

西部利得个股精选股票型证券投资基金 2017 年年度报告

2017 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：二〇一八年三月三十日

§ 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 2018 年 3 月 29 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 2017 年 1 月 23 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	8
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	9
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	10
3.1 主要会计数据和财务指标.....	10
3.2 基金净值表现.....	10
3.3 其他指标.....	12
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	12
§4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
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.....	17
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
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.....	18
§6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
§7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	25
§8 投资组合报告	49
8.1 期末基金资产组合情况.....	49
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	49
8.3 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.....	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
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.....	56

8.7 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	56
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	57
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	57
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	57
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
8.12 投资组合报告附注	57
§9 基金份额持有人信息.....	59
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
9.3 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	59
§10 开放式基金份额变动.....	60
§ 11 重大事件揭示.....	61
11.1 基金份额持有人大会决议	61
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	61
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
11.4 基金投资策略的改变	61
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
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	61
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
11.8 其他重大事件	63
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
12.1 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	65
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	65
§13 备查文件目录.....	66
13.1 备查文件目录	66
13.2 存放地点	66
13.3 查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	西部利得个股精选股票型证券投资基金
基金简称	西部利得个股精选股票
场内简称	-
基金主代码	673090
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 1 月 23 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	273,443,885.45 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	本基金在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>本基金采取精选个股策略为主，资产配置策略为辅的综合投资策略。本基金将综合考虑主题，成长，价值，趋势几个主要方面，在自上而下的投资主题分析框架下，结合对行业和企业成长性的基本面研究，追求有远见地、准确地把握经济发展和变更中的个股投资机会；既考虑价值被市场低估的个股，也考虑具有潜在高成长性和盈利模式稳健的上市公司。力争甄选具有长期投资价值的个股，实现基金资产的长期稳健持续的收益。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金贯彻“自上而下”的资产配置策略，通过对宏观经济周期、国家经济政策、证券市场流动性和大类资产相对收益特征等因素的综合分析，在遵守大类资产投资比例限制的前提下进行积极的资产配置，对基金组合中股票、债券、短期金融工具的配置比例进行调整和优化，平衡投资组合的风险与收益。本基金在进行资产配置时，重点考察宏观经济状况、资金流动性、资产估值水平和市场因素这四个方面的。</p> <p>●宏观经济状况：重点关注反映国家经济增长情况及通胀水平的宏观经济指标、财政政策与货币政策、工</p>

	<p>业企业经营情况等；</p> <ul style="list-style-type: none"> ● 资金流动性：主要考察货币环境变化对利率、汇率等关键金融变量的影响，关注市场资金在各个资产市场间的流动，包括货币供应量、商业银行信贷、资金流动情况等； ● 资产估值水平：通过对各类资产的相对估值和绝对估值指标的对比分析，寻找相对的估值洼地。 ● 市场因素：主要分析反映投资者情绪和市场动量特征等方面的指标来判断未来市场的变化趋势。 <p>本基金通过对上述指标的深入分析和综合评估，确定各类资产的配置时机和配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金管理人采取积极的股票选择策略，依托本公司的研究平台，综合采用基本面分析和深入调查研究相结合的研究方法，以“自下而上”的方式精选出具备可持续的竞争优势、杰出的成长潜质、出色的经营管理能力，同时有合理估值的上市公司，构建投资组合。在股票选择方面，本基金将从上市公司的外部环境、核心竞争力、盈利能力和盈利质量、公司治理水平和管理层分析、估值水平等方面进行综合评价，精选具有较高投资价值的上市公司。</p> <p>具体而言，主要考虑的因素包括：</p> <p>1) 外部环境</p> <p>主要从宏观经济周期、人口结构、社会生产能力等长期发展角度分析公司所处行业面临的发展机遇，同时关注政府的经济结构调整及产业升级等产业政策可能给行业带来的发展机遇。分析行业因素对公司的影响时不仅考虑公司所处行业的周期特征、行业景气度和行业集中度因素，也要关注公司主要业务所处的经济区域及产业配套设施对公司长期发展前景的影响</p> <p>2) 核心竞争力</p> <p>本基金对公司核心竞争力的考察主要分析公司的品牌优势、市场优势、技术创新能力和竞争环境等因素。</p> <ul style="list-style-type: none"> ● 品牌优势 <p>分析公司是否在所属的行业已经拥有较高的市场份额，是否有良好的市场知名度和较好的品牌效应，是否处于行业龙头地位。</p> <ul style="list-style-type: none"> ● 市场优势 <p>分析公司是否拥有独特优势的资源，在销售渠道及营销网络等方面是否具有竞争对手在中长期时间内难以模仿的显著优势。</p> <ul style="list-style-type: none"> ● 技术创新能力 <p>分析公司的产品自主创新情况、主要产品更新周期、专有技术和专利；是否能保持足够的研发投入以推动企业的持续发展等</p>
--	---

