

西部利得创业板大盘交易型开放式指数证  
券投资基金  
2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 10 月 28 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 10 月 26 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 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	西部利得创业板大盘 ETF
场内简称	创业大盘
基金主代码	159814
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 6 月 19 日
报告期末基金份额总额	202,399,895.00 份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金按照创业大盘指数成份股构建股票投资组合，通过监测投资组合个股的投资比例，并结合流动性管理因素，对指数成份股及其权重的变动进行相应调整，力争与成分股的权重比例保持一致。（详见《基金合同》）
业绩比较基准	创业板大盘指数收益率
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
基金管理人	西部利得基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

## § 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（2020 年 7 月 1 日-2020 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	17,558,158.18
2. 本期利润	11,434,057.76
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0436
4. 期末基金资产净值	202,010,504.66
5. 期末基金份额净值	0.9981

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。

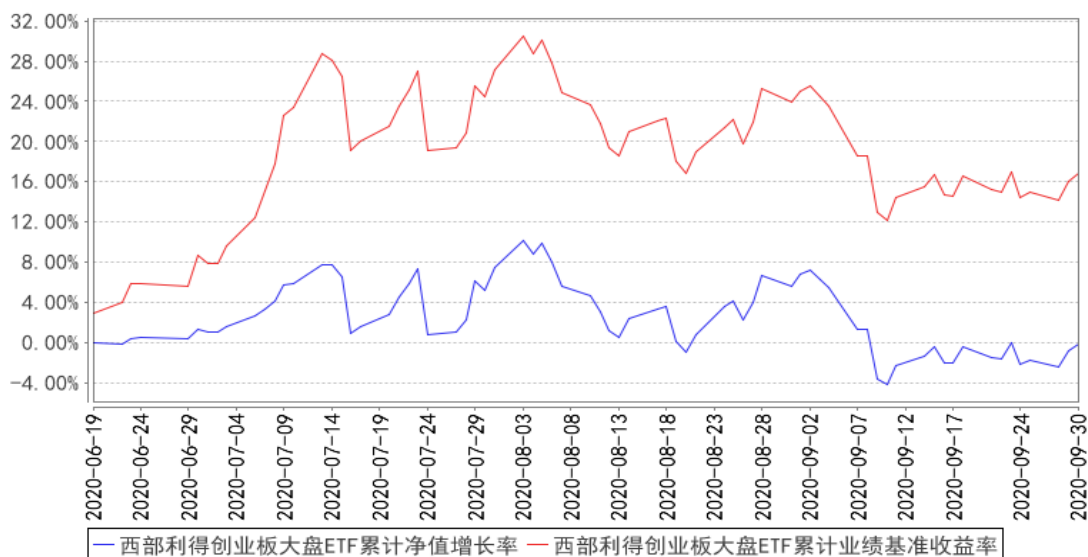
### 3.2 基金净值表现

#### 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	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	-1.42%	1.90%	7.45%	2.12%	-8.87%	-0.22%
自基金合同生效起至今	-0.20%	1.82%	16.82%	2.09%	-17.02%	-0.27%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

西部利得创业板大盘ETF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：①本基金合同于 2020 年 6 月 19 日生效。

②根据西部利得创业板大盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同的规定，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本基金合同第十四部分“四、投资限制”的有关约定。

### 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	基金经理	2020 年 06 月 19 日	-	7 年	复旦大学计算机应用技术学硕士，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，具有基金从业资格，中国国籍。
麻旭东	基金经理	2020 年 07 月 28 日	-	10 年	美国亚利桑那大学农业与资源经济学硕士。曾任西部证券上海第二分公司产品经理、国联安基金管理有限公司产品经理、专户业务投资经理助理、申万菱信基金管理有限公司金融工程师、研究员。2020 年 4 月加入本公司，具有基金从业资格证，中国国籍。

