

西部利得新盈灵活配置混合型证券投资基金

2020 年中期报告

2020 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：中国银河证券股份有限公司

送出日期：二〇二〇年八月三十一日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银河证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 27 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 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	45
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.....	45
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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息.....	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
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.....	48
§9 开放式基金份额变动.....	49
§10 重大事件揭示.....	50
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	52

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	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§12 备查文件目录.....	53
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	西部利得新盈灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	西部利得新盈混合
场内简称	-
基金主代码	673050
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	2016 年 1 月 22 日
基金管理人	西部利得基金管理有限公司
基金托管人	中国银河证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	229,261,216.06 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	本基金通过构建有效的投资组合，在严格控制风险的前提下，力求获得长期稳定的收益。
投资策略	大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、资产支持证券投资策略。（详见《基金合同》）
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，在通常情况下其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于证券投资基金中等风险水平的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		西部利得基金管理有限公司	中国银河证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵毅	李淼
	联系电话	021-38572888	010-66568780
	电子邮箱	service@westleadfund.com	yhqz_tggz@chinastock.com.cn
客户服务电话		4007-007-818;021-38572666	95551; 400-888-8888
传真		021-38572750	010-66568532
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	中国北京西城区金融大街 35 号 2-6 层
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴世纪	中国北京西城区金融大街 35 号

	金融广场 3 号楼 11 楼	国际企业大厦 C 座
邮政编码	200127	100033
法定代表人	何方	陈共炎

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	11,709,517.08
本期利润	35,920,574.44
加权平均基金份额本期利润	0.2047
本期加权平均净值利润率	16.85%
本期基金份额净值增长率	18.69%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	32,711,347.15
期末可供分配基金份额利润	0.1427
期末基金资产净值	307,230,904.43
期末基金份额净值	1.340
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	34.00%

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	7.03%	0.66%	3.34%	0.44%	3.69%	0.22%
过去三个月	18.06%	0.82%	6.14%	0.45%	11.92%	0.37%
过去六个月	18.69%	1.16%	2.46%	0.74%	16.23%	0.42%
过去一年	26.18%	0.87%	7.64%	0.60%	18.54%	0.27%
过去三年	30.48%	0.50%	16.99%	0.62%	13.49%	-0.12%
自基金合同生效起至今	34.00%	0.41%	29.08%	0.59%	4.92%	-0.18%

注：本基金的业绩基准指数=沪深300指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50% 其中：沪深300

指数作为衡量股票投资部分的业绩基准，中证全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。中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，具有很高的代表性。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：