	<p>● 竞争环境</p> <p>分析公司所在行业的内部竞争格局，分析产品或服务提供方面是否具有成本优势。分析公司议价能力、公司规模经济、替代品的威胁和潜在竞争对手进入行业的壁垒等因素。</p> <p>3) 盈利能力和盈利质量</p> <p>● 盈利能力</p> <p>结合公司所处行业的特点和发展趋势、公司背景，从财务结构、资产质量、业务增长、利润水平、现金流特征等方面考察公司的盈利能力，专注于具有行业领先优势、资产质量良好、盈利能力较强的上市公司。</p> <p>● 盈利质量</p> <p>本基金不仅关注公司的盈利能力，同时也关注公司盈利的质量，包括公司盈利的构成、盈利的主要来源、盈利的可持续性和可预测性、公司的盈利模式和扩张方式等方面。</p> <p>4) 公司治理水平和管理层分析</p> <p>● 公司治理水平分析</p> <p>清晰、合理的公司治理是公司不断良性发展的基础。本基金主要从股权结构的合理性、控股股东的背景和利益、董事会构成、信息披露的质量和及时性、激励机制的有效性、关联交易的公允性、公司的管理层和股东的利益是否协调和平衡等方面，对公司治理水平进行综合评估。</p> <p>● 公司管理层分析</p> <p>公司管理层的素质和能力是决定公司能否良性发展、不断创造领先优势的关键因素。对公司管理团队进行评价，主要考察其过往业绩、诚信记录、经营战略规划和商业计划执行能力等。</p> <p>5) 估值分析</p> <p>结合公司所处行业的特点及业务模式，运用相对估值指标和绝对估值模型相结合，并通过估值水平的历史纵向比较和与同行业、全市场横向比较，评估上市公司的投资价值和安全边际，选择股价尚未反映内在价值或具有估值提升空间的上市公司。本基金将综合使用现金流折现模(DCF)、市盈率(P/E)、市净率(P/B)、市销率(P/S)以及利润/营运现金流等估值指标。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金可投资于国债、金融债、企业债和可转换债券（含可交换债券）等债券品种，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，确定国债、金融债、企业债、短期金融工具等产品的投资比例，构建债券投资组合并不断调整。</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。</p>
--	--

	<p>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>4、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>5、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*80%+中证全债指数收益率*20%。
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，属于证券投资基金中的高风险水平投资品种。

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
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	福州市湖东路 154 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	上海市江宁路 168 号兴业大厦 20 楼
邮政编码		200127	200041
法定代表人		徐剑钧	高建平

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
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、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	2017年1月23日 (基金合同生效日)-2017年12月31日	2016年	2015年
本期已实现收益	19,294,011.07	-	-
本期利润	29,037,904.93	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.1872	-	-
本期加权平均净值利润率	17.49%	-	-
本期基金份额净值增长率	15.97%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末	2015年末
期末可供分配利润	315,043.87	-	-
期末可供分配基金份额利润	0.0012	-	-
期末基金资产净值	283,509,669.60	-	-
期末基金份额净值	1.0368	-	-
3.1.3 累计期末指标	2017年末	2016年末	2015年末
基金份额累计净值增长率	15.97%	-	-

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）。

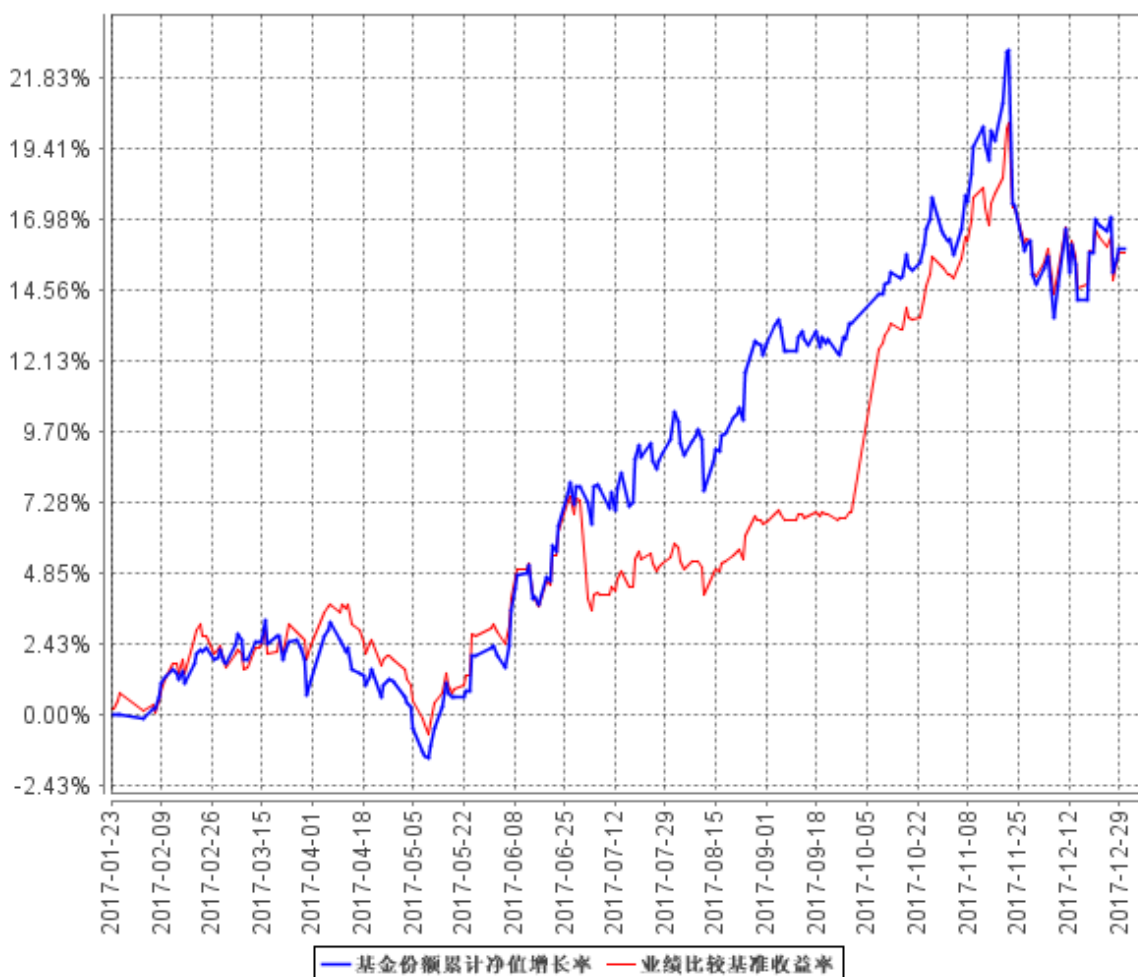
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	2.23%	0.89%	8.29%	0.92%	-6.06%	-0.03%
过去六个月	7.51%	0.73%	7.89%	0.72%	-0.38%	0.01%
自基金合同生效起至今	15.97%	0.63%	15.84%	0.62%	0.13%	0.01%

