

# 西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资 基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：西部利得基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：二〇一七年八月二十九日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 3 月 21 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>9</b>
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.....	10
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	46
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	46
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	47
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
8.3 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.....	49
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>50</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>51</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	52
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>54</b>

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	54
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>55</b>
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	西部利得久安回报混合
场内简称	-
基金主代码	673100
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 3 月 21 日
基金管理人	西部利得基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	199,961,920.89 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过优化配置债券类资产、权益类资产，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>本基金投资策略由自上而下的资产配置计划和自下而上的单个证券选择计划组成。根据对宏观经济趋势、国家宏观政策趋势、行业及企业盈利和信用状况、债券市场和股票市场估值水平及预期收益等动态分析，决定债券类、权益类资产配置比例。</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>通过持续、系统、深入的基本面研究，挖掘企业内在价值，寻找具备长期增长潜力的上市公司，本基金将在这些公司估值相对便宜的时候进行投资，与这些公司一起高速增长。</p> <p>本基金将根据上市公司的行业特性及公司本身的特点，选择合适的股票估值方法。可供选择的估值方法包括市盈率法（P/E）、市净率法（P/B）、市盈率—长期成长法（PEG）、企业价值/销售收入（EV/SALES）、企业价值/息税折旧摊销前利润法（EV/EBITDA）、自由现金流贴现模型（FCFF, FCFE）或股利贴现模型（DDM）等。通过估值水平分析，基金管理人力争发掘出价值被低估的股票。</p>

	<p>2、债券投资策略</p> <p>债券类投资采取积极主动的投资策略包括确定债券组合久期、债券组合期限结构及类属配置、单个资产选择等。本基金根据对利率趋势的判断来确定基金资产的久期。在预期利率上升时，缩短基金资产的久期，以规避资本损失或获取更高的收益；在预期利率下降时，延长基金资产的久期，以获取资本利得或锁定较高的收益。</p> <p>本基金对国债的投资侧重于利率风险和流动性风险分析，对金融债、企业债的投资侧重于信用风险分析。本基金还将关注可转债价格与其所对应股票价格的相对变化，综合考虑可转债的市场流动性等因素，确定投资可转债的投资品种和投资比例。</p> <p>3、资产支持证券的投资策略</p> <p>本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>在股指期货投资上，本基金以避险保值、管理投资组合的系统性风险、改善投资组合的风险收益特性为主。在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*20%+中证全债指数收益率*80%。
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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵毅	方琦
	联系电话	021-38572888	0755-22160168
	电子邮箱	service@westleadfund.com	FANGQI275@pingan.com.cn
客户服务电话		4007-007-818;021-38572666	95511-3
传真		021-38572750	0755-82080387
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	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 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	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
邮政编码		200127	518001

法定代表人	徐剑钧	谢永林
-------	-----	-----

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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



### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年3月21日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-331,585.01
本期利润	18,183,998.61
加权平均基金份额本期利润	0.0901
本期加权平均净值利润率	8.81%
本期基金份额净值增长率	9.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	-336,169.31
期末可供分配基金份额利润	-0.0017
期末基金资产净值	218,420,716.62
期末基金份额净值	1.0923
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	9.23%

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）。
4. 本基金合同生效日为 2017 年 3 月 21 日，截至 2017 年 6 月 30 日，基金合同生效未满半年。