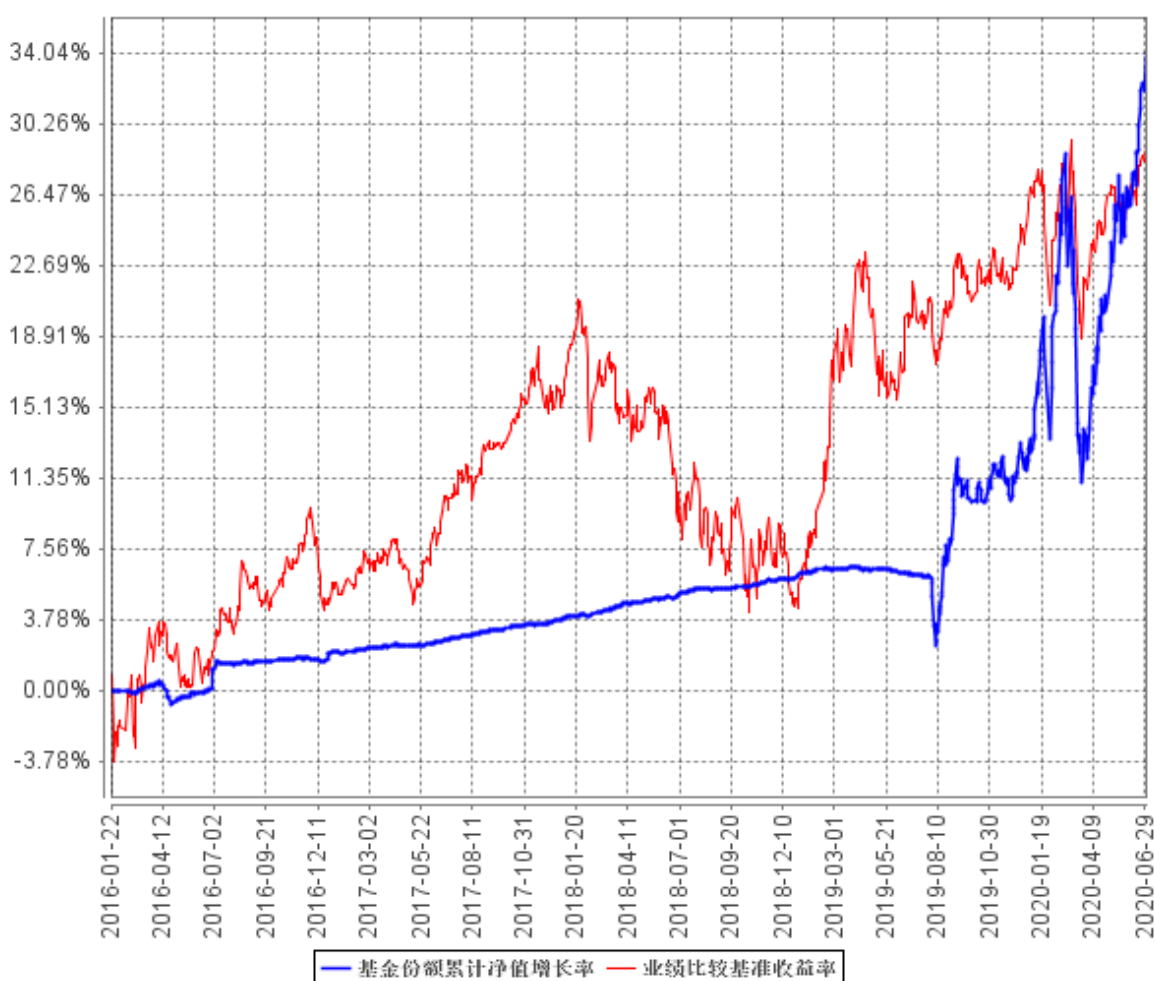
$benchmark(0)=1000$;

$\%benchmark(t) = 50\% * (\text{沪深 300 指数收益率}(t) / \text{沪深 300 指数收益率}(t-1) - 1) + 50\% * (\text{中证全债指数收益率}(t) / \text{中证全债指数收益率}(t-1) - 1)$;

$benchmark(t) = (1 + \%benchmark(t)) * benchmark(t-1)$; 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



3.3 其他指标

无

§ 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2020年6月30日，本基金管理人旗下共管理39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		
韩丽楠	基金经理	2016年2月4日	-	15年	英国约克大学经济与金融硕士，曾任渣打银行国际管理培训生、诺德基金管理有限公司研究员、上海元普投资管理有限公司固定收益投资总监。2015年5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遵规守信情况的说明

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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

本报告期内，两两组合同单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为 0 的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

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

报告期内海外疫情出现反复，全球经济以波折缓慢复苏为主。疫情在国内得到有效控制，国内经济逐步复苏。债市短期受经济基本面好转以及货币政策可能出现边际变化等预期扰动，资金中枢抬升，利率显著上行，波动加大，大类资产配置向权益资产倾斜。海外资金不断加码 A 股，国家扶持权益市场发展，新股发行制度持续改革，引导居民财富配置逐步向专业机构倾斜。在此背景下，绩优股受到国内外资金的青睐；科创板估值体系对主板和中小创的优质公司形成引导，高成长行业估值不断突破。

本基金在报告期内固定收益投资主要配置了流动性较好的短久期利率债和高等级银行存单，配置上兼顾流动性和收益性，并适度使用杠杆套利操作提高收益。权益投资上主要投向为行业发展空间大，有清晰、可持续的盈利模式，拥有较强竞争优势和运营效率的行业龙头，或者处于行业细分赛道领先地位的优秀成长型公司。