注：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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2020 年三季度，市场呈现出先涨后跌的态势，其中，市场的涨幅主要集中在 7 月，8、9 月，市场整体以震荡下跌为主线。本基金追随创业板实施注册制改革的东风，在报告期内完成了初步建仓，并于 7 月 17 日上市，同步打开了基金的申购、赎回。在市场表现上本基金的标的指数略胜出创业板指数一筹。

三季度申万一级行业的表现较为分化，由于疫情不再是资本市场最主要的影响因素，因此医药生物行业整体表现中规中矩。28 个申万一级行业中，休闲服务、国防军工、电气设备及汽车板块的表现较好，而计算机、商业贸易及通信板块的表现较差，是本报告期内仅有的三个下跌的申万一级行业。

报告期仍属建仓期，本基金于基金成立后一个月内完成了初步建仓及上市，上市后紧密跟踪创业板大盘指数，力争为投资者提供与创业板大盘指数相匹配的收益，整体表现上符合预期。

#### 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以及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	198,991,532.78	98.03
	其中：股票	198,991,532.78	98.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	1,764,399.50	0.87
8	其他资产	2,226,280.67	1.10
9	合计	202,982,212.95	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	10,256,785.08	5.08
B	采矿业	-	-
C	制造业	117,807,841.30	58.32
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	248,959.00	0.12
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	19,858,552.16	9.83
J	金融业	20,092,756.95	9.95
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	5,347,761.00	2.65
N	水利、环境和公共设施管理业	1,445,940.00	0.72
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	14,623,988.70	7.24
R	文化、体育和娱乐业	8,541,747.08	4.23
S	综合	-	-
	合计	198,224,331.27	98.13

### 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	-	-
C	制造业	651,205.81	0.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	13,029.12	0.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	13,411.92	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,653.40	0.02
J	金融业	-	-
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	13,473.14	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	41,428.12	0.02
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	767,201.51	0.38

### 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。

## 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	300750	宁德时代	86,900	18,179,480.00	9.00
2	300059	东方财富	691,605	16,591,603.95	8.21
3	300760	迈瑞医疗	43,194	15,031,512.00	7.44
4	300498	温氏股份	507,702	9,920,497.08	4.91
5	300015	爱尔眼科	177,020	9,102,368.40	4.51
6	300122	智飞生物	57,315	7,984,552.65	3.95
7	300142	沃森生物	149,700	7,616,736.00	3.77
8	300124	汇川技术	117,484	6,802,323.60	3.37
9	300014	亿纬锂能	127,456	6,309,072.00	3.12
10	300601	康泰生物	30,681	5,584,248.81	2.76

### 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	300999	N 金龙鱼	12,264	315,184.80	0.16
2	300880	迦南智能	3,732	92,404.32	0.05
3	300869	康泰医学	862	62,934.62	0.03
4	300870	欧陆通	478	30,716.28	0.02
5	300867	圣元环保	974	27,281.74	0.01

## 5.4 报告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。



## 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

本基金本报告期末未持有债券。

## 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合约。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货的投资中主要遵循有效管理投资策略，对冲某些成份股的特殊突发风险和某些特殊情况下的流动性风险，以及利用股指期货的杠杆作用，达到对标的指数的有效跟踪，同时降低仓位频繁调整带来的交易成本。本基金本报告期末未持有股指期货合约。

## 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是否出现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

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。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	127,802.30
2	应收证券清算款	2,097,736.09
3	应收股利	-
4	应收利息	742.28
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,226,280.67

### 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	300999	N 金龙鱼	315,184.80	0.16	新股流通受限
2	300880	迦南智能	92,404.32	0.05	新股锁定
3	300869	康泰医学	62,934.62	0.03	新股锁定
4	300870	欧陆通	30,716.28	0.02	新股锁定
5	300867	圣元环保	27,281.74	0.01	新股锁定

### 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

报告期期初基金份额总额	408,399,895.00
报告期期间基金总申购份额	322,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	528,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	202,399,895.00

## § 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

本报告期内，本基金未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 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

2020 年 10 月 28 日