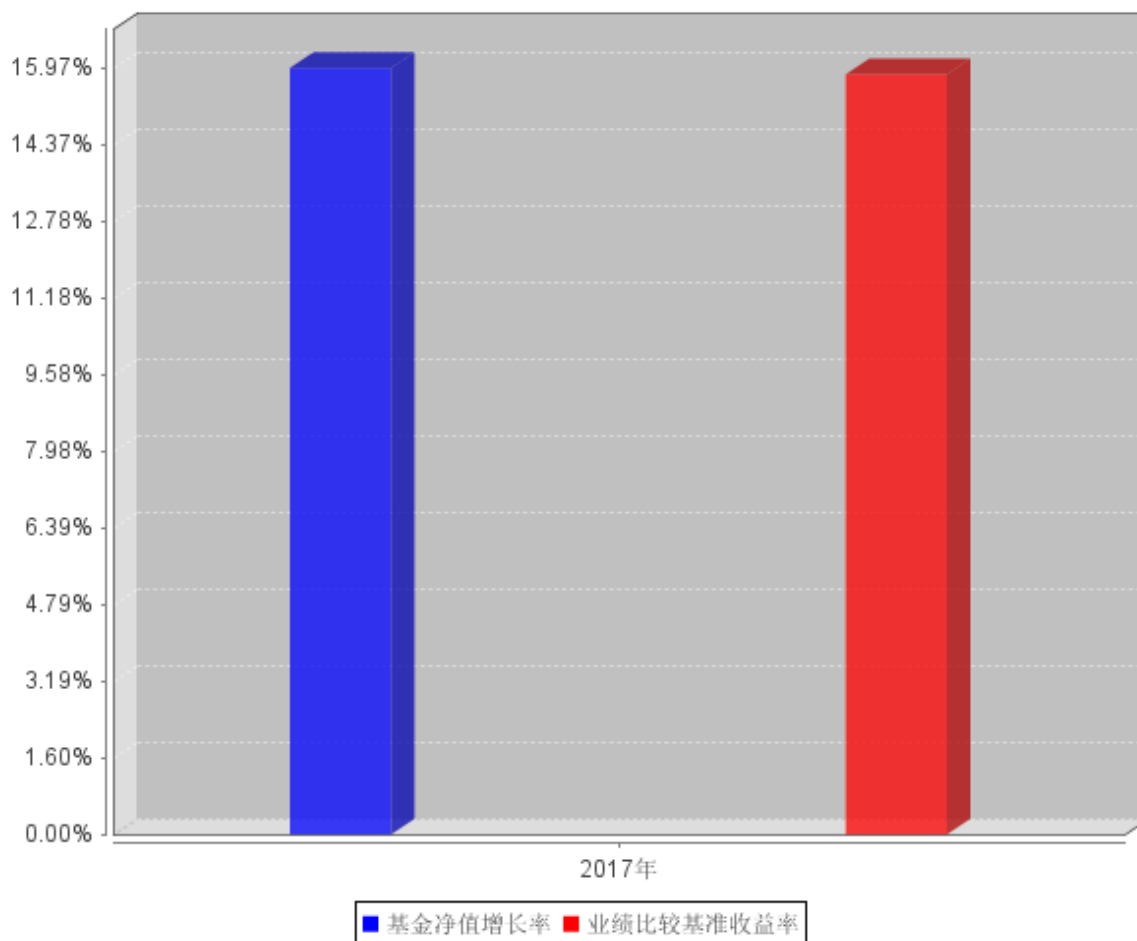
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



3.2.3 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



3.3 其他指标

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年 度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2017	1.2200	16,188,567.23	1,001.36	16,189,568.59	
合计	1.2200	16,188,567.23	1,001.36	16,189,568.59	

§ 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2017年12月31日，西部利得基金共管理二十六只开放式基金。

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		
冷文鹏	本基金基金经理	2017年2月13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。
刘荟	本基金基金经理	2017年1月23日	-	九年	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。

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

2017 年，国内经济企稳回升，供给侧改革持续推进，企业盈利延续改善态势，国内市场总体呈现宽幅区间震荡格局，并伴随中枢上移。市场继续呈现结构分化特征，但有所弱化，价值蓝筹股受益于稳健业绩增长及估值修复而领涨市场，周期股受益于供给侧改革及环保政策力度加大所带来的价格上涨催化，成长股特别是保持较高盈利增速的龙头逐步走出底部并有一定幅度反弹。

报告期内，本基金仓位总体稳定，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。

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，2018 年，经济方面，预计国内经济稳中向好，GDP 增速在 6.7%左右，并保持较强韧性，具体来看，投资面临压力，基建稳中有降，地产尚有支撑，制造业略有回升；消费保持稳定，居民收入回升，需求升级趋势持续；出口复苏延续。政策方面，经济稳增长底线仍在，财政政策保持积极；通胀压力面临上行，防风险、去杠杆导向下，货币政策易紧难松，流动性总体平稳；美联储可能多次加息，欧美货币宽松政策逐步退出，外部约束增加。企业方面，受高基数、去库存等因素影响，盈利增速有所回落，前低后高。

市场风险与机遇并存，预计 2018 年市场总体仍将持续宽幅区间震荡格局，且中枢有望继续上移。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。

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。

4.6 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，本基金管理人的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、落实内部监察稽核工作，对公司业务流程及管理的各项环节进行定期及不定期稽核；
- 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、落实各项合规工作，确保公司各项业务及管理符合法律法规要求；
- 六、其他各类监察稽核工作。

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管理部、风险控制岗、监察稽核部、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、合规、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