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

随着疫情逐步缓解，我们预计下半年经济数据将继续环比改善，为权益市场的稳定提供业绩基础。货币政策下半年大概率仍将趋于稳定，前期金融市场充裕的资金逐步进入实体经济，短期债市可能仍存在一定调整压力。权益方面，股价由估值驱动转为盈利驱动，业绩的确定性更为重要。目前中国权益资产占全球的比重仍处于低位，中长期的国际配置资金仍将不断流入。我们认为消费和制造业的升级趋势不可逆转，继续看好中国经济的转型潜力。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

程序的制订和解释；在发生影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况，以及在采用新投资策略或投资新品种时，估值委员会负责对所采用的估值模型、假设及参数的适当性进行重新评估或修订，必要时聘请会计师事务所进行审核并出具意见。针对个别投资品种的估值方法调整，均须通过托管银行复核。

估值委员会的成员包括投资管理部、风险控制岗、监察稽核部、基金运营部等有关人员组成。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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场债券品种的估值数据及交易所交易的债券品种的估值数据、流通受限股票流动性折扣。

4.7 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“6.4.11 利润分配情况”。

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

本报告期内，中国银河证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本托管人按照《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，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的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法复核西部利得基金管理有限公司编制和披露的西部利得新盈灵活配置混合型证券投资基金 2020 年中期报告中财务指标、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，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：西部利得新盈灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	10,280,071.27	5,818,193.44
结算备付金		1,612,885.13	1,294,110.91
存出保证金		198,030.45	199,026.45
交易性金融资产	6.4.7.2	306,819,228.04	200,005,146.70
其中：股票投资		180,766,544.44	112,735,647.90
基金投资		-	-
债券投资		126,052,683.60	87,269,498.80
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	-	3,900,000.00
应收证券清算款		56,008,714.52	1,100,842.47
应收利息	6.4.7.5	2,528,624.65	1,337,506.13
应收股利		-	-
应收申购款		1,118.66	4,400.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		377,448,672.72	213,659,226.29
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负 债：			
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		13,000,000.00	-
应付证券清算款		56,605,409.57	-
应付赎回款		147.97	122,139.01
应付管理人报酬		325,267.31	288,167.00
应付托管费		21,684.50	19,211.15
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	169,750.94	158,332.66
应交税费		-	0.09

应付利息		1,972.60	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	93,535.40	139,230.68
负债合计		70,217,768.29	727,080.59
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	229,261,216.06	188,655,653.40
未分配利润	6.4.7.10	77,969,688.37	24,276,492.30
所有者权益合计		307,230,904.43	212,932,145.70
负债和所有者权益总计		377,448,672.72	213,659,226.29

报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.340 元，基金份额总额 229,261,216.06 份。

6.2 利润表

会计主体：西部利得新盈灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		38,577,346.45	580,747.95
1.利息收入		1,591,781.05	622,785.94
其中：存款利息收入	6.4.7.11	44,793.25	22,629.65
债券利息收入		1,475,322.61	589,646.13
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		71,665.19	10,510.16
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		12,706,777.95	94,898.00
其中：股票投资收益	6.4.7.12	11,854,410.81	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	57,669.01	94,898.00
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	794,698.13	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	24,211,057.36	-137,153.60
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	67,730.09	217.61
减：二、费用		2,656,772.01	408,209.47
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,596,527.57	296,264.90
2. 托管费	6.4.10.2.2	106,435.14	19,750.98
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	6.4.7.19	627,330.21	743.22
5. 利息支出		223,343.48	-
其中：卖出回购金融资产支出		223,343.48	-
6. 税金及附加		0.25	-
7. 其他费用	6.4.7.20	103,135.36	91,450.37
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		35,920,574.44	172,538.48
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		35,920,574.44	172,538.48

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：西部利得新盈灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	188,655,653.40	24,276,492.30	212,932,145.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	35,920,574.44	35,920,574.44
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）	40,605,562.66	17,772,621.63	58,378,184.29
其中：1.基金申购款	109,133,843.83	28,602,401.76	137,736,245.59
2.基金赎回款	-68,528,281.17	-10,829,780.13	-79,358,061.30
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）	229,261,216.06	77,969,688.37	307,230,904.43
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		

托管人为中国银河证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《西部利得新盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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)、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(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。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 0%-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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%。

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<年度和中期报告>》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 2020 年度中期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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年度中期的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期末发生会计政策和会计估计变更。

