

# 西部利得新动向灵活配置混合型证券投资 基金 2019 年半年度报告摘要

2019 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇一九年八月二十四日

## §1 重要提示

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	西部利得新动向混合
基金主代码	673010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 8 月 18 日
基金管理人	西部利得基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	222,520,839.93 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	把握中国经济结构转型的驱动因素，分享转型中传统产业与新兴产业加速发展的长线成果，挖掘价格合理具有持续增长潜力的公司，在控制风险的前提下力争为基金持有人谋求长期、持续、稳定的超额收益。
投资策略	<p>本基金为灵活配置的混合型基金，投资中运用的策略主要包括：</p> <p>1. 资产配置策略：本基金运用自身研发的股票/债券收益率定量模型，并参考全球资金流量统计数据，分析全球及中国宏观经济走势和政策走向、资本市场估值来综合确定基金的大类资产配置（主要是股票与债券比例）。</p> <p>2. 行业配置：本基金认为经济转型期间对经济增长的贡献将逐渐由传统工业化向城市化与工业现代化过渡，具体来说可以体现在两个方面：GDP 中传统产业升级占比提高，产业结构中新兴产业占比提高。行业配置策略主要目的是把握这一轮中国经济转型的新动向，挖掘传统产业与新兴产业加速推进过程中产生的投资机会。</p> <p>3. 股票精选策略：根据本基金的投资策略重点在于受益于传统产业与新兴产业加速发展的行业与个股，因此在股票精选方面将采取“自下而上”积极主动的选股策略，动态分析上市公司股价运行规律，投资 A 股市场内重点行业中具有合理估值、高成长性及风险相对合理的公司，股票精选目的在于挖掘出上市公司内在价值与波动率区间。</p> <p>4. 债券投资策略：本基金投资的债券包括国债、央票、金融债、公司债、企业债（含可转换债券）等债券品种。基金经理根据经投资决策委员会审批的资产配置</p>

	<p>计划，参考固定收益分析师在对利率变动趋势、债券市场发展方向和各债券品种的流动性、安全性和收益性等因素的研究成果基础上，进行综合分析并制定债券投资方案。</p> <p>5. 权证投资策略：本基金将权证的投资作为提高基金投资组合收益的辅助手段。根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值，发现市场对股票权证的非理性定价；利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，来达到改善组合风险收益特征的目的。</p> <p>6. 股指期货投资策略：若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，并严格遵守本公司经董事会批准的针对股指期货交易制定的投资决策流程风险控制等制度。基金在进行股指期货投资时，将对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其长期的预期收益和风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金、低于股票型基金产品，属于证券投资基金中的中高风险、中高预期收益的基金产品。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵毅	田青
	联系电话	021-38572888	010-67595096
	电子邮箱	service@westleadfund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		4007-007-818;021-38572666	010-67595096
传真		021-38572750	010-66275853

## 2.4 信息披露方式

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

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	18,785,242.71
本期利润	37,811,106.28
加权平均基金份额本期利润	0.1697
本期基金份额净值增长率	21.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0507
期末基金资产净值	211,249,948.20
期末基金份额净值	0.949

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

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

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

#### 3.2 基金净值表现

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.37%	0.76%	3.17%	0.65%	-0.80%	0.11%
过去三个月	-5.48%	1.05%	-0.16%	0.84%	-5.32%	0.21%
过去六个月	21.67%	1.16%	15.53%	0.85%	6.14%	0.31%
过去一年	8.71%	1.35%	7.81%	0.84%	0.90%	0.51%
过去三年	-0.11%	1.00%	17.35%	0.61%	-17.46%	0.39%
自基金合同生效起至今	48.43%	1.22%	40.51%	0.82%	7.92%	0.40%

注：本基金的业绩基准指数=沪深 300 指数收益率\*55%+上证国债指数收益率\*45% 其中：沪深

300 指数作为衡量股票投资部分的业绩基准，上证国债指数作为衡量基金债券投资部分的业绩基准。

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。上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本，按照国债发行量加权而成。反映了我国债券市场整体变动状况，是债券市场价格变动的“指示器”。