可参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。

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

无。

§ 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 1800061 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	西部利得个股精选股票型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>我们审计了后附的第 1 页至第 30 页的西部利得个股精选股票型证券投资基金(以下简称“西部利得个股精选基金”)财务报表,包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表、自 2017 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附的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、在财务报表附注 2 中所列示的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,公允反映了西部利得个股精选基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2017 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果及基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“审计准则”)的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于西部利得个股精选基金,并履行了职业道德方面的其他责任。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>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>西部利得个股精选基金管理人西部利得基金管理有限公司管理层对其他信息负责。其他信息包括西部利得个股精选基金 2017 年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>

<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>西部利得个股精选基金管理人西部利得基金管理有限公司管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、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，使其实现公允反映，并设计、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。</p> <p>在编制财务报表时，西部利得个股精选基金管理人西部利得基金管理有限公司管理层负责评估西部利得个股精选基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非西部利得个股精选基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>西部利得个股精选基金管理人西部利得基金管理有限公司治理层负责监督西部利得个股精选基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，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。</p> <p>(3) 评价西部利得个股精选基金管理人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及相关披露的合理性。</p>

	<p>(4) 对西部利得个股精选基金管理人西部利得基金管理有限公司管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对西部利得个股精选基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致西部利得个股精选基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与西部利得个股精选基金管理人西部利得基金管理有限公司治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
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）
注册会计师的姓名	黄小熠 叶凯韵
会计师事务所的地址	上海市静安区南京西路 1266 号 2 幢 25 层
审计报告日期	2018 年 3 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：西部利得个股精选股票型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	153,889,267.84	-
结算备付金		423,113.27	-
存出保证金		37,405.80	-
交易性金融资产	7.4.7.2	234,869,739.22	-
其中：股票投资		234,869,739.22	-
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	34,081.60	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		389,253,607.73	-
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		105,220,772.23	-
应付赎回款		11.44	-
应付管理人报酬		161,679.41	-
应付托管费		26,946.57	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	229,528.46	-
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	105,000.02	-
负债合计		105,743,938.13	-
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	273,443,885.45	-
未分配利润	7.4.7.10	10,065,784.15	-
所有者权益合计		283,509,669.60	-
负债和所有者权益总计		389,253,607.73	-

注：1. 报告截止日 2017 年 12 月 31 日，西部利得个股精选基金份额净值 1.0368 元，基金份额总额 273,443,885.45 份；

2. 本基金为本报告期内基金合同生效的基金，无上年度末对比数据。本财务报表的实际编制期间为 2017 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：西部利得个股精选股票型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 23 日(基 金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		33,050,557.85	-
1. 利息收入		542,815.50	-
其中：存款利息收入	7.4.7.11	296,981.78	-
债券利息收入		20.15	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		245,813.57	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		22,506,181.48	-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	19,944,409.75	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	7,039.19	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,554,732.54	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	9,743,893.86	-

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	257,667.01	-
减：二、费用		4,012,652.92	-
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,871,821.39	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	311,970.27	-
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,722,906.26	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	105,955.00	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		29,037,904.93	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		29,037,904.93	-

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间对比数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：西部利得个股精选股票型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2017 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）	200,125,973.37	-	200,125,973.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	29,037,904.93	29,037,904.93
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）	73,317,912.08	-2,782,552.19	70,535,359.89
其中：1. 基金申购款	232,193,203.45	22,902,725.67	255,095,929.12
2. 基金赎回款	-158,875,291.37	-25,685,277.86	-184,560,569.23
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）	-	-16,189,568.59	-16,189,568.59
五、期末所有者权益（基	273,443,885.45	10,065,784.15	283,509,669.60

项目	上年度可比期间 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
	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）	-	-	-

本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间对比数据。

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	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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

西部利得个股精选股票型证券投资基金（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”）《关于准予西部利得个股精选股票型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016] 2220 号）批准，由西部利得基金管理有限公司（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《西部利得个股精选股票型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2017 年 1 月 23 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 200,125,973.37 份基金份额。

本基金的基金管理人为西部利得基金公司，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》及其配套规则、《西部利得个股精选股票型证券投资基金基金合同》和《西部利得个股精选股票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）、国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、中期票据、短期融资券、同业存单、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：股票资产占基金资产的 80%-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×80%+中证全债指数收益率×20%。

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 2018 年 3 月 30 日报出。

7.4.2 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”）、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》、《西部利得个股精选股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易为目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金投资人可选择现金红利或将现金红利按除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》的附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“估值指引”）的处理标准，本基金自2017年12月29日起，对本基金持有的流通受限股票的估值方法进行调整，参考估值指引进行估值。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
活期存款	153,889,267.84	-
定期存款	-	-
其中：存款期限1-3个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	153,889,267.84	-

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	225,125,845.36	234,869,739.22	9,743,893.86
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	225,125,845.36	234,869,739.22	9,743,893.86
项目	上年度末 2016年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
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	-	-	-

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末及上年度期末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产**7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

注：本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末及上年度期末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	28,002.26	-
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	209.44	-
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	5,851.42	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	18.48	-
合计	34,081.60	-

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末及上年度期末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	229,528.46	-
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	229,528.46	-

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.02	-
预提费用	105,000.00	-
合计	105,000.02	-

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2017 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	200,125,973.37	200,125,973.37
本期申购	232,193,203.45	232,193,203.45
本期赎回(以“-”号填列)	-158,875,291.37	-158,875,291.37
- 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	273,443,885.45	273,443,885.45

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	19,294,011.07	9,743,893.86	29,037,904.93
本期基金份额交易产生的变动数	-2,789,398.61	6,846.42	-2,782,552.19
其中：基金申购款	10,420,573.31	12,482,152.36	22,902,725.67
基金赎回款	-13,209,971.92	-12,475,305.94	-25,685,277.86
本期已分配利润	-16,189,568.59	-	-16,189,568.59
本期末	315,043.87	9,750,740.28	10,065,784.15

