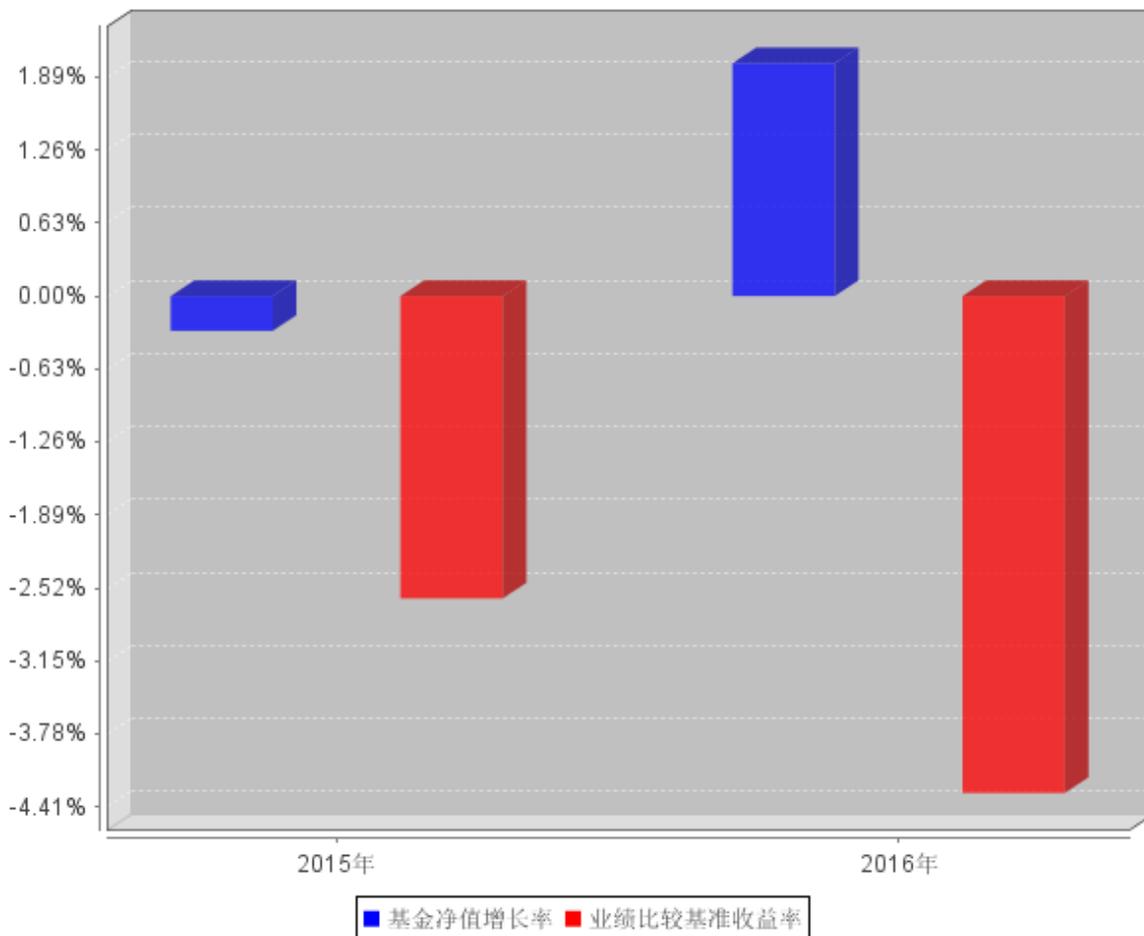
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：根据基金合同约定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金建仓期为 2015 年 7 月 27 日至 2016 年 1 月 26 日，至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 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 7 月 27 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。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2016 年 12 月 31 日，西部利得基金共管理十七只开放式基金——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、西部利得天添鑫货币市场基金、西部利得合享债券型证券投资基金、西部利得景瑞灵活配置混合型证券投资基金、西部利得合赢债券型证券投资基金、西部利得天添富货币市场基金、西部利得天添金货币市场基金、西部利得祥盈债券型证券投资基金、西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金、西部利得祥运灵活配置混合型证券投资基金。