#### 3.2 基金净值表现

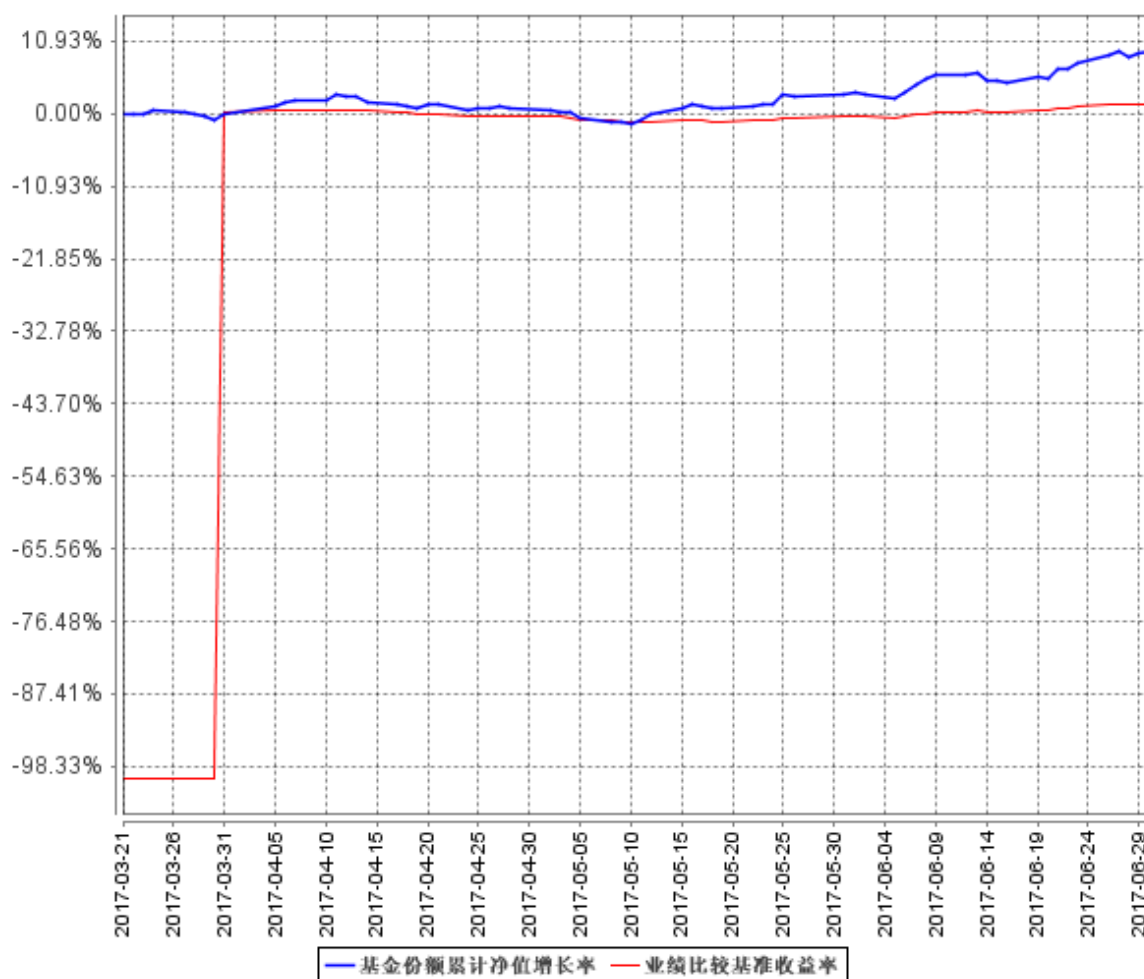
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	6.09%	0.66%	1.96%	0.14%	4.13%	0.52%
过去三个月	9.47%	0.59%	1.32%	0.15%	8.15%	0.44%

自基金合同生效起至今	9.23%	0.56%	1.45%	0.14%	7.78%	0.42%
------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

### 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



### 3.3 其他指标

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至2017年6月30日，本基金管理人共管理二十四只开放式基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘荟	本基金基金经理	2017年3月21日	-	八年	辽宁大学理学硕士，曾任群益证券股份有限公司研究员。2014年1月加入本公司，现任公司公募投资部副总经理，具有基金从业资格，中国国籍。
冷文鹏	本基金基金经理	2017年4月6日	-	十一年	中国人民银行研究生部金融学硕士，曾任中国经济技术投资担保有限公司产品经理、华夏基金管理有限公司高级经理、新华基金管理有限公司研究员、华泰柏瑞基金管理有限公司高级研究员。2016年4月加入本公司，具有基金从业资格，中国国籍。

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，年初以来，补库存因素驱动下，国内经济延续改善态势，企业盈利持续回升，带动市场稳步上涨，4 月之后，经济迈入被动补库存阶段，企业盈利增速开始回落，叠加去杠杆进一步推进，金融监管力度全面加强，流动性趋紧，市场出现较大幅度回调，5 月中旬以后，随着监管效果初步显现，资金压力有所缓解，叠加 A 股纳入 MSCI 指数，风险偏好显著回升，市场显著回升。市场结构性行情特征明显，消费龙头及白马成长持续强势，中小创板块持续弱势。基于市场区间震荡格局的判断，本基金仓位总体保持稳定，组合风格稳健均衡，兼顾价值蓝筹及新兴成长，并以价值蓝筹为主，基金业绩表现较好。