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	245,415.17	-
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	24,909.52	-
其他	26,657.09	-
合计	296,981.78	-

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.7.12 股票投资收益**7.4.7.12.1 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1月23日(基金 合同生效日)至2017年12月 31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016 年12月31日
卖出股票成交总额	940,895,747.64	-
减：卖出股票成本总额	920,951,337.89	-
买卖股票差价收入	19,944,409.75	-

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.7.13 债券投资收益**7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月23日(基金 合同生效日)至2017年12月 31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	7,039.19	-
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	7,039.19	-

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月23日(基金 合同生效日)至2017年12月 31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	226,359.34	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	219,300.00	-
减：应收利息总额	20.15	-
买卖债券差价收入	7,039.19	-

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入****7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

本基金于本报告期内及上年度期内均未持有资产支持证券。

7.4.7.14 贵金属投资收益**7.4.7.14.1 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。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金在本报告期内未持有贵金属。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

贵金属不在本基金投资范围内。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内未持有贵金属。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金于本报告期内及上年度期内均未持有衍生工具。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金于本报告期内及上年度期内均未持有衍生工具。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月23日(基金合同生效日)至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,554,732.54	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,554,732.54	-

本基金于本报告期末持有股票，未发生股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月23日(基金 合同生效日)至2017年12月 31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 12月31日
1. 交易性金融资产	9,743,893.86	-
——股票投资	9,743,893.86	-
——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	9,743,893.86	-

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月23日(基金合同生 效日)至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31 日
基金赎回费收入	257,666.93	-
转换费	0.08	-
合计	257,667.01	-

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。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月23日(基金合同生 效日)至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31日
交易所市场交易费用	1,722,906.26	-
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,722,906.26	-

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月23日(基金合同 生效日)至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
审计费用	45,000.00	-
信息披露费	60,000.00	-
银行汇划费用	955.00	-
合计	105,955.00	-

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.7.21 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 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	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	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金在本报告期内未与关联方交易。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月23日(基金合同生效日)至 2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	7,457,733.00	0.36%	-	-

注：本基金于本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金于本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金于本报告期内未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金于本报告期内及上年度期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月23日(基金合同生效日)至2017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	3,962.35	0.66%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,871,821.39	-
其中:支付销售机构的客户维护费	18,379.33	-

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 1.2% 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×1.2% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	311,970.27	-

注:支付基金托管人中国兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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:

日托管费=前一日基金资产净值×0.20% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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

份额单位:份

关联方名	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日

称	持有的基金		持有的基金	
	持有的基金份额	基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	基金份额占基金总份额的比例
西部利得-汇通3号资产管理计划	14,483,391.27	5.2967%	-	-

7.4.10.5 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1月23日(基金合同生效日) 至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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
兴业银行股份有限公司	153,889,267.84	245,415.17	-	-

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

2. 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2017年12月31日的相关余额为人民币423,113.27元。

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

-

7.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2017年12月7日	-	2017年12月7日	1.2200	16,188,567.23	1,001.36	16,189,568.59	

合计	-	-	1.2200	16,188,567.23	1,001.36	16,189,568.59	
----	---	---	--------	---------------	----------	---------------	--

7.4.12 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
603161	科华控股	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-

本基金于本报告期末未因认购新发/增发而持有流通受限证券。

7.4.12.2 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
600309	万华化学	2017年12月5日	重要事项未公告	37.94	-	-	18,000	667,701.96	682,920.00	-
300104	乐视网	2017年4月17日	重大资产重组	4.33	2018年1月24日	13.80	143,200	2,608,272.24	620,056.00	-
600332	白云山	2017年10月31日	重要事项未公告	31.77	2018年1月8日	30.15	17,600	481,614.00	559,152.00	-
002739	万达电影	2017年7月4日	拟披露重大事项	45.91	-	-	10,000	523,440.00	459,100.00	-

600150	中国船舶	2017年9月27日	重要事项未公告	24.07	2018年3月21日	22.20	11,900	296,310.00	286,433.00	-
002919	名臣健康	2017年12月28日	重大事项	35.26	2018年1月2日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

本基金于本报告期末未持暂时停牌股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

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。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：

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只普通股票型证券投资基金，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。

7.4.13.2 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兴业银行，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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金管理人根据法律法规制定了《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理办法》，采用事前预警、事中控制和事后评估调整的多重分级控制机制，通过运用制度规范、业务流程控制、实时监控、稽核检查、应急处置等手段对流动性风险进行监督控制。

报告期内本基金严格遵守流动性管理的相关法律法规及管理人内部规定，主要投资于流动性较好的股票，基金 7 日可变现资产始终保持较高水平，基金资产整体具备良好流动性，基金资产的变现能力可有效应对投资者赎回需求。

《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》公布后，本基金未出现接受某一投资者申购申请后导致其份额超过基金总份额 50% 以上的情况。基金管理人对本基金的份额持有人集中度实施严格的监控与管理，根据份额持有人集中度情况对本基金的投资组合实施调整。报告期内本基金主动投资流动性受限资产的市值合计未超过本基金资产净值的 15%。报告期内本基金未出现无法以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项及其他流动性风险事件。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产					
银行存款	153,889,267.84	-	-	-	153,889,267.84
结算备付金	423,113.27	-	-	-	423,113.27
存出保证金	37,405.80	-	-	-	37,405.80
交易性金融资 产	-	-	-	234,869,739.22	234,869,739.22
应收利息	-	-	-	34,081.60	34,081.60
资产总计	154,349,786.91	-	-	234,903,820.82	389,253,607.73
负债					
应付证券清算 款	-	-	-	105,220,772.23	105,220,772.23
应付赎回款	-	-	-	11.44	11.44
应付管理人报 酬	-	-	-	161,679.41	161,679.41
应付托管费	-	-	-	26,946.57	26,946.57
应付交易费用	-	-	-	229,528.46	229,528.46
其他负债	-	-	-	105,000.02	105,000.02
负债总计	-	-	-	105,743,938.13	105,743,938.13
利率敏感度缺 口	154,349,786.91	-	-	129,159,882.69	283,509,669.60
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					