#### 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		
韩丽楠	本基金基金经理	2015 年 8 月 5 日	-	十一年	英国约克大学经济与金融硕士；曾任渣打银行国际管理培训生、诺德基金管理有限公司研究员、上海元普投资管理有限公司固定收益投资总监、2015 年 5 月加入本公司，具有基金从业资格，中国国籍。
张维文	本基金基金经理	2015 年 7 月 27 日	2016 年 11 月 12 日	八年	上海财经大学金融学硕士；曾任交银施罗德基金管理有限公司信用分析师、国民信托有限公司研究部固定收益研究员。2013 年 11 月加入本公司，具有基金从业资格，中国国籍。
沈宏伟	本基金基金经理助理	2015 年 11 月 13 日	2016 年 7 月 18 日	十六年	太原理工大学工学硕士；曾任山西电力科学研究院工程师、山西证券股份有限公司金融衍生产品部副总经理。2015 年 5 月加入本公司，现任公司联席投资总监，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

四季度国内经济有所回暖，基建和补库存支撑工业生产短期稳定，但是面对 16 年高基数、地产投资回落、制造业补库存持续性存疑，经济中长期下行压力仍大，2017 年经济下行风险不减，基本面继续支持债市中长期走牛。当国内总需求难以出现大幅回升时，供给引发的通胀，例如煤炭、钢铁和国际原油价格的上涨，随着企业增产，价格将难以大幅上涨，随着后续工业企业补库存，商品价格终将回落，预计通胀短期内有望见顶。央行贯彻“抑制资产泡沫方针”，流动性管理由中性开始趋紧；美联储加息预期和美元走强导致人民币贬值预期上升，资金外流压力加大，加重资金面紧张程度，短期内利率中枢难以下行，但也不太可能出现长时间的“钱荒”，当前经济

基本面也难以承受过高的利率，利率中枢最终还是要与基本面相匹配。

本基金在报告期内主动缩短了固定收益类资产的久期，主要配置了流动性较好的优良信用资质的短融，并积极参与新股申购，通过一级市场权益投资追求超额收益机会，保证稳定的投资回报。

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，努力为持有人带来良好的回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.017 元，本报告期份额净值增长率为 2.01%，同期业绩比较基准增长率为-4.29%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，预计上半年经济基本面仍旧保持一定动能，金融去杠杆下债券市场将震荡前行。然而随着房地产和基建对经济拉动作用的减弱，经济向好的持续性仍然存疑，下半年或能看到债券收益率的阶段性回落。

#### 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，本基金管理人内部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、加强内部监察稽核工作，对投资研究质量控制、投资管理人员通讯管理、投资交易系统风控阈值、公平交易、反洗钱、基金销售各个环节、员工行为规范、直销柜台客服录音、即时通讯监控、后台运营参数设置等重点项目进行内部检查稽核，并继续加强对公司制度执行和风控措施落实情况的监察稽核；
- 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，根据监管机构要求制定了洗钱风险自评估实施细则，并进一步落实洗钱风险自评估工作，继续落实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、加强员工合规培训，规范员工执业操守。同时，进行了“新员工合规公开募集证券投资基金运作管理办法培训”、“反洗钱合规培训”等专题培训。

通过上述工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生禁止性关联交易、内幕交易及非公平交易的情形，基金运作整体未发现异常。

#### 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、适用性的情况，以及在采用新投资策略或投资新品种时，估值委员会负责对所采用的估值模型、假设及参数的适当性进行重新评估或修订，必要时聘请会计师事务所进行审核并出具意见。针对个别投资品种的估值方法调整，均须通过托管银行复核。

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

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

本基金管理人尚未签订任何与估值相关的定价服务。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

## 4.9 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

本报告期间，本基金存在超过连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人已向中国证监会报告本基金的解决方案。

截至本报告期末，本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 1700071 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	西部利得多策略优选灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的第 1 页至第 36 页的西部利得多策略优选灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“西部利得多策略优选混合基金”）财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 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。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是西部利得多策略优选混合基金管理人西部利得基金管理有限公司管理层的责任，这种责任包括： （1）按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和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财务报表，并使其实现公允反映；（2）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。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，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。审计工作还包括评价西部利得基金管理有限公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>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。</p>