衷心感谢持有人的支持，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

展望未来，国内经济有望维持稳中向好格局，但仍面临一定的不确定性。预计市场总体仍保持区间震荡格局，结构性分化程度有望减弱，一线蓝筹向二线价值成长扩散。本基金将保持组合风格的稳健均衡，并适时适度调整组合个股。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本基金管理人尚未签订任何与估值相关的定价服务。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

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

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	15,971,080.15	-
结算备付金		761,707.35	-
存出保证金		151,523.66	-
交易性金融资产	6.4.7.2	201,631,527.27	-
其中：股票投资		201,631,527.27	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		216,927.84	-
应收利息	6.4.7.5	7,314.47	-
应收股利		-	-
应收申购款		9.99	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		218,740,090.73	-
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		340.27	-
应付管理人报酬		138,765.73	-
应付托管费		26,018.58	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	108,179.31	-



应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	46,070.22	-
负债合计		319,374.11	-
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	199,961,920.89	-
未分配利润	6.4.7.10	18,458,795.73	-
所有者权益合计		218,420,716.62	-
负债和所有者权益总计		218,740,090.73	-

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0923 元，基金份额总额 199,961,920.89 份。

## 6.2 利润表

会计主体：西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 3 月 21 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 3 月 21 日(基 金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		19,162,801.13	-
1.利息收入		155,351.47	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	139,661.23	-
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		15,690.24	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		296,481.17	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,434,108.57	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,730,589.74	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	18,515,583.62	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	195,384.87	-

<b>减：二、费用</b>		978,802.52	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	458,764.26	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	86,018.28	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	387,949.84	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	46,070.14	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		18,183,998.61	-
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		18,183,998.61	-

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 3 月 21 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 3 月 21 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	200,520,789.91	-	200,520,789.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	18,183,998.61	18,183,998.61
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)	-558,869.02	274,797.12	-284,071.90
其中：1.基金申购款	51,272,228.47	537,837.75	51,810,066.22
2.基金赎回款	-51,831,097.49	-263,040.63	-52,094,138.12
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	199,961,920.89	18,458,795.73	218,420,716.62

项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	金净值)		
一、期初所有者权益(基金净值)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-	-
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)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-	-

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

西部利得久安回报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”)证监许可[2016]2113号批复核准,由西部利得基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、本基金《基金合同》、《招募说明书》等相关法律文件负责公开募集。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 2.00 亿元,业经毕马威华振会计师事务所出具验

资报告予以验证。经向中国证监会备案，本基金《基金合同》于 2017 年 3 月 21 日正式生效。本基金的基金管理人为西部利得基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

本财务报表由本基金的基金管理人西部利得基金管理有限公司批准于 2017 年 8 月 29 日报出。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

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

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

#### **6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.4.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **6.4.4.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### **6.4.4.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

### 6.4.5 税项

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

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

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

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

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

### 6.4.6 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	15,971,080.15
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	15,971,080.15

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

#### 6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	183,115,943.65	201,631,527.27	18,515,583.62
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	183,115,943.65	201,631,527.27	18,515,583.62

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

#### 6.4.6.3 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。本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

#### 6.4.6.4 买入返售金融资产

##### 6.4.6.4.1 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。注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

##### 6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

#### 6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	6,903.57
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	342.80
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	68.10
合计	7,314.47

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

#### 6.4.6.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

#### 6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	108,179.31
银行间市场应付交易费用	-
合计	108,179.31

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

#### 6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.08
预提费用	46,070.14
合计	46,070.22

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

#### 6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年3月21日(基金合同生效日)至2017年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	200,520,789.91	200,520,789.91
本期申购	51,272,228.47	51,272,228.47
本期赎回(以“-”号填列)	-51,831,097.49	-51,831,097.49
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	199,961,920.89	199,961,920.89

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

**6.4.6.10 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-331,585.01	18,515,583.62	18,183,998.61
本期基金份额交易产生的变动数	-4,584.30	279,381.42	274,797.12
其中：基金申购款	521,154.75	16,683.00	537,837.75
基金赎回款	-525,739.05	262,698.42	-263,040.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-336,169.31	18,794,965.04	18,458,795.73

**6.4.6.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017年3月21日(基金合同生效日)至2017年6月30日
活期存款利息收入	100,982.49
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	4,052.34
其他	34,626.40
合计	139,661.23