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：

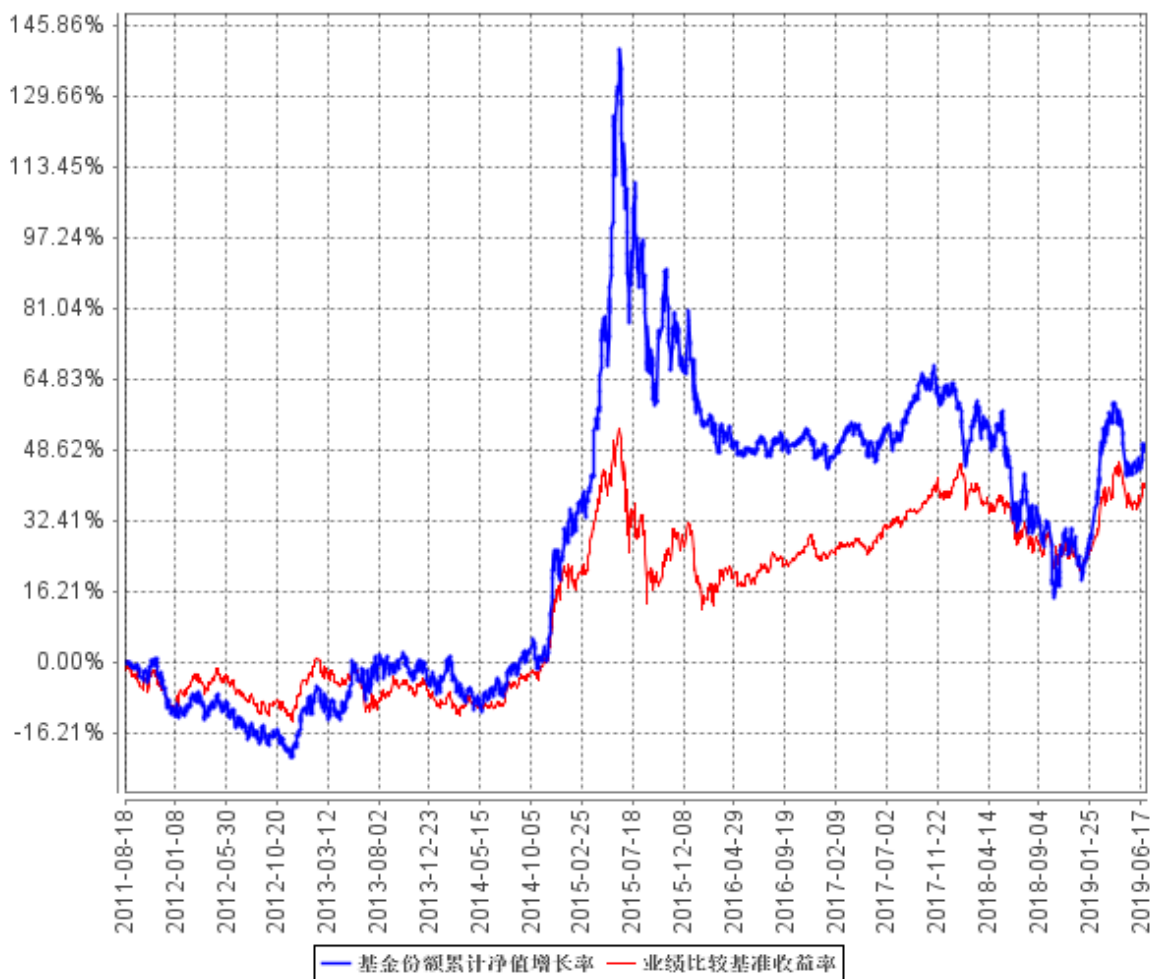
$$\text{benchmark}(0)=1000;$$

$$\% \text{benchmark}(t) = 55\% * (\text{沪深 300 指数收益率}(t) / \text{沪深 300 指数收益率}(t-1) - 1) + 45\% * (\text{上证国债指数收益率}(t) / \text{上证国债指数收益率}(t-1) - 1);$$

$$\text{benchmark}(t) = (1 + \% \text{benchmark}(t)) * \text{benchmark}(t-1) ; \text{其中 } t=1, 2, 3, \dots。$$