审计意见段	我们认为，西部利得多策略优选混合基金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和在财务报表附注 2 中所列示的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多策略优选混合 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果及基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	黄小熠	虞京京
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）	
会计师事务所的地址	上海市南京西路 1266 号恒隆广场二期 16 层	
审计报告日期	2017 年 3 月 30 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：西部利得多策略优选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		3,350,098.53	91,887,844.17
结算备付金		269,654.36	2,487,282.36
存出保证金		119,746.70	571,747.76
交易性金融资产		506,610,440.36	4,027,383,667.91
其中：股票投资		131,871,245.26	221,741,711.76
基金投资		-	-
债券投资		374,739,195.10	3,805,641,956.15
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	1,350,004,305.00
应收证券清算款		3,000,000.00	992,115,545.76
应收利息		4,298,249.83	38,043,485.37
应收股利		-	-
应收申购款		10.00	5,000.00
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-

资产总计		517,648,199.78	6,502,498,878.33
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年12月31日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		26,000,000.00	1,010,504,000.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		10.16	159,618.90
应付管理人报酬		250,081.10	2,982,509.90
应付托管费		62,520.28	745,627.45
应付销售服务费		83,360.37	994,169.96
应付交易费用		101,302.52	1,476,678.58
应交税费		-	-
应付利息		13,266.97	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		124,000.00	187,000.00
负债合计		26,634,541.40	1,017,049,604.79
<b>所有者权益:</b>			
实收基金		482,653,091.40	5,499,645,315.86
未分配利润		8,360,566.98	-14,196,042.32
所有者权益合计		491,013,658.38	5,485,449,273.54
负债和所有者权益总计		517,648,199.78	6,502,498,878.33

注：报告期截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.017 元，基金份额总额 482,653,091.40 份。

## 7.2 利润表

会计主体：西部利得多策略优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年7月27日(基 金合同生效日)至 2015年12月31日
<b>一、收入</b>		30,180,705.84	13,020,241.22
1. 利息收入		54,620,331.42	80,693,235.86
其中：存款利息收入		4,131,891.45	37,170,414.10
债券利息收入		45,176,522.81	41,920,170.49

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,311,917.16	1,602,651.27
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-14,811,319.44	-78,480,522.64
其中：股票投资收益		-40,054,031.17	-79,022,941.35
基金投资收益		-	-
债券投资收益		25,207,114.13	519,666.71
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		35,597.60	22,752.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-9,785,490.98	10,483,824.38
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		157,184.84	323,703.62
<b>减：二、费用</b>		19,942,162.96	29,315,660.16
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	10,880,082.67	15,362,128.59
2. 托管费	7.4.8.2.2	2,720,020.72	3,840,532.11
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	3,626,694.23	5,120,709.53
4. 交易费用		1,108,338.70	3,185,682.62
5. 利息支出		1,426,723.59	1,604,728.91
其中：卖出回购金融资产支出		1,426,723.59	1,604,728.91
6. 其他费用		180,303.05	201,878.40
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		10,238,542.88	-16,295,418.94
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		10,238,542.88	-16,295,418.94

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：西部利得多策略优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	5,499,645,315.86	-14,196,042.32	5,485,449,273.54

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	10,238,542.88	10,238,542.88
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）	-5,016,992,224.46	12,318,066.42	-5,004,674,158.04
其中：1. 基金申购款	613,260,672.95	6,393,659.17	619,654,332.12
2. 基金赎回款	-5,630,252,897.41	5,924,407.25	-5,624,328,490.16
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）	482,653,091.40	8,360,566.98	491,013,658.38
项目	上年度可比期间 2015 年 7 月 27 日（基金合同生效日）至 2015 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）	6,023,768,460.47	-	6,023,768,460.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-16,295,418.94	-16,295,418.94
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）	-524,123,144.61	2,099,376.62	-522,023,767.99
其中：1. 基金申购款	1,748,370.59	-10,311.60	1,738,058.99
2. 基金赎回款	-525,871,515.20	2,109,688.22	-523,761,826.98
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）	5,499,645,315.86	-14,196,042.32	5,485,449,273.54

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：

贺燕萍

基金管理人负责人

贺燕萍

主管会计工作负责人

张晔骏

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

西部利得多策略优选灵活配置混合型证券投资基金（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”）《关于核准西部利得多策略优选灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2015]1525号）批准，由西部利得基金管理有限公司（原纽银梅隆西部基金管理有限公司，以下简称“西部利得基金公司”）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》等法律法规以及《西部利得多策略优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2015年7月27日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集规模为6,023,768,460.47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（以下简称“兴业银行”）。