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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[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]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(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）运营资管产品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。对资管产品在 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、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(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) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入个人所得税应纳税所得额。

(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) 对投资者从证券投资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，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	10,280,071.27
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	10,280,071.27

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	151,264,931.63	180,766,544.44	29,501,612.81
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	96,912,079.70	96,883,683.60
	银行间市场	29,102,400.00	29,169,000.00
	合计	126,014,479.70	126,052,683.60
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	277,279,411.33	306,819,228.04	29,539,816.71

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	1,218.18
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	725.80
应收债券利息	2,526,591.57
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	89.10
合计	2,528,624.65

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	169,087.09
银行间市场应付交易费用	663.85
合计	169,750.94

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.04
预提费用	93,535.36
合计	93,535.40

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	188,655,653.40	188,655,653.40
本期申购	109,133,843.83	109,133,843.83
本期赎回(以“-”号填列)	-68,528,281.17	-68,528,281.17
- 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	229,261,216.06	229,261,216.06

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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
上年度末	14,405,306.05	9,871,186.25	24,276,492.30
本期利润	11,709,517.08	24,211,057.36	35,920,574.44

本期基金份额交易产生的变动数	6,596,524.02	11,176,097.61	17,772,621.63
其中：基金申购款	13,190,301.72	15,412,100.04	28,602,401.76
基金赎回款	-6,593,777.70	-4,236,002.43	-10,829,780.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	32,711,347.15	45,258,341.22	77,969,688.37

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	34,556.24
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	8,604.99
其他	1,632.02
合计	44,793.25

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	238,772,546.02
减：卖出股票成本总额	226,918,135.21
买卖股票差价收入	11,854,410.81

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30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	57,669.01
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	57,669.01
----	-----------

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	12,668,345.63
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	12,334,399.10
减：应收利息总额	276,277.52
买卖债券差价收入	57,669.01

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期未有债券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期未有债券申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未投资资产支持证券，资产支持证券投资收益为零。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

贵金属不在本基金投资范围内。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

贵金属不在本基金投资范围内。

6.4.7.14.3 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。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

贵金属不在本基金投资范围内。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内未投资衍生工具，衍生工具收益为零。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内未持有衍生工具。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	794,698.13
基金投资产生的股利收益	-
合计	794,698.13

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	24,211,057.36
——股票投资	24,236,033.46
——债券投资	-24,976.10
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	24,211,057.36

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	67,708.21
转换费	21.88

合计	67,730.09
----	-----------

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。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	627,330.21
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	627,330.21

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
其他	600.00
债券账户维护费	18,000.00
合计	103,135.36

6.4.7.21 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。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
西部证券股份有限公司	基金管理人的股东
利得科技有限公司	基金管理人的股东
中国银河证券股份有限公司	基金托管人
西部利得-汇通 3 号资产管理计划	基金管理人管理的资产管理计划

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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
银河证券	286,819,407.77	57.77%	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	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 成交总额的比例
银河证券	58,074,940.30	99.57%	42,395,239.20	100.00%

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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
银河证券	1,333,100,000.00	78.83%	54,500,000.00	100.00%

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020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
银河证券	204,014.38	64.69%	115,978.96	68.59%
关联方名称	上年度可比期间 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
银河证券	-	-	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,596,527.57	296,264.90
其中：支付销售机构的客户维护费	282,261.59	29.67

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。其计算公式为：

日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	106,435.14	19,750.98

注：支付基金托管人中国银河证券股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.1% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金于本报告期内及上年度可比期间未发生应支付关联方的销售服务费。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

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。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

截止至报告期末，本基金报告期在基金托管人银河证券无存款余额，同时也无相应的存款利息收入。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新股流通受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新股流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新股流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新股流通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
688027	国盾量子	2020年6月30日	2020年7月9日	新股流通受限	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688377	迪威	2020年	2020	新股	16.42	16.42	7,163	117,616.46	117,616.46	-