### 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





## §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控股，注册资本3.5亿元人民币，其中西部证券股份有限公司占比51%，利得科技有限公司占比49%，注册地上海。

截至2019年6月30日，本基金管理人旗下共管理32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	2019年4月26日	-	十一年	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	2016年6月13日	2019年4月26日	十二年	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

2019 年上半年，大盘冲高后回落，上证指数挑战 3288 点之后，回落至 2900 点以下。从各板块情况看，受中美贸易战影响，市场风险偏好下降，高股息、业绩确定性高的板块相对较强，部分龙头白马创出新高，而对于规模小，业绩波动比较大的股票，风险偏好减弱。

从基金操作情况看，一季度基金重点布局新能源、消费电子、云计算、5G 等新兴产业方向，受益于市场反弹，基金净值增长较快。二季度，基金整体仓位有所下降，主要是 4 月中旬召开的中央政治局会议对货币政策的表态有所变化，使得我们认为年初以来的宽货币推升的估值修复行情面临逻辑破坏，于是在 4 月底进行了部分降仓。

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，努力为持有人带来良好的回报。

#### 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，考虑到中美贸易仍存在诸多不确定性，实体经济目前也仍在寻底的过程中，所以货币政策仍是我们关注的重点。尽管包商银行事件后货币市场流动性比较紧张，但央行依旧没有采取降息和降准的政策，而是进行了较大规模的公开市场操作，所以从这个角度看，短期内出货政策的概率比较低，基于此我们对后市依旧谨慎，等待政策的右侧上车机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据相关法律法规的规定，本基金管理人制订了证券投资基金估值政策和程序，并经本基金管理人总经理办公会议审议通过成立了估值委员会。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。具体职责包括对本基金管理人估值政策和程序的制订和解释；在发生影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况，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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人复核审查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。

## §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：西部利得新动向灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	22,361,555.71	40,248,570.72
结算备付金		2,008,806.31	831,815.32
存出保证金		77,882.54	56,937.90
交易性金融资产	6.4.7.2	105,704,866.37	133,856,793.43
其中：股票投资		84,612,944.77	133,856,793.43
基金投资		-	-
债券投资		21,091,921.60	-
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	80,000,000.00	25,000,000.00
应收证券清算款		21,990,706.54	-
应收利息	6.4.7.5	650,618.41	5,556.30
应收股利		-	-
应收申购款		1,037.28	115.83
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		232,795,473.16	199,999,789.50
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 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		20,794,500.93	25,000,000.00
应付赎回款		556.40	-
应付管理人报酬		256,470.55	228,408.99
应付托管费		42,745.07	38,068.18
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	157,045.90	116,442.97

应交税费		96,288.00	96,288.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	197,918.11	420,000.00
负债合计		21,545,524.96	25,899,208.14
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	222,520,839.93	223,180,218.01
未分配利润	6.4.7.10	-11,270,891.73	-49,079,636.65
所有者权益合计		211,249,948.20	174,100,581.36
负债和所有者权益总计		232,795,473.16	199,999,789.50

报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.949 元，基金份额总额 222,520,839.93 份。

## 6.2 利润表

会计主体：西部利得新动向灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		40,325,432.98	-33,761,556.33
1.利息收入		899,486.14	871,636.59
其中：存款利息收入	6.4.7.11	100,609.46	112,857.87
债券利息收入		4,112.48	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		794,764.20	758,778.72
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		20,398,651.58	-16,719,072.37
其中：股票投资收益	6.4.7.12	19,624,098.72	-17,510,748.77
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	774,552.86	791,676.40
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	19,025,863.57	-17,927,957.35
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	1,431.69	13,836.80