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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的股票，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，来主动应对可能发生的市场价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31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	234,869,739.22	82.84	-	-
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	234,869,739.22	82.84	-	-

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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12月31日）	上年度末（2016年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	16,371,000.00	-
业绩比较基准下降5%	-16,371,000.00	-	

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

7.4.14 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 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 232,212,376.51 元，属于第二层级的余额为 2,657,362.71 元，无属于第三层级的余额。

(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 2017 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	234,869,739.22	60.34
	其中：股票	234,869,739.22	60.34
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	154,312,381.11	39.64
7	其他各项资产	71,487.40	0.02
8	合计	389,253,607.73	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	2,410,684.16	0.85
B	采矿业	4,676,070.00	1.65
C	制造业	138,280,013.86	48.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,823,387.00	1.00
E	建筑业	4,438,432.44	1.57
F	批发和零售业	4,989,050.00	1.76
G	交通运输、仓储和邮政业	8,022,594.94	2.83
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,150,596.00	1.46
J	金融业	48,641,212.42	17.16
K	房地产业	8,877,406.00	3.13
L	租赁和商务服务业	5,429,723.40	1.92

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	792,569.00	0.28
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	1,338,000.00	0.47
S	综合	-	-
	合计	234,869,739.22	82.84

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

8.3 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	153,500	10,741,930.00	3.79
2	600036	招商银行	257,115	7,461,477.30	2.63
3	600519	贵州茅台	8,358	5,829,621.42	2.06
4	600048	保利地产	365,700	5,174,655.00	1.83
5	000651	格力电器	111,200	4,859,440.00	1.71
6	002142	宁波银行	265,926	4,736,142.06	1.67
7	000333	美的集团	83,800	4,645,034.00	1.64
8	600030	中信证券	230,400	4,170,240.00	1.47
9	000063	中兴通讯	105,500	3,835,980.00	1.35
10	002415	海康威视	98,300	3,833,700.00	1.35
11	600104	上汽集团	116,800	3,742,272.00	1.32
12	000858	五粮液	45,800	3,658,504.00	1.29
13	600276	恒瑞医药	51,400	3,545,572.00	1.25
14	000725	京东方 A	605,100	3,503,529.00	1.24
15	000776	广发证券	205,254	3,423,636.72	1.21
16	600887	伊利股份	105,900	3,408,921.00	1.20
17	601288	农业银行	889,780	3,407,857.40	1.20
18	601398	工商银行	546,355	3,387,401.00	1.19
19	600703	三安光电	120,600	3,062,034.00	1.08
20	600009	上海机场	63,200	2,844,632.00	1.00
21	600690	青岛海尔	148,900	2,805,276.00	0.99

22	002008	大族激光	56,700	2,800,980.00	0.99
23	000538	云南白药	27,000	2,748,330.00	0.97
24	600585	海螺水泥	93,500	2,742,355.00	0.97
25	601888	中国国旅	63,100	2,737,909.00	0.97
26	600196	复星医药	61,100	2,718,950.00	0.96
27	002027	分众传媒	191,180	2,691,814.40	0.95
28	600660	福耀玻璃	91,200	2,644,800.00	0.93
29	601933	永辉超市	261,700	2,643,170.00	0.93
30	002450	康得新	118,900	2,639,580.00	0.93
31	000001	平安银行	195,485	2,599,950.50	0.92
32	600438	通威股份	203,500	2,464,385.00	0.87
33	000895	双汇发展	92,300	2,445,950.00	0.86
34	601111	中国国航	198,400	2,444,288.00	0.86
35	000998	隆平高科	93,728	2,410,684.16	0.85
36	601100	恒立液压	85,600	2,348,864.00	0.83
37	601668	中国建筑	259,822	2,343,594.44	0.83
38	600486	扬农化工	43,660	2,169,465.40	0.77
39	603899	晨光文具	87,600	2,160,216.00	0.76
40	603868	飞科电器	28,500	2,158,875.00	0.76
41	600201	生物股份	67,640	2,146,893.60	0.76
42	002311	海大集团	91,700	2,145,780.00	0.76
43	600487	亨通光电	52,800	2,134,176.00	0.75
44	603288	海天味业	39,360	2,117,568.00	0.75
45	601012	隆基股份	58,100	2,117,164.00	0.75
46	002271	东方雨虹	52,973	2,116,801.08	0.75
47	603338	浙江鼎力	26,900	2,115,416.00	0.75
48	600436	片仔癀	33,400	2,110,880.00	0.74
49	002572	索菲亚	57,356	2,110,700.80	0.74
50	000418	小天鹅 A	31,100	2,110,135.00	0.74
51	300136	信维通信	41,614	2,109,829.80	0.74
52	600298	安琪酵母	63,803	2,087,634.16	0.74
53	002508	老板电器	43,400	2,087,540.00	0.74
54	300274	阳光电源	110,980	2,083,094.60	0.73
55	002032	苏泊尔	51,460	2,077,954.80	0.73
56	300072	三聚环保	59,100	2,076,183.00	0.73
57	002621	三垒股份	125,000	1,947,500.00	0.69
58	601939	建设银行	235,576	1,809,223.68	0.64
59	601601	中国太保	37,700	1,561,534.00	0.55
60	002486	嘉麟杰	275,547	1,493,464.74	0.53