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

**6.4.6.12 股票投资收益****6.4.6.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017年3月21日(基金合同生效日)至2017年6月30日
卖出股票成交总额	143,421,109.02
减：卖出股票成本总额	144,855,217.59
买卖股票差价收入	-1,434,108.57

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。



### **6.4.6.13 债券投资收益**

#### **6.4.6.13.1 债券投资收益项目构成**

注：本基金在本报告期内未持有债券。本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

#### **6.4.6.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

#### **6.4.6.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

#### **6.4.6.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

#### **6.4.6.13.5 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。本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

### **6.4.6.14 贵金属投资收益**

#### **6.4.6.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金在本报告期内未持有贵金属。

#### **6.4.6.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

#### **6.4.6.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

#### **6.4.6.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

### **6.4.6.15 衍生工具收益**

#### **6.4.6.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金于本报告期内未持有衍生工具。

**6.4.6.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2017年3月21日(基金合同生效日)至2017年 6月30日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	-

**6.4.6.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2017年3月21日(基金合同生效日)至2017年6 月30日
股票投资产生的股利收益	1,730,589.74
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,730,589.74

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

**6.4.6.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年3月21日(基金合同生效日)至2017 年6月30日
1. 交易性金融资产	18,515,583.62
——股票投资	18,515,583.62
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	18,515,583.62

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

**6.4.6.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017年3月21日(基金合同生效日)至2017
----	--------------------------------

	年 6 月 30 日
基金赎回费收入	195,384.87
合计	195,384.87

- 注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额不低于 25% 的部分归入基金资产。
2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费不低于 25% 的部分归入转出基金的基金资产。
3. 本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

#### 6.4.6.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 3 月 21 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	387,949.84
银行间市场交易费用	-
合计	387,949.84

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

#### 6.4.6.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 3 月 21 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	21,263.53
信息披露费	24,806.61
合计	46,070.14

#### 6.4.6.21 分部报告

-

### 6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.7.2 资产负债表日后事项

截至 2017 年 6 月 30 日止，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.8 关联方关系

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

本报告期内，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

-

### 6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.9.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.9.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.9.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.9.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间应支付关联方的佣金均为零。

### 6.4.9.2 关联方报酬

#### 6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2017 年 3 月 21 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	458,764.26	-
其中:支付销售机构的客户维护费	384.36	-

注:支付基金管理人西部利得基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.80% / 当年天数。

#### 6.4.9.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2017年3月21日(基金合同生效日)至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	86,018.28	-

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

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

#### 6.4.9.2.3 销售服务费

#### 6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.9.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金的情况。

#### 6.4.9.5 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 2017年3月21日(基金合同生效日) 至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	平安银行股份有限公司	15,971,080.15	100,982.49	-

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人平安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“平安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2017年6月30日的相关余额为人民币761,707.35元。

#### 6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.9.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.10 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.11 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月14日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-

		日	10 日							
300670	大烨智能	2017 年 6 月 26 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 12 日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017 年 6 月 23 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

#### 6.4.11.2 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
300104	乐视网	2017 年 4 月 17 日	临时停牌	30.68	-	-	79,400	2,509,493.00	2,435,992.00	-
600050	中国联通	2017 年 4 月 5 日	临时停牌	7.47	-	-	234,500	1,813,123.00	1,751,715.00	-
601088	中国神华	2017 年 6 月 5 日	临时停牌	22.29	-	-	74,400	1,434,639.00	1,658,376.00	-
002013	中航机电	2017 年 5 月 16 日	临时停牌	10.33	-	-	90,150	1,040,199.00	931,249.50	-

600100	同方股份	2017年4月21日	临时停牌	14.12	-	-	62,400	870,026.00	881,088.00	-
601989	中国重工	2017年5月31日	临时停牌	6.21	-	-	141,300	1,022,497.00	877,473.00	-
601919	中远海控	2017年5月17日	临时停牌	5.35	-	-	158,800	883,823.00	849,580.00	-
300271	华宇软件	2017年6月22日	临时停牌	16.59	-	-	43,000	713,677.00	713,370.00	-
600959	江苏有线	2017年6月19日	临时停牌	10.57	-	-	61,950	646,194.50	654,811.50	-

### 6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.12 金融工具风险及管理

本基金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（含创业板、中小板）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人力争在严格控制风险的情况下实现基金资产长期增值，对以上风险采取的风险管理政策如下所述：

#### 6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只混合型证券投资基金，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。