减：二、费用		2,514,326.70	2,777,354.34
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,525,240.36	1,631,034.35
2. 托管费	6.4.10.2.2	254,206.72	271,839.09
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	617,223.51	694,890.43
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	117,656.11	179,590.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		37,811,106.28	-36,538,910.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		37,811,106.28	-36,538,910.67

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：西部利得新动向灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	223,180,218.01	-49,079,636.65	174,100,581.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	37,811,106.28	37,811,106.28
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）	-659,378.08	-2,361.36	-661,739.44
其中：1. 基金申购款	1,262,996.80	-55,004.59	1,207,992.21
2. 基金赎回款	-1,922,374.88	52,643.23	-1,869,731.65
五、期末所有者权益（基金净值）	222,520,839.93	-11,270,891.73	211,249,948.20
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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)	246,055,733.93	8,919,676.70	254,975,410.63
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	-36,538,910.67	-36,538,910.67
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)	-22,396,230.87	-803,989.61	-23,200,220.48
其中: 1.基金申购款	455,559.05	-18,552.91	437,006.14
2.基金赎回款	-22,851,789.92	-785,436.70	-23,637,226.62
五、期末所有者权益 (基金净值)	223,659,503.06	-28,423,223.58	195,236,279.48

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	_____ 张峰骏
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

西部利得新动向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[2011]878号批复核准,由西部利得基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《西部利得新动向灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《西部利得新动向灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币347,308,174.69元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2011)第321号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《西部利得新动向灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2011年8月18日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为347,347,368.89份基金份额,其中认购资金利息折合39,194.20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,基金托管人为中国建设银行股份

有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《西部利得新动向灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和最新公布的《西部利得新动向灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围是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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、以及法律法规和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的相关规定。如法律法规和监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 30%-80%；债券、货币市场工具、权证、资产支持证券等其他证券品种占 20%-70%，其中扣除股指期货保证金之后基金保留的现金以及投资于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%。业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。

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 2019 年 8 月 24 日报出。

#### 6.4.2 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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 半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 6 月 30 日的财务状况以及 2019 半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

## 6.4.6 税项

### (1) 主要税项说明

根据财税[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[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) 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。

(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）运营基金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。对基金在 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、债券收入免征增值税。

(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) 对基金取得的股票的股息、红利收入，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，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。

(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（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，按照证券投资基金管理人所在地适用的城市维护建设税税率，计算缴纳城市维护建设税。

(h) 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费率计算缴纳教育费附加、地方教育费附加。

## 6.4.7 关联方关系

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

本报告期内，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
西部利得基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、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
中国建设银行股份有限公司	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。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
西部证券	66,562,024.77	16.97%	28,327,442.79	5.58%

#### 6.4.8.1.2 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。

#### 6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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	590,000,000.00	17.58%	-	-

本基金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。

#### 6.4.8.1.4 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。

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
西部证券	61,989.26	18.19%	26,427.05	16.83%
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
西部证券	26,381.39	6.53%	-	-

#### 6.4.8.2 关联方报酬

##### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,525,240.36	1,631,034.35
其中：支付销售机构的客户维护费	33,776.24	37,973.25

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 1.5% 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×1.5%/当年天数

##### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	254,206.72	271,839.09

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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×0.25%/当年天数。

### 6.4.8.2.3 销售服务费

### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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。

### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金的情况。

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

本基金本报告期末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。

### 6.4.8.5 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 2019年1月1日至2019年6月 30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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
中国建设银行股份有限公司	22,361,555.71	76,839.52	22,251,940.90	84,335.67

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人建设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“建设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6月30日的相关余额为人民币2,008,806.31元。

### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期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 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证券	成功	可流	流通受	认购	期末估	数量	期末	期末估值	备注

代码	名称	认购日	通日	限类型	价格	值单价	(单位: 股)	成本总额	总额	
601236	红塔 证券	2019 年 6 月 26 日	2019 年 7 月 5 日	新股流 通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信 出版	2019 年 6 月 27 日	2019 年 7 月 5 日	新股流 通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