61	002286	保龄宝	145,900	1,421,066.00	0.50
62	600900	长江电力	86,300	1,345,417.00	0.47
63	002209	达意隆	119,200	1,197,960.00	0.42
64	600837	海通证券	92,800	1,194,336.00	0.42
65	601088	中国神华	51,100	1,183,987.00	0.42
66	601766	中国中车	93,200	1,128,652.00	0.40
67	601155	新城控股	36,900	1,081,170.00	0.38
68	600019	宝钢股份	122,700	1,060,128.00	0.37
69	601006	大秦铁路	114,000	1,033,980.00	0.36
70	001979	招商蛇口	52,400	1,024,944.00	0.36
71	601211	国泰君安	53,600	992,672.00	0.35
72	601688	华泰证券	49,500	854,370.00	0.30
73	600050	中国联通	131,200	830,496.00	0.29
74	600340	华夏幸福	26,200	822,418.00	0.29
75	601336	新华保险	11,500	807,300.00	0.28
76	601899	紫金矿业	173,300	795,447.00	0.28
77	600383	金地集团	61,300	774,219.00	0.27
78	600958	东方证券	54,200	751,212.00	0.26
79	600999	招商证券	43,236	741,929.76	0.26
80	600028	中国石化	116,300	712,919.00	0.25
81	601225	陕西煤业	85,200	695,232.00	0.25
82	603993	洛阳钼业	99,500	684,560.00	0.24
83	600309	万华化学	18,000	682,920.00	0.24
84	600741	华域汽车	22,000	653,180.00	0.23
85	002460	赣锋锂业	9,100	652,925.00	0.23
86	002456	欧菲科技	30,900	636,231.00	0.22
87	000568	泸州老窖	9,600	633,600.00	0.22
88	300104	乐视网	143,200	620,056.00	0.22
89	603799	华友钴业	7,700	617,771.00	0.22
90	002236	大华股份	26,700	616,503.00	0.22
91	002475	立讯精密	26,150	612,956.00	0.22
92	002304	洋河股份	5,300	609,500.00	0.21
93	600795	国电电力	194,000	605,280.00	0.21
94	600338	西藏珠峰	14,500	603,925.00	0.21
95	600089	特变电工	60,300	597,573.00	0.21
96	601989	中国重工	97,300	586,719.00	0.21
97	002230	科大讯飞	9,800	579,572.00	0.20
98	002202	金风科技	30,000	565,500.00	0.20
99	600332	白云山	17,600	559,152.00	0.20

100	000338	潍柴动力	63,800	532,092.00	0.19
101	600031	三一重工	58,500	530,595.00	0.19
102	601186	中国铁建	47,300	526,922.00	0.19
103	002024	苏宁云商	41,300	507,577.00	0.18
104	300070	碧水源	28,900	501,993.00	0.18
105	600029	南方航空	40,600	483,952.00	0.17
106	600782	新钢股份	73,000	480,340.00	0.17
107	300003	乐普医疗	19,800	478,368.00	0.17
108	000661	长春高新	2,600	475,800.00	0.17
109	601390	中国中铁	56,700	475,713.00	0.17
110	002739	万达电影	10,000	459,100.00	0.16
111	600886	国投电力	62,400	458,016.00	0.16
112	000963	华东医药	8,300	447,204.00	0.16
113	000513	丽珠集团	6,700	445,215.00	0.16
114	600566	济川药业	11,600	442,540.00	0.16
115	600062	华润双鹤	17,860	442,035.00	0.16
116	600066	宇通客车	17,800	428,446.00	0.15
117	002310	东方园林	21,100	425,587.00	0.15
118	600271	航天信息	19,700	424,338.00	0.15
119	600023	浙能电力	77,800	414,674.00	0.15
120	601607	上海医药	16,900	408,811.00	0.14
121	600570	恒生电子	8,800	408,320.00	0.14
122	000423	东阿阿胶	6,751	406,882.77	0.14
123	000425	徐工机械	83,100	384,753.00	0.14
124	600018	上港集团	56,800	377,720.00	0.13
125	600068	葛洲坝	46,000	377,200.00	0.13
126	300059	东方财富	27,000	349,650.00	0.12
127	300124	汇川技术	11,800	342,436.00	0.12
128	600522	中天科技	23,500	327,590.00	0.12
129	601222	林洋能源	31,100	315,354.00	0.11
130	600809	山西汾酒	5,500	313,445.00	0.11
131	600153	建发股份	28,100	312,472.00	0.11
132	300251	光线传媒	29,800	311,410.00	0.11
133	601877	正泰电器	11,900	311,185.00	0.11
134	600377	宁沪高速	31,100	306,335.00	0.11
135	002343	慈文传媒	8,600	306,246.00	0.11
136	002624	完美世界	9,100	304,486.00	0.11
137	600702	沱牌舍得	6,500	303,290.00	0.11
138	002174	游族网络	13,500	301,050.00	0.11