	尔	6月29日	年7月8日	流通受限						
688568	中科星图	2020年6月30日	2020年7月8日	新股流通受限	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	-
688600	皖仪科技	2020年6月23日	2020年7月3日	新股流通受限	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-
601816	京沪高铁	2020年1月8日	2020年7月16日	IPO 老股转让受限	4.88	6.17	906,536	4,423,895.68	5,593,327.12	-
688096	京源环保	2020年3月31日	2020年10月9日	网下配售摇号锁定	14.34	21.42	4,485	64,314.90	96,068.70	-
688298	东方生物	2020年1月20日	2020年8月5日	网下配售摇号锁定	21.25	144.17	4,651	98,833.75	670,534.67	-
688312	燕麦科技	2020年5月29日	2020年12月8日	网下配售摇号锁定	19.68	41.77	7,390	145,435.20	308,680.30	-
688598	金博股份	2020年5月8日	2020年11月18日	网下配售摇号锁定	47.20	77.94	4,301	203,007.20	335,219.94	-

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括信用风险、流动性风险、市场风险等。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人实行全员参与的全面风险管理，董事会及其下设合规审核委员会、监事会、经营管理层及其下设合规及风险管理委员会、督察长、风险管理部、监察稽核部、各业务部门和分支机构均根据公司制度规定履行各自的风险管理职责。

6.4.13.2 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建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金均投资于具有良好信用等级的证券；银行存款均存放于信用良好的银行；在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	45,874,683.60	10,010,998.80
合计	45,874,683.60	10,010,998.80

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债、超短期融资券等无信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	29,169,000.00	29,118,000.00
合计	29,169,000.00	29,118,000.00

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债、超短期融资券和银行同业存单等无信用评级的债券。

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	-	35,000.00
AAA 以下	-	22,000.00
未评级	51,009,000.00	48,083,500.00
合计	51,009,000.00	48,140,500.00

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债等无信用评级的债券。

6.4.13.3 流动性风险

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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。

6.4.13.4 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。本基金管理人通过监测组合久期、Beta 值等指标来衡量市场风险。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	10,280,071.27	-	-	-	10,280,071.27
结算备付金	1,612,885.13	-	-	-	1,612,885.13
存出保证金	198,030.45	-	-	-	198,030.45

交易性金融资产	90,066,183.60	35,986,500.00	-	180,766,544.44	306,819,228.04
应收证券清算款	-	-	-	56,008,714.52	56,008,714.52
应收利息	-	-	-	2,528,624.65	2,528,624.65
应收申购款	-	-	-	1,118.66	1,118.66
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	102,157,170.45	35,986,500.00	-	239,305,002.27	377,448,672.72
负债					
卖出回购金融资产款	13,000,000.00	-	-	-	13,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	56,605,409.57	56,605,409.57
应付赎回款	-	-	-	147.97	147.97
应付管理人报酬	-	-	-	325,267.31	325,267.31
应付托管费	-	-	-	21,684.50	21,684.50
应付交易费用	-	-	-	169,750.94	169,750.94
应付利息	-	-	-	1,972.60	1,972.60
其他负债	-	-	-	93,535.40	93,535.40
负债总计	13,000,000.00	-	-	57,217,768.29	70,217,768.29
利率敏感度缺口	89,157,170.45	35,986,500.00	-	182,087,233.98	307,230,904.43
上年度末 2019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	5,818,193.44	-	-	-	5,818,193.44
结算备付金	1,294,110.91	-	-	-	1,294,110.91
存出保证金	199,026.45	-	-	-	199,026.45
交易性金融资产	49,260,998.80	38,008,500.00	-	112,735,647.90	200,005,146.70
买入返售金融资产	3,900,000.00	-	-	-	3,900,000.00
应收证券清算款	-	-	-	1,100,842.47	1,100,842.47
应收利息	-	-	-	1,337,506.13	1,337,506.13
应收申购款	-	-	-	4,400.19	4,400.19
资产总计	60,472,329.60	38,008,500.00	-	115,178,396.69	213,659,226.29
负债					
应付赎回款	-	-	-	122,139.01	122,139.01
应付管理人报酬	-	-	-	288,167.00	288,167.00
应付托管费	-	-	-	19,211.15	19,211.15
应付交易费用	-	-	-	158,332.66	158,332.66
应交税费	-	-	-	0.09	0.09
其他负债	-	-	-	139,230.68	139,230.68
负债总计	-	-	-	727,080.59	727,080.59
利率敏感度缺口	60,472,329.60	38,008,500.00	-	114,451,316.10	212,932,145.70