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

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

#### **6.4.12.2 信用风险**

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

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

##### **6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

##### **6.4.12.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

#### **6.4.12.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种

所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### **6.4.12.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

#### **6.4.12.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金管理人通过监测组合久期、Beta 值等指标来衡量市场风险。

#### **6.4.12.4.1 利率风险**

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

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

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

#### 6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	15,971,080.15	-	-	-	15,971,080.15
结算备付金	761,707.35	-	-	-	761,707.35
存出保证金	151,523.66	-	-	-	151,523.66
交易性金融资产	-	-	-	-201,631,527.27	201,631,527.27
应收证券清算款	-	-	-	216,927.84	216,927.84
应收利息	-	-	-	7,314.47	7,314.47
应收申购款	-	-	-	9.99	9.99
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	16,884,311.16	-	-	-201,855,779.57	218,740,090.73
负债					
应付赎回款	-	-	-	340.27	340.27
应付管理人报酬	-	-	-	138,765.73	138,765.73
应付托管费	-	-	-	26,018.58	26,018.58
应付交易费用	-	-	-	108,179.31	108,179.31
其他负债	-	-	-	46,070.22	46,070.22
负债总计	-	-	-	319,374.11	319,374.11
利率敏感度缺口	16,884,311.16	-	-	-201,536,405.46	218,420,716.62
上年度末 2016年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
负债					

#### 6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

#### 6.4.12.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.12.4.3 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“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人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：股票资产占基金资产的 0%-95%；权证投资比例不高于基金资产净值的 3%；本基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	201,631,527.27	92.31	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	201,631,527.27	92.31	-	-

##### 6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	36,300,000.00	-
	业绩比较基准下降 5%	-36,300,000.00	

#### 6.4.12.4.4 采用风险价值法管理风险

(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 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 190877872.27 元，属于第二层级的余额为 10753655.00 元，无属于第三层级的余额（本基金于今年成立，故无上年度年末数据）。			
(ii) 公允价值所属层级间的重大变动			
对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。			
(iii) 第三层级公允价值余额和本期变动金额			
无。			
(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具			
(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。			
假设	1. 置信区间 -		
	2. 观察期 -		
分析	风险价值 (单位：人民币元)	本期末（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）

#### 6.4.13 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 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 190877872.27 元，属于第二层级的余额为 10753655.00 元，无属于第三层级的余额(本基金于今年成立，故无上年度年末数据)。

(ii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

(iii) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	201,631,527.27	92.18
	其中：股票	201,631,527.27	92.18
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	16,732,787.50	7.65
7	其他各项资产	375,775.96	0.17
8	合计	218,740,090.73	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,337,659.92	2.44
C	制造业	73,322,416.64	33.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,275,436.00	2.42
E	建筑业	9,158,897.00	4.19
F	批发和零售业	5,485,087.00	2.51
G	交通运输、仓储和邮政业	5,967,134.00	2.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,860,447.12	5.43
J	金融业	67,642,567.07	30.97
K	房地产业	9,325,949.52	4.27

L	租赁和商务服务业	1,673,396.00	0.77
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,993,284.00	1.37
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	3,080,618.00	1.41
S	综合	508,635.00	0.23
	合计	201,631,527.27	92.31

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601318	中国平安	194,789	9,663,482.29	4.42
2	000776	广发证券	535,505	9,237,461.25	4.23
3	600036	招商银行	245,500	5,869,905.00	2.69
4	002142	宁波银行	282,748	5,457,036.40	2.50
5	601398	工商银行	951,860	4,997,265.00	2.29
6	601288	农业银行	1,413,200	4,974,464.00	2.28
7	000651	格力电器	90,700	3,734,119.00	1.71
8	000333	美的集团	83,700	3,602,448.00	1.65
9	601668	中国建筑	345,400	3,343,472.00	1.53
10	601211	国泰君安	160,963	3,301,351.13	1.51
11	601166	兴业银行	187,700	3,164,622.00	1.45
12	601998	中信银行	501,400	3,153,806.00	1.44
13	601818	光大银行	778,600	3,153,330.00	1.44
14	600030	中信证券	183,600	3,124,872.00	1.43
15	600104	上汽集团	97,900	3,039,795.00	1.39
16	601939	建设银行	488,100	3,001,815.00	1.37
17	600519	贵州茅台	6,117	2,886,306.45	1.32
18	300104	乐视网	79,400	2,435,992.00	1.12
19	601601	中国太保	68,700	2,326,869.00	1.07