#### 6.4.9.2 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。

#### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

##### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所述的层次，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 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为 105,647,889.83 元，属于第二层次的余额为 56,976.54 元，无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次 129,003,647.63 元，第二层次 4,853,145.8 元，无属于第三层次的余额)



。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不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或第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2018 年 12 月 31 日：同）。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	84,612,944.77	36.35
	其中：股票	84,612,944.77	36.35
3	固定收益投资	21,091,921.60	9.06
	其中：债券	21,091,921.60	9.06
6	买入返售金融资产	80,000,000.00	34.36
7	银行存款和结算备付金合计	24,370,362.02	10.47
8	其他各项资产	22,720,244.77	9.76
9	合计	232,795,473.16	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 (%)
B	采矿业	133,071.75	0.06
C	制造业	45,681,181.72	21.62
E	建筑业	12,241,069.00	5.79
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,892,984.76	1.37
J	金融业	15,842,669.94	7.50
K	房地产业	7,798,861.00	3.69
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.01
	合计	84,612,944.77	40.05

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	80,000	7,088,800.00	3.36
2	601186	中国铁建	630,100	6,269,495.00	2.97
3	600048	保利地产	489,700	6,248,572.00	2.96
4	600566	济川药业	203,800	6,136,418.00	2.90
5	600498	烽火通信	200,000	5,572,000.00	2.64
6	601222	林洋能源	1,100,000	5,159,000.00	2.44
7	601688	华泰证券	220,000	4,910,400.00	2.32
8	601231	环旭电子	390,000	4,699,500.00	2.22
9	600196	复星医药	180,000	4,554,000.00	2.16
10	600398	海澜之家	469,600	4,259,272.00	2.02

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的半年度报告正文。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002373	千方科技	7,756,497.00	4.46
2	002222	福晶科技	7,262,100.00	4.17
3	000401	冀东水泥	7,039,838.70	4.04
4	601186	中国铁建	6,240,609.00	3.58
5	600566	济川药业	6,239,006.45	3.58
6	600048	保利地产	6,131,365.00	3.52
7	300037	新宙邦	6,025,999.00	3.46
8	300253	卫宁健康	5,206,022.08	2.99
9	600030	中信证券	4,999,200.00	2.87
10	601688	华泰证券	4,907,358.00	2.82
11	300166	东方国信	4,904,705.00	2.82
12	300339	润和软件	4,696,762.96	2.70
13	603611	诺力股份	4,438,869.20	2.55
14	601336	新华保险	4,351,753.89	2.50
15	000977	浪潮信息	4,349,180.00	2.50
16	600398	海澜之家	4,174,790.00	2.40

17	000933	神火股份	4,145,450.00	2.38
18	601166	兴业银行	4,115,580.00	2.36
19	002146	荣盛发展	4,104,302.00	2.36
20	600068	葛洲坝	3,828,672.00	2.20
21	300073	当升科技	3,611,666.78	2.07
22	002632	道明光学	3,565,680.00	2.05

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000977	浪潮信息	10,567,834.94	6.07
2	300383	光环新网	9,240,004.00	5.31
3	002439	启明星辰	8,778,343.22	5.04
4	000401	冀东水泥	8,511,555.78	4.89
5	600030	中信证券	8,255,373.00	4.74
6	002373	千方科技	8,058,682.00	4.63
7	002531	天顺风能	7,443,636.00	4.28
8	002632	道明光学	7,339,788.96	4.22
9	002202	金风科技	7,244,876.00	4.16
10	601601	中国太保	7,217,806.00	4.15
11	002222	福晶科技	6,970,327.00	4.00
12	600298	安琪酵母	6,714,976.20	3.86
13	000596	古井贡酒	5,897,156.00	3.39
14	601336	新华保险	5,783,837.00	3.32
15	603367	辰欣药业	5,731,397.00	3.29
16	300253	卫宁健康	5,689,753.00	3.27
17	002281	光迅科技	5,566,019.20	3.20
18	603611	诺力股份	5,531,696.40	3.18
19	002008	大族激光	5,495,525.00	3.16
20	600176	中国巨石	5,448,442.48	3.13
21	603589	口子窖	5,398,619.00	3.10
22	601899	紫金矿业	5,329,000.00	3.06
23	600438	通威股份	5,256,170.35	3.02