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	市场利率上升 25 个基点	-219,000.00	-276,000.00
市场利率下降 25 个基点	219,000.00	277,000.00	

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019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	180,766,544.44	58.84	112,735,647.90	52.94
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	126,052,683.60	41.03	87,269,498.80	40.98
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	306,819,228.04	99.87	200,005,146.70	93.93

6.4.13.4.3.2 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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	4,293,039.89	709,064.05
	业绩比较基准下降 5%	-4,293,039.89	-709,064.05

6.4.14 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 2020 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 180,256,496.40 元，属于第二层次的余额为 126,562,731.64 元，无属于第三层次的余额(2019 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 104,700,237.19 元，属于第二层级的余额为 95,304,909.51 元，无属于第三层级的余额)。

(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 2020 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（2019 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	180,766,544.44	47.89
	其中：股票	180,766,544.44	47.89
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	126,052,683.60	33.40
	其中：债券	126,052,683.60	33.40
	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	11,892,956.40	3.15
8	其他各项资产	58,736,488.28	15.56
9	合计	377,448,672.72	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	138,947,545.73	45.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	5,593,327.12	1.82
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,327,442.07	4.66
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	5,139,640.00	1.67
N	水利、环境和公共设施管理业	12,471,123.20	4.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,274,700.00	1.39
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	180,766,544.44	58.84

7.2.2 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002460	赣锋锂业	175,000	9,374,750.00	3.05
2	603666	亿嘉和	78,400	6,880,384.00	2.24
3	300815	玉禾田	55,880	6,853,123.20	2.23
4	603893	瑞芯微	75,000	6,787,500.00	2.21
5	300192	科斯伍德	360,000	6,076,800.00	1.98
6	603195	公牛集团	35,453	5,695,524.45	1.85
7	601816	京沪高铁	906,536	5,593,327.12	1.82
8	002311	海大集团	115,000	5,472,850.00	1.78
9	300782	卓胜微	12,600	5,112,702.00	1.66
10	603259	药明康德	50,400	4,868,640.00	1.58
11	300639	凯普生物	90,000	4,673,700.00	1.52
12	600276	恒瑞医药	50,000	4,615,000.00	1.50
13	603568	伟明环保	195,000	4,524,000.00	1.47
14	300379	东方通	100,000	4,303,000.00	1.40
15	300567	精测电子	60,000	4,095,000.00	1.33
16	603605	珀莱雅	20,000	3,600,400.00	1.17
17	300308	中际旭创	56,000	3,528,000.00	1.15
18	002970	锐明技术	50,902	3,478,133.66	1.13
19	603290	斯达半导	16,000	3,356,800.00	1.09
20	300832	新产业	19,382	3,337,386.58	1.09
21	688012	中微公司	15,000	3,289,650.00	1.07
22	300482	万孚生物	30,000	3,120,000.00	1.02
23	300725	药石科技	25,000	3,106,250.00	1.01
24	603658	安图生物	19,000	3,086,360.00	1.00
25	603986	兆易创新	13,000	3,066,830.00	1.00