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》等法律法规以及《西部利得多策略优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《西部利得多策略优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券、中期票据、短期融资券、货币市场工具、权证、股指期货、债券回购、银行存款、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：股票市值占基金资产净值的0%—95%。其中，基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准=沪深300指数收益率\*50%+中证全债指数收益率\*50%

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2017年3月30日批准报出。

#### 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〈年度报告和半年度报告〉》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2016年12月31日的财务状况、2016年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 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最近一年年度财务报告相一致。

#### 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

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度未发生重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财税字[1998] 55 号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2002] 128 号文《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] 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[2015] 125 号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》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) 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。

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

(c)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。

证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

对香港市场投资者(包括单位和个人)通过基金互认买卖内地基金份额免征增值税。

2017 年 7 月 1 日(含)以后,资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人,按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日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,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。因此,截至 2016 年 12 月 31 日,本基金没有计提有关增值税费用。

(d)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。

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

(f)关于香港市场投资者通过基金互认买卖内地基金份额的所得税问题:

对香港市场投资者(包括企业和个人)通过基金互认买卖内地基金份额取得的转让差价所得,暂免征收所得税。

对香港市场投资者（包括企业和个人）通过基金互认从内地基金分配取得的收益，由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时，对香港市场投资者按照 10% 的税率代扣所得税；或发行债券的企业向该内地基金分配利息时，对香港市场投资者按照 7% 的税率代扣所得税，并由内地上市公司或发行债券的企业向其主管税务机关办理扣缴申报。该内地基金向投资者分配收益时，不再扣缴所得税。

内地基金管理人应当向相关证券登记结算机构提供内地基金的香港市场投资者的相关信息。

(g) 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。

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

#### 7.4.7 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、注册登记机构、基金销售机构
西部证券股份有限公司（简称“西部证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
利得科技有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
兴业银行股份有限公司（简称“兴业银行”）	基金托管人、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 7 月 27 日 (基金合同生效日) 至 2015 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	290,597,413.43	29.90%	-	-
------	----------------	--------	---	---

#### 7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年7月27日(基金合同生效日)至2015年 12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例
西部证券	312,900,669.45	13.86%	-	-

#### 7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年7月27日(基金合同生效日)至2015年 12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
西部证券	966,700,000.00	23.30%	-	-

#### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016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	154,395.42	32.37%	-	-

上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用西部证券股份有限公司证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从西部证券股份有限公司获得证券研究综合服务。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 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12月31日	2015年7月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日

	月 31 日	至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	10,880,082.67	15,362,128.59
其中：支付销售机构的客户维护费	388.79	1,011.06

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 0.6%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×0.6%/当年天数。

#### 7.4.8.2.2 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 12 月 31 日	2015 年 7 月 27 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,720,020.72	3,840,532.11

注：支付基金托管人兴业银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

#### 7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
西部利得基金公司	3,626,433.14
利得科技	5.89
合计	3,626,439.03
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间
	2015 年 7 月 27 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
西部利得基金公司	5,120,047.90
利得财富	0.02
合计	5,120,047.92

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给西部利得基金，再由西部利得基金计算并支付给各基金销售机构。其计算

公式为：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.2% / 当年天数。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2016年1月1日至2016年12月31日						
银行间市场交易 的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
兴业银行	-	30,165,487.05	-	-	-	-

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金管理人于本报告期末未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.8.4.2 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

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

#### 7.4.8.5 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12月31日		上年度可比期间 2015年7月27日(基金合同生效日)至2015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	3,350,098.53	4,001,336.42	91,887,844.17

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12月31日的相关余额为人民币269,654.36元。(2015年12月31日：人民币2,487,282.36元)