24	300339	润和软件	5,058,953.34	2.91
25	601012	隆基股份	4,487,042.60	2.58
26	601233	桐昆股份	4,285,490.05	2.46
27	002384	东山精密	4,176,083.28	2.40
28	601166	兴业银行	4,075,179.00	2.34
29	600795	国电电力	3,855,000.00	2.21
30	000426	兴业矿业	3,535,945.00	2.03

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	153,399,447.27
卖出股票收入（成交）总额	241,295,282.42

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

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（%）
3	金融债券	21,091,921.60	9.98
	其中：政策性金融债	21,091,921.60	9.98
10	合计	21,091,921.60	9.98

### 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

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	108604	国开 1805	208,480	21,091,921.60	9.98

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

贵金属不在本基金投资范围内。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

## 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

国债期货不在本基金投资范围内。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

国债期货不在本基金投资范围内。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

国债期货不在本基金投资范围内。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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。

### 7.12.2 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。

### 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	77,882.54
2	应收证券清算款	21,990,706.54
4	应收利息	650,618.41
5	应收申购款	1,037.28
9	合计	22,720,244.77

### 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
1,134	196,226.49	209,861,490.04	94.31%	12,659,349.89	5.69%

### 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	110.27	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（2011年8月18日）基金份额总额	347,347,368.89
本报告期期初基金份额总额	223,180,218.01
本报告期期间基金总申购份额	1,262,996.80
减：本报告期期间基金总赎回份额	1,922,374.88
本报告期期末基金份额总额	222,520,839.93

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。

## §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董事长兼法定代表人于 2019 年 3 月 8 日起正式变更为何方先生。

本报告期内本基金托管人中国建设银行股份有限公司于 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为资产托管业务部总经理。

### 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。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	股票交易		应支付该券商的佣金	
		成交金额	占当期股票	佣金	占当期佣金

	数量		成交总额的比 例		总量的比例	备注
长江证券	1	85,724,089.57	21.86%	79,835.28	23.43%	-
兴业证券	2	71,691,921.18	18.28%	66,767.11	19.59%	-
西部证券	3	66,562,024.77	16.97%	61,989.26	18.19%	-
海通证券	2	32,792,486.37	8.36%	17,422.79	5.11%	-
广发证券	2	28,244,883.02	7.20%	20,655.49	6.06%	-
国信证券	2	23,691,625.94	6.04%	22,064.09	6.47%	-
申银万国	2	16,964,237.26	4.33%	15,799.10	4.64%	-
国金证券	1	14,223,316.00	3.63%	13,245.72	3.89%	-
银河证券	1	12,282,538.49	3.13%	11,438.70	3.36%	-
中金公司	2	11,816,608.54	3.01%	11,004.31	3.23%	-
广州证券	2	11,710,132.54	2.99%	8,563.53	2.51%	-
中银国际	4	11,458,186.20	2.92%	8,379.54	2.46%	-
光大证券	1	4,978,248.76	1.27%	3,640.41	1.07%	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	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。

2. 报告期内新增交易单元为：

- (1) 方正证券
- (2) 山西证券
- (3) 中投证券
- (4) 东海证券

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	-	-	1,257,000,000.00	37.44%	-	-
兴业证券	21,093,945.80	100.00%	510,000,000.00	15.19%	-	-
西部证券	-	-	590,000,000.00	17.58%	-	-
海通证券	-	-	372,000,000.00	11.08%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	10,000,000.00	0.30%	-	-
银河证券	-	-	305,000,000.00	9.09%	-	-
中金公司	-	-	280,000,000.00	8.34%	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	33,000,000.00	0.98%	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

招商证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

## §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	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	>6 个月	209,861,490.04	-	-	209,861,490.04	94.31%
-	-	-	-	-	-	-	-
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。

西部利得基金管理有限公司

2019 年 8 月 24 日