

西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资 基金 2018 年第 4 季度报告

2018 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

报告送出日期：二〇一九年一月二十二日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2019 年 1 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 西部利得中证 500 等权重指数分级 |
| 场内简称 | 500 等权 |
| 基金主代码 | 502000 |
| 交易代码 | 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 211,954,297.39 份 |
| 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的成果，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。 |

| | | | |
|-----------------|---|----------------------------|-----------------------------|
| | <p>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。</p> <p>2. 股票投资策略：</p> <p>（1）股票组合构建原则</p> <p>本基金通过复制指数的方法，根据中证 500 等权重指数成份股组成及其基准权重构建股票投资组合。当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证 500 等权重指数的效果可能带来影响时，基金管理人将根据市场情况，采取合理措施控制基金的跟踪误差。</p> <p>（2）股票组合调整方法</p> <p>本基金将采用完全复制法构建股票投资组合，根据中证 500 等权重指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。同时，本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增发等因素的变化，对股票投资组合进行适时调整，以保证基金净值增长率与中证 500 等权重指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。</p> <p>3. 债券投资策略：本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等流动性好的债券。本基金对债券进行配置的原则是：安全性与流动性优先，且兼顾收益性。</p> | | |
| 业绩比较基准 | 95%×中证 500 等权重指数收益率+5%×商业银行人民币活期存款利率（税后） | | |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型指数基金，预期风险大于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额看，西部利得中证 500 等权重 A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；西部利得中证 500 等权重 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。 | | |
| 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 | | |
| 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 |
| 下属分级基金场内简称 | 500 等权 A | 500 等权 B | 500 等权 |
| 下属分级基金的交易代码 | 502001 | 502002 | 502000 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,452,436.00 份 | 1,452,436.00 份 | 209,049,425.39 份 |
| 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。 | 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。 |
|--|--|--|------------------|

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2018 年 10 月 1 日 — 2018 年 12 月 31 日） |
|-----------------|---|
| 1. 本期已实现收益 | -10,900,661.91 |
| 2. 本期利润 | -15,724,536.95 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0743 |
| 4. 期末基金资产净值 | 158,506,026.32 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.7478 |

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。

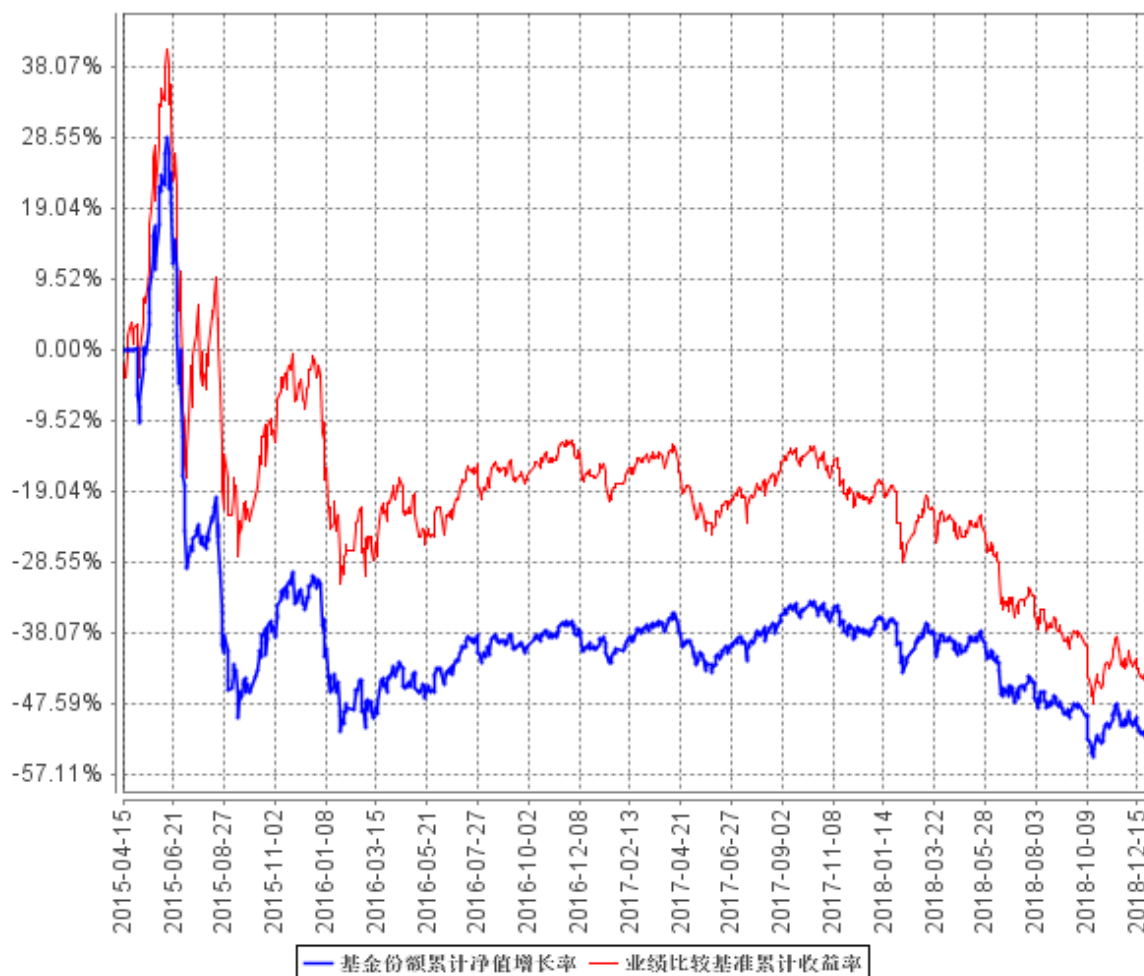
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 | 净值增长率 ① | 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 | -8.44% | 1.58% | -11.33% | 1.74% | 2.89% | -0.16% |