#### 7.4.8.6 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。

#### 7.4.9 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

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

601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
603035	常熟汽饰	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
300586	美联新材	2016年12月26日	2017年1月4日	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	3.07	3.07	2,396	7,355.72	7,355.72	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股/新债申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股/新债，从新股/新债获配日至新股/新债上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.9.2 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
000166	申万宏源	2016年12月21日	临时停牌	6.25	2017年1月26日	6.29	180,000	1,163,741.83	1,125,000.00	-
000750	国海证券	2016年12月15日	临时停牌	6.97	2017年1月20日	6.49	100,000	738,572.50	697,000.00	-
600655	豫园商城	2016年12月20日	临时停牌	11.42	-	-	11,200	127,904.00	127,904.00	-

		日								
002567	唐人神	2016年12月22日	临时停牌	12.64	2017年1月3日	11.65	4,200	52,616.00	53,088.00	-

注：本基金截至 2015 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 26,000,000.00 元，于 2017 年 1 月 3 日，2017 年 1 月 7 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 7.4.10 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 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 130,025,571.32 元，属于第二层级的余额为 376,584,869.04 元，无属于第三层级的余额（2015 年 12 月 31 日：第一层级 207,441,711.76 元，第二层级 3,819,941,956.15 元，无第三层级）。

###### (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 2016 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	131,871,245.26	25.48
	其中：股票	131,871,245.26	25.48
2	固定收益投资	374,739,195.10	72.39
	其中：债券	374,739,195.10	72.39
	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	3,619,752.89	0.70
7	其他各项资产	7,418,006.53	1.43
8	合计	517,648,199.78	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末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	154,114.00	0.03
B	采矿业	5,202,466.67	1.06
C	制造业	40,362,632.92	8.22

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,847,758.00	0.78
E	建筑业	2,030,040.23	0.41
F	批发和零售业	3,580,014.61	0.73
G	交通运输、仓储和邮政业	2,847,200.00	0.58
H	住宿和餐饮业	282,816.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,053,863.11	0.83
J	金融业	56,703,252.32	11.55
K	房地产业	3,869,654.00	0.79
L	租赁和商务服务业	816,420.00	0.17
M	科学研究和技术服务业	137,744.40	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	2,894,289.00	0.59
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	335,474.00	0.07
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,458,246.00	0.91
S	综合	295,260.00	0.06
	合计	131,871,245.26	26.86

### 8.3 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

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	601988	中国银行	2,430,000	8,359,200.00	1.70
2	601398	工商银行	1,881,200	8,296,092.00	1.69
3	000001	平安银行	743,800	6,768,580.00	1.38
4	601288	农业银行	1,730,000	5,363,000.00	1.09
5	600000	浦发银行	296,500	4,806,265.00	0.98
6	601328	交通银行	800,000	4,616,000.00	0.94
7	000069	华侨城 A	382,200	2,656,290.00	0.54
8	601818	光大银行	601,000	2,349,910.00	0.48
9	000686	东北证券	178,460	2,205,765.60	0.45
10	600060	海信电器	127,200	2,177,664.00	0.44

## 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	002367	康力电梯	30,131,367.26	0.55
2	002527	新时达	24,005,520.27	0.44
3	600376	首开股份	20,947,954.90	0.38
4	002016	世荣兆业	16,451,547.58	0.30
5	600970	中材国际	14,296,264.91	0.26
6	000725	京东方 A	13,603,000.00	0.25
7	002194	武汉凡谷	13,364,872.16	0.24
8	000686	东北证券	13,278,782.00	0.24
9	601328	交通银行	12,367,659.00	0.23
10	000511	*ST 烯碳	11,260,216.18	0.21
11	601988	中国银行	10,730,565.00	0.20
12	600688	上海石化	10,562,200.00	0.19
13	600645	中源协和	10,257,009.64	0.19
14	601169	北京银行	10,091,619.36	0.18
15	600111	北方稀土	10,047,137.90	0.18
16	000001	平安银行	9,758,622.18	0.18
17	601398	工商银行	9,206,625.00	0.17
18	600836	界龙实业	9,189,076.99	0.17
19	002170	芭田股份	9,180,495.11	0.17
20	000620	新华联	8,638,824.81	0.16

### 8.4.2 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	000725	京东方 A	41,112,379.20	0.75
2	002367	康力电梯	32,107,075.64	0.59
3	600009	上海机场	25,719,988.12	0.47
4	002527	新时达	22,606,677.64	0.41
5	000686	东北证券	20,964,109.40	0.38
6	600376	首开股份	20,786,100.76	0.38