139	000826	启迪桑德	8,800	290,576.00	0.10
140	600170	上海建工	77,800	289,416.00	0.10
141	000039	中集集团	12,600	287,910.00	0.10
142	600150	中国船舶	11,900	286,433.00	0.10
143	600859	王府井	14,000	285,600.00	0.10
144	002385	大北农	46,600	282,396.00	0.10
145	600406	国电南瑞	15,300	279,684.00	0.10
146	600760	中航黑豹	8,000	279,120.00	0.10
147	600352	浙江龙盛	23,400	274,014.00	0.10
148	300133	华策影视	24,100	261,244.00	0.09
149	601021	春秋航空	7,000	260,890.00	0.09
150	600004	白云机场	17,200	252,840.00	0.09
151	600038	中直股份	5,400	251,262.00	0.09
152	600588	用友网络	11,600	245,340.00	0.09
153	002013	中航机电	21,601	233,074.79	0.08
154	002153	石基信息	8,700	231,942.00	0.08
155	000581	威孚高科	9,300	223,200.00	0.08
156	600482	中国动力	8,700	215,847.00	0.08
157	000759	中百集团	21,600	208,656.00	0.07
158	000830	鲁西化工	13,000	206,960.00	0.07
159	002597	金禾实业	7,500	194,400.00	0.07
160	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	0.06
161	002916	深南电路	2,033	177,338.59	0.06
162	000501	鄂武商 A	11,000	175,560.00	0.06
163	002042	华孚时尚	12,600	168,714.00	0.06
164	002078	太阳纸业	18,100	167,968.00	0.06
165	000726	鲁泰 A	14,700	160,965.00	0.06
166	002562	兄弟科技	9,600	157,056.00	0.06
167	000488	晨鸣纸业	9,400	156,698.00	0.06
168	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.01
169	603477	振静股份	1,955	37,027.70	0.01
170	300735	光弘科技	2,333	33,571.87	0.01
171	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.01
172	603161	科华控股	1,239	20,753.25	0.01
173	603283	赛腾股份	1,349	19,614.46	0.01
174	603329	上海雅仕	1,183	17,957.94	0.01
175	300684	中石科技	827	11,528.38	0.00
176	603655	朗博科技	881	8,193.30	0.00
177	600933	爱柯迪	100	1,537.00	0.00

178	603365	水星家纺	3	69.33	0.00
179	603605	珀莱雅	2	57.44	0.00

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	601318	中国平安	13,635,534.00	4.81
2	000651	格力电器	9,870,010.00	3.48
3	600104	上汽集团	9,628,925.00	3.40
4	600036	招商银行	8,928,948.77	3.15
5	000938	紫光股份	8,429,097.93	2.97
6	002142	宁波银行	8,155,120.80	2.88
7	600519	贵州茅台	7,701,220.94	2.72
8	601601	中国太保	7,118,771.00	2.51
9	000776	广发证券	6,902,457.00	2.43
10	600585	海螺水泥	6,490,207.86	2.29
11	601288	农业银行	6,425,600.00	2.27
12	601398	工商银行	6,368,057.96	2.25
13	000333	美的集团	5,951,878.00	2.10
14	601988	中国银行	5,926,753.00	2.09
15	600196	复星医药	5,900,351.25	2.08
16	000001	平安银行	5,789,316.38	2.04
17	601998	中信银行	5,587,990.41	1.97
18	000156	华数传媒	5,360,503.95	1.89
19	600030	中信证券	5,356,751.08	1.89
20	002415	海康威视	5,283,409.76	1.86

8.4.2 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	000938	紫光股份	8,345,871.89	2.94
2	601318	中国平安	6,968,252.00	2.46
3	601601	中国太保	6,625,609.15	2.34
4	600104	上汽集团	6,281,526.00	2.22
5	000651	格力电器	5,810,190.86	2.05
6	601988	中国银行	5,756,436.12	2.03
7	601998	中信银行	5,435,044.00	1.92
8	000156	华数传媒	5,284,282.84	1.86
9	002142	宁波银行	4,956,498.30	1.75
10	000712	锦龙股份	4,924,378.79	1.74
11	600000	浦发银行	4,907,162.47	1.73
12	300146	汤臣倍健	4,889,424.11	1.72
13	600066	宇通客车	4,809,745.40	1.70
14	000338	潍柴动力	4,455,398.65	1.57
15	000415	渤海金控	4,454,264.00	1.57
16	002202	金风科技	4,445,545.16	1.57
17	601088	中国神华	4,412,824.06	1.56
18	600188	兖州煤业	4,143,395.62	1.46
19	002153	石基信息	4,132,628.63	1.46
20	000402	金融街	4,054,275.01	1.43

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	1,146,077,183.25
卖出股票收入（成交）总额	940,895,747.64

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金于本报告期末未持有债券。

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

本基金于本报告期末未持有债券。

8.7 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

本基金于本报告期末未持有贵金属。

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金于本报告期内未持有国债期货。

8.11.2 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。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金于本报告期内未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	37,405.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	34,081.60
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	71,487.40

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 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。

§ 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
231	1,183,739.76	265,110,469.09	96.95%	8,333,416.36	3.05%

9.2 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%

9.3 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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年1月23日）基金份额总额	200,125,973.37
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	232,193,203.45
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	158,875,291.37
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	273,443,885.45

§ 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无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及基金管理人、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 45,000 元。截至报告期末连续服务期为 1~2 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	1,582,505,655.47	76.01%	255,261.92	42.73%	-
太平洋证券	2	116,497,016.35	5.60%	73,544.67	12.31%	-
东兴证券	1	106,530,606.16	5.12%	77,906.02	13.04%	-
中信建投	1	58,148,914.38	2.79%	54,154.12	9.07%	-
华创证券	2	53,051,234.44	2.55%	17,576.44	2.94%	-
光大证券	2	50,187,822.75	2.41%	39,713.68	6.65%	-
广发证券	1	49,128,644.89	2.36%	35,927.63	6.01%	-
海通证券	1	30,895,924.55	1.48%	16,415.03	2.75%	-
中泰证券	2	27,506,122.50	1.32%	22,865.40	3.83%	-
西部证券	2	7,457,733.00	0.36%	3,962.35	0.66%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-

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	214,434.00	94.73%	1,221,500,000.00	90.05%	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	135,000,000.00	9.95%	-	-

中信建投	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	11,925.34	5.27%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	
--	--	----------	--

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	1-3 个月	0.00	101,950,674.82	-	101,950,674.82	37.28%
	2	1-3 个月	0.00	83,246,420.71	-	83,246,420.71	30.44%
个人	1	3-6 个月	0.00	50,017,000.00	50,017,000.00	0.00	0.00%
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金为股票型基金，其主要风险包括但不限于：股票价格波动风险、流动性风险等。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准设立的相关文件；
- (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) 报告期内本基金公告的各项原稿。

13.2 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

13.3 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

2018 年 3 月 30 日