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

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

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---------|------------------|------|--------|-------------------------------------|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 盛丰衍 | 本基金基金经理 | 2016 年 11 月 24 日 | - | 四年 | 复旦大学理学硕士，曾任光大证券股份有限公司权益投资助理、上海光大证券资 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 产管理有限公司研究员、兴证证券资产管理有限公司量化研究员。2016 年 10 月加入本公司，有基金从业资格，中国国籍。 |
|--|--|--|--|--|---|

注：1. 任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；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《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、本基金《基金合同》等法律文件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，力争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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2018 年四季度，中证 500 指数受中美摩擦升温以及国内经济下行压力影响震荡下跌。

展望 2019 年一季度，三股正向力量将托底指数，两股不确定力量将扰动指数，预计 A 股指数震荡上行。

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，随着政策持续开放，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；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；

正向力量其三是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。中国特色社会主义市场经济和加入 WTO 拥抱世界的成功改革都曾历经坎坷和波折，如今的改革也是砥砺前行。中国深化改革的成果终将逐步提升市场风险偏好。

扰动因子其一是中美摩擦。2018 年中美摩擦从贸易战开始逐步升温和扩散，市场风险偏好随之大幅下降。预计在 2019 年的上半年中美摩擦将反复扰动指数，而随着美国经济由盛转衰，摩擦对美国的负面影响也将更为明显，中美之间摩擦将随之降温。

扰动因子其二是经济 and 政策的博弈。2019 年中国实体经济将继续下行，而以中央加杠杆为主的政策利好作为对冲项持续发力，两股力量阶段性的强弱会影响股市。

目前 A 股非金融股的市盈率以及金融股市净率均处于历史底部区域。长期看未来 A 股机构化进程加速，价值投资将更为深入人心，无论已成为龙头的价值蓝筹还是成长股均是上市公司内在价值的体现，两者均会有一定表现。

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。2018 年基金规模维持在 2 个亿左右，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。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，在被动化指数投资的基础上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。