26	600570	恒生电子	28,039	3,019,800.30	0.98
27	600585	海螺水泥	50,000	2,645,500.00	0.86
28	300015	爱尔眼科	60,000	2,607,000.00	0.85
29	002705	新宝股份	70,000	2,553,600.00	0.83
30	601615	明阳智能	200,000	2,490,000.00	0.81
31	600132	重庆啤酒	33,000	2,409,000.00	0.78
32	601100	恒立液压	30,000	2,406,000.00	0.78
33	600315	上海家化	50,000	2,395,000.00	0.78
34	688111	金山办公	7,000	2,391,060.00	0.78
35	603345	安井食品	20,000	2,360,000.00	0.77
36	300406	九强生物	100,000	2,300,000.00	0.75
37	603638	艾迪精密	43,500	2,279,400.00	0.74
38	000338	潍柴动力	159,960	2,194,651.20	0.71
39	600031	三一重工	110,000	2,063,600.00	0.67
40	002812	恩捷股份	30,000	1,974,000.00	0.64
41	603927	中科软	30,000	1,813,200.00	0.59
42	002371	北方华创	10,000	1,709,100.00	0.56
43	600763	通策医疗	10,000	1,667,700.00	0.54
44	603899	晨光文具	30,000	1,638,000.00	0.53
45	300450	先导智能	35,000	1,617,350.00	0.53
46	603517	绝味食品	20,000	1,414,800.00	0.46
47	300529	健帆生物	19,000	1,320,500.00	0.43
48	603313	梦百合	50,000	1,176,500.00	0.38
49	300768	迪普科技	25,000	1,157,250.00	0.38
50	603305	旭升股份	28,700	1,098,636.00	0.36
51	600323	瀚蓝环境	50,000	1,094,000.00	0.36
52	688126	沪硅产业	31,000	1,062,680.00	0.35
53	300559	佳发教育	50,000	1,061,000.00	0.35
54	688016	心脉医疗	3,000	1,041,780.00	0.34
55	603659	璞泰来	10,000	1,030,200.00	0.34
56	300014	亿纬锂能	19,936	953,937.60	0.31
57	300673	佩蒂股份	20,000	777,600.00	0.25
58	688298	东方生物	4,651	670,534.67	0.22
59	688198	佰仁医疗	5,000	658,650.00	0.21
60	688008	澜起科技	5,000	508,400.00	0.17
61	688268	华特气体	5,216	482,740.80	0.16
62	688123	聚辰股份	5,328	410,256.00	0.13
63	300010	立思辰	20,000	391,400.00	0.13
64	688598	金博股份	4,301	335,219.94	0.11

65	688312	燕麦科技	7,390	308,680.30	0.10
66	002967	广电计量	10,000	271,000.00	0.09
67	603755	日辰股份	3,000	265,080.00	0.09
68	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.06
69	688310	迈得医疗	3,276	123,144.84	0.04
70	688377	迪威尔	7,163	117,616.46	0.04
71	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.03
72	688096	京源环保	4,485	96,068.70	0.03
73	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.03
74	603087	甘李药业	731	73,319.30	0.02
75	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
76	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
77	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
78	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
79	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
80	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
81	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	002460	赣锋锂业	11,140,777.00	5.23
2	601988	中国银行	10,470,000.00	4.92
3	300815	玉禾田	7,796,552.40	3.66
4	300567	精测电子	6,362,565.00	2.99
5	601816	京沪高铁	6,319,848.88	2.97
6	603195	公牛集团	6,107,073.15	2.87
7	601390	中国中铁	6,065,072.00	2.85
8	300192	科斯伍德	5,893,231.00	2.77
9	603666	亿嘉和	5,870,999.20	2.76
10	603568	伟明环保	5,735,036.50	2.69
11	002311	海大集团	5,698,079.70	2.68
12	300639	凯普生物	5,670,110.80	2.66
13	300550	和仁科技	5,427,394.35	2.55

14	601398	工商银行	5,170,000.00	2.43
15	603893	瑞芯微	5,023,771.80	2.36
16	300406	九强生物	4,997,401.00	2.35
17	603899	晨光文具	4,671,888.48	2.19
18	300379	东方通	4,614,392.81	2.17
19	300253	卫宁健康	4,371,029.80	2.05
20	600536	中国软件	4,161,261.00	1.95

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	601988	中国银行	10,484,000.00	4.92
2	603658	安图生物	10,300,735.00	4.84
3	600276	恒瑞医药	7,174,807.78	3.37
4	600585	海螺水泥	7,129,272.70	3.35
5	603288	海天味业	6,453,850.40	3.03
6	601390	中国中铁	6,378,240.00	3.00
7	603638	艾迪精密	5,568,907.41	2.62
8	601398	工商银行	5,144,300.00	2.42
9	600703	三安光电	4,551,499.00	2.14
10	603986	兆易创新	4,478,048.00	2.10
11	300550	和仁科技	4,373,205.20	2.05
12	600570	恒生电子	4,298,224.00	2.02
13	300253	卫宁健康	4,059,076.00	1.91
14	600536	中国软件	3,774,459.59	1.77
15	601658	邮储银行	3,740,019.26	1.76
16	601615	明阳智能	3,689,752.40	1.73
17	603899	晨光文具	3,659,496.00	1.72
18	600763	通策医疗	3,434,187.00	1.61
19	603866	桃李面包	3,424,564.74	1.61
20	300595	欧普康视	3,157,525.00	1.48