20	600900	长江电力	140,400	2,159,352.00	0.99
21	601688	华泰证券	119,700	2,142,630.00	0.98
22	601336	新华保险	40,500	2,081,700.00	0.95
23	601901	方正证券	200,600	1,991,958.00	0.91
24	000069	华侨城 A	177,800	1,788,668.00	0.82
25	000063	中兴通讯	75,200	1,785,248.00	0.82
26	600050	中国联通	234,500	1,751,715.00	0.80
27	600887	伊利股份	80,200	1,731,518.00	0.79
28	601088	中国神华	74,400	1,658,376.00	0.76
29	001979	招商蛇口	75,402	1,610,586.72	0.74
30	002236	大华股份	70,500	1,608,105.00	0.74
31	600009	上海机场	41,600	1,552,096.00	0.71
32	600048	保利地产	150,800	1,503,476.00	0.69
33	000671	阳光城	248,560	1,446,619.20	0.66
34	600383	金地集团	123,000	1,410,810.00	0.65
35	600208	新潮中宝	305,200	1,373,400.00	0.63
36	601111	中国国航	139,400	1,359,150.00	0.62
37	000402	金融街	115,600	1,354,832.00	0.62
38	600886	国投电力	168,200	1,328,780.00	0.61
39	600338	西藏珠峰	34,400	1,306,856.00	0.60
40	000060	中金岭南	116,000	1,299,200.00	0.59
41	600741	华域汽车	52,900	1,282,296.00	0.59
42	000858	五粮液	22,100	1,230,086.00	0.56
43	601607	上海医药	42,400	1,224,512.00	0.56
44	000039	中集集团	67,900	1,224,237.00	0.56
45	601600	中国铝业	270,000	1,220,400.00	0.56
46	000826	启迪桑德	34,300	1,204,616.00	0.55
47	600132	重庆啤酒	50,900	1,186,479.00	0.54
48	002456	欧菲光	64,300	1,168,331.00	0.53
49	600031	三一重工	143,200	1,164,216.00	0.53
50	600062	华润双鹤	42,135	1,155,763.05	0.53
51	000999	华润三九	36,317	1,153,064.75	0.53
52	000895	双汇发展	48,500	1,151,875.00	0.53
53	600276	恒瑞医药	22,440	1,135,239.60	0.52
54	000963	华东医药	22,600	1,123,220.00	0.51
55	600436	片仔癀	18,300	1,117,032.00	0.51
56	000725	京东方 A	268,400	1,116,544.00	0.51
57	000538	云南白药	11,884	1,115,313.40	0.51
58	002008	大族激光	32,100	1,111,944.00	0.51

59	000568	泸州老窖	21,562	1,090,605.96	0.50
60	600019	宝钢股份	162,300	1,089,033.00	0.50
61	002241	歌尔股份	56,400	1,087,392.00	0.50
62	601766	中国中车	106,600	1,078,792.00	0.49
63	600056	中国医药	41,500	1,076,925.00	0.49
64	002475	立讯精密	36,800	1,076,032.00	0.49
65	600809	山西汾酒	31,000	1,075,390.00	0.49
66	300136	信维通信	26,700	1,068,534.00	0.49
67	000423	东阿阿胶	14,800	1,063,972.00	0.49
68	600028	中国石化	179,200	1,062,656.00	0.49
69	600820	隧道股份	104,200	1,052,420.00	0.48
70	002415	海康威视	32,550	1,051,365.00	0.48
71	002304	洋河股份	12,060	1,046,928.60	0.48
72	601985	中国核电	133,800	1,044,978.00	0.48
73	600570	恒生电子	22,000	1,026,960.00	0.47
74	601800	中国交建	64,200	1,020,138.00	0.47
75	002450	康得新	45,000	1,013,400.00	0.46
76	000425	徐工机械	269,900	1,012,125.00	0.46
77	601006	大秦铁路	120,000	1,006,800.00	0.46
78	601669	中国电建	126,700	1,003,464.00	0.46
79	601186	中国铁建	83,300	1,002,099.00	0.46
80	600153	建发股份	76,100	983,973.00	0.45
81	600660	福耀玻璃	37,000	963,480.00	0.44
82	600170	上海建工	250,000	955,000.00	0.44
83	002013	中航机电	90,150	931,249.50	0.43
84	601933	永辉超市	129,900	919,692.00	0.42
85	000997	新大陆	40,100	909,869.00	0.42
86	002555	三七互娱	35,400	905,178.00	0.41
87	002410	广联达	47,600	894,880.00	0.41
88	600089	特变电工	86,600	894,578.00	0.41
89	002624	完美世界	26,000	891,800.00	0.41
90	600585	海螺水泥	39,200	891,016.00	0.41
91	600100	同方股份	62,400	881,088.00	0.40
92	601989	中国重工	141,300	877,473.00	0.40
93	002027	分众传媒	63,500	873,760.00	0.40
94	002190	成飞集成	32,000	857,600.00	0.39
95	002065	东华软件	39,300	856,347.00	0.39
96	601919	中远海控	158,800	849,580.00	0.39
97	600309	万华化学	29,400	842,016.00	0.39