7	600074	保千里	19,973,632.12	0.36
8	002016	世荣兆业	16,868,537.30	0.31
9	601377	兴业证券	14,160,074.36	0.26
10	600970	中材国际	13,354,558.89	0.24
11	000783	长江证券	12,712,442.45	0.23
12	002194	武汉凡谷	12,326,362.12	0.22
13	000511	*ST 烯碳	11,008,777.63	0.20
14	600688	上海石化	10,228,426.75	0.19
15	600111	北方稀土	9,569,330.57	0.17
16	601169	北京银行	9,112,641.82	0.17
17	600645	中源协和	8,860,140.92	0.16
18	000620	新华联	8,773,714.28	0.16
19	600717	天津港	8,637,742.80	0.16
20	002170	芭田股份	8,146,670.00	0.15

#### 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	460,771,548.42
卖出股票收入（成交）总额	515,600,588.87

#### 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	23,222,251.40	4.73
2	央行票据	-	-
3	金融债券	22,508,933.70	4.58
	其中：政策性金融债	22,508,933.70	4.58
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	328,613,000.00	66.93
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	395,010.00	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	374,739,195.10	76.32

#### 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	041651023	16 大装备 CP001	300,000	30,066,000.00	6.12
2	011698489	16 灵山 SCP003	300,000	29,871,000.00	6.08
3	011698590	16 鲁商 SCP008	300,000	29,829,000.00	6.07
4	011698551	16 粤纺织 SCP003	300,000	29,826,000.00	6.07
5	011698582	16 宝钢气体 SCP001	300,000	29,820,000.00	6.07

## 8.7 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

贵金属不在本基金投资范围内。

## 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 投资组合报告附注

### 8.11.1

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。

### 8.11.2

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。

### 8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	119,746.70
2	应收证券清算款	3,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	4,298,249.83
5	应收申购款	10.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,418,006.53

### 8.11.4 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。

### 8.11.5 期末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。

### 8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 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

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
198	2,437,641.88	482,583,051.62	99.99%	70,039.78	0.01%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	3,404.53	0.0007%

### 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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年7月27日）基金份额总额	6,023,768,460.47
本报告期期初基金份额总额	5,499,645,315.86
本报告期基金总申购份额	613,260,672.95
减:本报告期基金总赎回份额	5,630,252,897.41
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	482,653,091.40

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 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：

根据基金管理人一届二十八次董事会会议决议，自2016年9月29日起，原董事长安保和先生离任，徐剑钧先生职务由原督察长变更为董事长，赵毅先生担任督察长职务。

### 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

本报告期为本基金审计的会计师事务所改聘为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。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 54,000 元。截至报告期末连续服务期为 0~1 年。

### 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	
银河证券	2	333,705,000.47	34.33%	53,829.66	11.29%	-
西部证券	2	290,597,413.43	29.90%	154,395.42	32.37%	-
中信建投	1	137,312,550.56	14.13%	127,264.81	26.68%	-
中泰证券	2	62,548,423.71	6.44%	51,996.26	10.90%	-
平安证券	2	44,491,661.16	4.58%	32,536.61	6.82%	-
海通证券	1	38,903,979.47	4.00%	19,197.09	4.03%	-
申万宏源	2	29,462,537.94	3.03%	18,203.81	3.82%	-
东北证券	2	22,646,185.16	2.33%	9,768.93	2.05%	-
光大证券	2	12,290,536.65	1.26%	9,725.40	2.04%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

华金证券	2	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-

### 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
银河证券	38,110,077.87	1.71%	1,857,000,000.00	44.75%	-	-
西部证券	306,313,667.35	13.74%	966,700,000.00	23.30%	-	-
中信建投	40,323,720.62	1.81%	-	-	-	-
中泰证券	1,798,811.67	0.08%	96,000,000.00	2.31%	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	107,179,572.97	4.81%	-	-	-	-
申万宏源	1,690,389,506.69	75.84%	1,116,032,000.00	26.89%	-	-
东北证券	20,569,780.82	0.92%	30,000,000.00	0.72%	-	-
光大证券	-	-	40,000,000.00	0.96%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	24,247,389.87	1.09%	41,000,000.00	0.99%	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	3,000,000.00	0.07%	-	-

西部利得基金管理有限公司  
2017年3月31日