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	270,712,998.29
卖出股票收入（成交）总额	238,772,546.02

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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（%）
1	国家债券	45,386,490.00	14.77
2	央行票据	-	-
3	金融债券	51,497,193.60	16.76
	其中：政策性金融债	51,497,193.60	16.76
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	29,169,000.00	9.49
9	其他	-	-
10	合计	126,052,683.60	41.03

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	019627	20 国债 01	299,800	29,994,990.00	9.76
2	111909330	19 浦发银行 CD330	300,000	29,169,000.00	9.49
3	018061	进出 1911	158,670	15,879,693.60	5.17
4	010107	21 国债(7)	150,000	15,391,500.00	5.01
5	018007	国开 1801	150,000	15,022,500.00	4.89

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

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

股指期货不在本基金投资范围内。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货不在本基金投资范围内。

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	198,030.45
2	应收证券清算款	56,008,714.52
3	应收股利	-
4	应收利息	2,528,624.65
5	应收申购款	1,118.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	58,736,488.28

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601816	京沪高铁	5,593,327.12	1.82	流通受限

§ 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
402	570,301.53	215,477,698.89	93.99%	13,783,517.17	6.01%

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	85,037.67	0.0371%

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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年1月22日）基金份额总额	200,069,442.78
本报告期期初基金份额总额	188,655,653.40
本报告期基金总申购份额	109,133,843.83
减：本报告期基金总赎回份额	68,528,281.17
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	229,261,216.06

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无重大人事变动。
基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、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，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况如下：2020 年 4 月 22 日，北京证监局向公司下发《行政监管措施决定书（中国银河证券股份有限公司）》（〔2020〕64 号），针对公司持有的一种非权益类证券超规模；作为私募股权投资基金托管人，根据基金管理人提供的单方说明变更收款账户，将基金财产划至管理人账户等行为出具行政监管处罚措施，责令公司限期改正，要求公司完善内部控制，加强风险控制指标监控，及时发现并报告相关情况；作为私募股权投资基金托管人，尽职履责，切实履行义务，并于收到决定书之日起 30 日内向北京证监局提交书面整改报告。对于上述事项，公司高度重视并责成相关部门全面、深入查找分析问题根源，采取了有效、有针对性的整改措施，进一步加强风险控制指标监控工作，做好金仕达系统和风险独立监控系统的升级完善工作，加强对风险控制指标的跨部门协同管理工作，并采取有效措施建立长效机制；进一步加强托管业务管理流程，完成对非标产品划款审批流程和合同范本的修订工作，完善对管理人和产品的引入尽调及评审的相关流程，从源头上杜绝私募股权基金托管的风险。公司于 2020 年 5 月 22 日向北京证监局报送了《公司就〈关于对中国银河证券股份有限公司采取责令改正措施的决定〉整改情况的报告》。

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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
银河证券	2	286,819,407.77	57.77%	204,014.38	64.69%	-
国金证券	1	209,640,631.38	42.23%	111,380.55	35.31%	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-

注：1. 基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资力雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各券商提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合席位券商标准的，由公司研究部提出席位券商的调整意见（调整名单及调整原因），并经公司批准。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
银河证券	58,074,940.30	99.57%	1,333,100,000.00	78.83%	-	-
国金证券	249,260.05	0.43%	358,000,000.00	21.17%	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

本报告期内本基金未发生其他重大事件。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2020/1/1-2020/6/11	42,329,502.05	-	-	42,329,502.05	18.46%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准西部利得新盈灵活配置混合型证券投资基金设立的相关文件；
- (2) 《西部利得新盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《西部利得新盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《西部利得新盈灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- (5) 基金管理人《基金管理资格证书》及《企业法人营业执照》；
- (6) 报告期内西部利得新盈灵活配置混合型证券投资基金公告的各项原稿。

12.2 存放地点

本基金管理人处——上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 11 楼

12.3 查阅方式

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

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

西部利得基金管理有限公司

2020 年 8 月 31 日