98	600188	兖州煤业	68,233	835,171.92	0.38
99	600893	航发动力	30,300	827,190.00	0.38
100	002024	苏宁云商	72,800	819,000.00	0.37
101	300418	昆仑万维	35,500	811,885.00	0.37
102	600068	葛洲坝	69,600	782,304.00	0.36
103	601633	长城汽车	56,400	749,556.00	0.34
104	600021	上海电力	61,400	742,326.00	0.34
105	600373	中文传媒	30,500	717,055.00	0.33
106	600066	宇通客车	32,500	714,025.00	0.33
107	300271	华宇软件	43,000	713,370.00	0.33
108	601231	环旭电子	44,879	705,049.09	0.32
109	000625	长安汽车	47,800	689,276.00	0.32
110	002343	慈文传媒	18,200	689,052.00	0.32
111	002493	荣盛石化	70,000	683,200.00	0.31
112	600959	江苏有线	61,950	654,811.50	0.30
113	002739	万达电影	12,700	647,319.00	0.30
114	601928	凤凰传媒	65,900	643,184.00	0.29
115	002411	必康股份	21,700	627,564.00	0.29
116	000418	小天鹅A	13,400	626,986.00	0.29
117	600177	雅戈尔	61,880	626,225.60	0.29
118	300208	恒顺众昇	38,850	620,434.50	0.28
119	600176	中国巨石	54,940	603,241.20	0.28
120	002470	金正大	79,700	600,141.00	0.27
121	600885	宏发股份	14,900	594,361.00	0.27
122	002202	金风科技	38,200	590,954.00	0.27
123	002572	索菲亚	14,000	574,000.00	0.26
124	002242	九阳股份	28,800	566,496.00	0.26
125	000915	山大华特	15,340	565,585.80	0.26
126	600352	浙江龙盛	59,100	563,223.00	0.26
127	601216	君正集团	112,900	552,081.00	0.25
128	600475	华光股份	27,400	546,082.00	0.25
129	002668	奥马电器	25,920	510,624.00	0.23
130	000881	中广核技	26,700	508,635.00	0.23
131	600703	三安光电	25,800	508,260.00	0.23
132	600348	阳泉煤业	70,000	474,600.00	0.22
133	002478	常宝股份	80,000	442,400.00	0.20
134	601888	中国国旅	14,400	434,016.00	0.20
135	601333	广深铁路	92,000	415,840.00	0.19
136	600739	辽宁成大	23,000	414,690.00	0.19

137	600029	南方航空	47,300	411,510.00	0.19
138	300144	宋城演艺	18,400	384,008.00	0.18
139	600018	上港集团	58,700	372,158.00	0.17
140	600415	小商品城	50,500	365,620.00	0.17
141	600298	安琪酵母	14,000	362,180.00	0.17
142	002311	海大集团	19,368	353,853.36	0.16
143	600201	生物股份	9,600	341,472.00	0.16
144	600612	老凤祥	5,000	244,850.00	0.11
145	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.02
146	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.02
147	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.02
148	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
149	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
150	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
151	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
152	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
153	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
154	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
155	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.01
156	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01
157	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
158	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.01
159	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
160	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
161	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
162	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002142	宁波银行	12,218,115.54	5.59
2	000776	广发证券	9,136,826.90	4.18
3	601318	中国平安	7,202,463.17	3.30