4.5 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”。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 150,240,640.24 | 94.53 |
| | 其中：股票 | 150,240,640.24 | 94.53 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 2,997,300.00 | 1.89 |
| | 其中：债券 | 2,997,300.00 | 1.89 |
| | 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 | 5,493,167.97 | 3.46 |
| 8 | 其他资产 | 209,310.68 | 0.13 |
| 9 | 合计 | 158,940,418.89 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | 966,082.60 | 0.61 |
| B | 采矿业 | 7,272,182.44 | 4.59 |
| C | 制造业 | 80,088,640.07 | 50.53 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,523,558.90 | 3.48 |
| E | 建筑业 | 3,804,944.63 | 2.40 |
| F | 批发和零售业 | 9,443,943.41 | 5.96 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 5,726,739.70 | 3.61 |
| H | 住宿和餐饮业 | 973,368.00 | 0.61 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 10,103,275.52 | 6.37 |
| J | 金融业 | 5,086,974.37 | 3.21 |
| K | 房地产业 | 9,227,059.08 | 5.82 |
| L | 租赁和商务服务业 | 4,050,002.32 | 2.56 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 1,027,298.50 | 0.65 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 142,901.40 | 0.09 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 5,708,213.00 | 3.60 |
| S | 综合 | 975,961.00 | 0.62 |
| | 合计 | 150,121,144.94 | 94.71 |

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | 3,310.00 | 0.00 |
| C | 制造业 | 66,039.50 | 0.04 |
| 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 | 50,145.80 | 0.03 |

| | | | |
|---|---------------|------------|------|
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 119,495.30 | 0.08 |

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

5.3 报告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

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|------------|--------------|
| 1 | 600021 | 上海电力 | 98,400 | 797,040.00 | 0.50 |
| 2 | 601019 | 山东出版 | 98,600 | 771,052.00 | 0.49 |
| 3 | 600006 | 东风汽车 | 213,700 | 769,320.00 | 0.49 |
| 4 | 600623 | 华谊集团 | 93,300 | 753,864.00 | 0.48 |
| 5 | 601717 | 郑煤机 | 136,200 | 753,186.00 | 0.48 |
| 6 | 603225 | 新凤鸣 | 40,120 | 752,250.00 | 0.47 |
| 7 | 000552 | 靖远煤电 | 292,900 | 749,824.00 | 0.47 |
| 8 | 601928 | 凤凰传媒 | 94,000 | 746,360.00 | 0.47 |
| 9 | 600875 | 东方电气 | 94,500 | 745,605.00 | 0.47 |
| 10 | 600811 | 东方集团 | 202,450 | 740,967.00 | 0.47 |

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|-----------|--------------|
| 1 | 603185 | 上机数控 | 1,345 | 66,039.50 | 0.04 |
| 2 | 601860 | 紫金银行 | 15,970 | 50,145.80 | 0.03 |

| | | | | | |
|---|--------|--------|-------|----------|------|
| 3 | 000693 | *ST 华泽 | 1,000 | 3,310.00 | 0.00 |
|---|--------|--------|-------|----------|------|

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|--------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 2,997,300.00 | 1.89 |
| 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 | 2,997,300.00 | 1.89 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1 | 019537 | 16 国债 09 | 30,000 | 2,997,300.00 | 1.89 |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

除持有的东风汽车 2018 年 12 月 3 日受到中国证监会湖北监管局采取出具警示函的行政监管措施；本基金投资的其他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。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 50,992.13 |
| 2 | 应收证券清算款 | 48,348.82 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 55,161.54 |
| 5 | 应收申购款 | 54,808.19 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 209,310.68 |

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|--------|----------------|--------------|-----------|
| 1 | 601860 | 紫金银行 | 50,145.80 | 0.03 | 新股锁定 |
| 2 | 000693 | *ST 华泽 | 3,310.00 | 0.00 | 未及时披露定期报告 |

5.11.6 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。

§ 6 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 |
|-------------------------------|----------------------|----------------------|--------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,050,086.00 | 1,050,086.00 | 208,889,919.93 |
| 报告期期间基金总申购份额 | - | - | 2,342,071.68 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | - | - | 1,377,866.22 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列) | 402,350.00 | 402,350.00 | -804,700.00 |
| 报告期期末基金份额总额 | 1,452,436.00 | 1,452,436.00 | 209,049,425.39 |

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。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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 | >6 个月 | 202,019,373.16 | - | - | 202,019,373.16 | 95.31% |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金为指数分级基金，其主要风险包括但不限于：中证 500 指数波动风险、流动性风险等。 | | | | | | | |

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 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) 报告期内涉及本基金公告的各项原稿。

9.2 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

9.3 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

2019 年 1 月 22 日