4	601288	农业银行	6,854,182.00	3.14
5	601398	工商银行	6,535,608.82	2.99
6	600036	招商银行	5,580,087.46	2.55
7	601939	建设银行	5,318,038.00	2.43
8	601998	中信银行	4,179,320.51	1.91
9	601997	贵阳银行	3,717,232.87	1.70
10	000651	格力电器	3,644,149.00	1.67
11	600030	中信证券	3,477,888.02	1.59
12	601668	中国建筑	3,256,317.00	1.49
13	601166	兴业银行	3,116,931.00	1.43
14	601818	光大银行	3,106,614.00	1.42
15	000166	申万宏源	3,066,038.95	1.40
16	601211	国泰君安	2,954,851.54	1.35
17	601800	中国交建	2,937,860.00	1.35
18	000333	美的集团	2,910,476.00	1.33
19	600109	国金证券	2,766,226.20	1.27
20	601601	中国太保	2,651,222.14	1.21

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	002142	宁波银行	6,918,630.28	3.17
2	601997	贵阳银行	3,370,022.00	1.54
3	002146	荣盛发展	3,162,959.20	1.45
4	600340	华夏幸福	2,976,410.00	1.36
5	000166	申万宏源	2,943,886.58	1.35
6	601939	建设银行	2,657,435.96	1.22
7	600109	国金证券	2,575,224.00	1.18
8	601288	农业银行	2,443,000.00	1.12
9	601398	工商银行	2,219,490.00	1.02
10	601881	中国银河	2,068,399.00	0.95
11	000709	河钢股份	2,025,935.00	0.93
12	601899	紫金矿业	1,952,649.00	0.89

13	601800	中国交建	1,746,889.66	0.80
14	600837	海通证券	1,689,491.00	0.77
15	600999	招商证券	1,671,276.00	0.77
16	601128	常熟银行	1,559,606.00	0.71
17	600549	厦门钨业	1,546,167.25	0.71
18	000338	潍柴动力	1,499,396.00	0.69
19	600663	陆家嘴	1,485,678.00	0.68
20	600008	首创股份	1,477,968.00	0.68

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

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	327,971,161.24
卖出股票收入（成交）总额	143,421,109.02

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金于本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金于本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金于本报告期末未持有股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金于本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金于本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金于本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

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

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	151,523.66
2	应收证券清算款	216,927.84
3	应收股利	-
4	应收利息	7,314.47
5	应收申购款	9.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	375,775.96

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。



## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
277	721, 884. 19	198, 003, 410. 13	99. 02%	1, 958, 510. 76	0. 98%

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

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

### 8.2 期末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	0.00	0.0000%

### 8.3 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年3月21日）基金份额总额	200,520,789.91
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	51,272,228.47
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	51,831,097.49
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	199,961,920.89

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开本基金份额持有人大会，无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金进行审计。

本报告期内，经公司第一届董事会第三十次会议决议，自 2017 年 1 月 9 日起由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）正式改聘为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。详细信息可参见本基金管理人于 2017 年 1 月 10 日披露的《关于旗下基金改聘会计师事务所公告》。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	股票交易	应支付该券商的佣金

	交易单元 数量	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	备注
西部证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	283,492,920.35	100.00%	202,816.55	100.00%	-

注：1. 基金租用席位的选择标准是：（1）资历雄厚，信誉良好；（2）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；（3）经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；（4）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；（5）公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。选择程序是：根据对各券商提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合席位券商标准的，由公司研究部提出席位券商的调整意见（调整名单及调整原因），并经公司批准。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
西部证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	100,000,000.00	100.00%	-	-

### 10.8 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旗下基金改聘会计师事务所公告	《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、《上海证券报》、本基金管理人网站	2017年1月10日
2	西部利得基金管理有限公司关于等比例增加注册资本及修改公司章程事项的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、《上海证券报》、本基金管理人网站	2017年1月25日
3	西部利得基金管理有限公司关于正式设立北京分公司的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、《上海证券报》、	2017年3月28日

---

		本基金管理人网站	
--	--	----------	--

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	>3 个月	0.00	148,519,047.50	-	148,519,047.50	74.27%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金为混合型基金，其主要风险包括但不限于：股票价格波动风险、信用风险、流动性风险等。							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准本基金设立的相关文件；
- (2) 本基金《基金合同》；
- (3) 本基金《招募说明书》；
- (4) 本基金《托管协议》；
- (5) 基金管理人《基金管理资格证书》及《企业法人营业执照》；
- (6) 报告期内本基金公告的各项原稿。

### 12.2 存放地点

本基金管理人处——上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 11 楼

### 12.3 查阅方式

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

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

西部利得基金管理有限公司

2017 年 8 月 29 日