

# 西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金

## 招募说明书（更新）摘要

（2017年第二期）

### （摘要）

西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会2016年8月15日证监许可【2016】1835号文准予注册。本基金的基金合同于2016年11月17日正式生效。

#### 【重要提示】

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册，但中国证监会对本基金募集申请的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人根据所持有份额享受基金的收益，但同时也要承担相应的投资风险。投资有风险，投资人在投资本基金前，请认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦承担基金投资中出现的各类风险。基金投资中的风险包括：市场风险、管理风险、技术风险、合规风险等，也包括本基金的特定风险等。

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。

投资有风险，投资人认购（申购）基金时应认真阅读本基金的招募说明书及基金合同。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

本次招募说明书的更新内容中与托管相关的信息已经本基金托管人复核。所载内容截止日为2017年11月17日，投资组合报告为2017年三季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为2017年9月30日（财务数据未经审计）。

## 第一部分 基金管理人

### 一、公司概况

名称：西部利得基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 11 层 02、03 单元

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 11 层 02、03 单元

法定代表人：徐剑钧

成立时间：2010 年 7 月 20 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监许可 [2010]864 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：叁亿伍仟万元

存续期限：持续经营

联系人：陈眉媚

联系电话：（021）38572888

股权结构：

股东	出资额（元）	出资比例
西部证券股份有限公司	178,500,000	51%
利得科技有限公司	171,500,000	49%
合计	350,000,000	100%

### 二、主要人员情况

#### 1、董事会成员

徐剑钧先生：董事长

徐剑钧先生，董事长，博士研究生，高级经济师。毕业于陕西师范大学、复旦大学及西安西北大学，分别获理学硕士（基础数学）和经济学博士学位。曾在英国爱丁堡大学从事资本市场研究工作，22 年证券从业经历。1995 年 3 月起任陕西省

证监局市场部负责人。1995年10月起任陕西证券有限公司总经理助理。2001年起任西部证券股份有限公司副总经理。历任公司督察长，2016年9月起任公司董事长。

贺燕萍女士：董事

贺燕萍女士，董事，硕士研究生，高级经济师。毕业于中国社会科学院研究生院，获经济学硕士学位，19年证券从业经历。1990年起任北京市永安宾馆业务主管。1998年起任华夏证券股份有限公司研究所客户部经理。2006年起任中信建投证券股份有限公司机构销售部总经理助理。2007年起在光大证券股份有限公司工作，历任销售交易部副总经理、销售交易部总经理。2013年1月起任光大证券资产管理有限公司总经理。2013年8月起任国泰基金管理有限公司副总经理。自2015年11月起任公司总经理。

刘建武先生：董事

刘建武先生，董事，博士研究生，高级经济师。毕业于西安西北大学，获经济学管理学博士学位。1991年起在陕西省计划委员会经济研究所工作。1993年起在西安市人民政府办公厅工作，历任财贸、金融、经济管理副处级秘书，科技文教管理处处长。2001年起任西安高新管委会管理办副主任及西安高科集团公司副总经理。2002年起任西安市投资服务中心投资管理副主任。2003年起任陕西省投资集团公司金融证券管理部门经理。2005年10月任西部证券股份有限公司董事长、党委书记。目前兼任陕西能源集团有限公司董事、中国证券业协会理事、陕西证券期货业协会会长。

李兴春先生：董事

李兴春先生，董事，博士。毕业于南京大学，获管理科学与工程博士学位。曾任携程旅行网高级总监，富友证券有限责任公司副总裁，泛亚信托投资有限公司执行副总裁，西部发展控股有限公司董事、总裁，利得科技有限公司执行董事，现任利得科技有限公司董事长兼总经理。

陈伟忠先生：独立董事

陈伟忠，教授，独立董事，博士研究生。毕业于西安交通大学，获管理学博士学位。长期从事金融研究及管理工作。1984年起历任西安交通大学教研室主任、

系主任、博导，同济大学经管学院现代金融研究所所长。现担任同济大学经济金融系主任、同济大学上海期货研究院院长、应用经济学学术委员会主任、中国金融学会金融工程分会理事、上海金融学会常务理事。

沈宏山先生：独立董事

沈宏山先生：独立董事。毕业于北京大学法学院，获法学硕士学位。曾任君安证券、国泰君安证券法律事务部、人力资源部、收购兼并部门业务董事，方正证券法律事务部总经理等职务。爱建证券有限公司、上海辰光医疗股份有限公司独立董事，安信证券内核委员。现任德恒上海律师事务所主任，高级合伙人。

严荣荣女士：独立董事

严荣荣，独立董事，硕士研究生。毕业于西北政法学院、美国纽约大学法学院。曾任 Gless Lutz & Partner 律师事务所律师。现任君合律师事务所合伙人。中华全国律师协会会员和上海市律师协会会员。

## 2、监事会成员

王光辉先生：监事会主席

王光辉先生，监事会主席。毕业于中南财经政法大学工商管理专业，研究生学历。曾任陆家嘴国际信托公司济南业务部总经理，兴业银行济南分行同业部总经理，万家共赢资产管理有限公司副总经理。现任利得科技有限公司副总裁。

何方先生：监事

何方先生，监事。毕业于上海财经大学，硕士研究生学历。曾任汉唐证券资产管理部研究员、西部证券投资管理总部投资经理、西部证券投资管理总部副总经理、西部证券投资管理总部总经理、西部证券总经理助理兼上海第一分公司总经理。现任西部证券副总经理，代为履行西部证券总经理职务。

杨超先生：监事

杨超先生，监事，硕士学历。先后毕业于上海同济大学信息工程专业，获学士学位；上海交通大学软件工程专业，获硕士学位。曾任汇添富基金高级 IT 经理、中银国际证券信息技术部经理、华夏证券软件开发工程师。现任公司总经理助理。

谢娟女士：监事

谢娟女士，监事。毕业于四川大学行政管理专业，获硕士学位。曾任中国银行重庆市分行助理风险经理、南洋商业银行总行风险主任。现任公司风险管理部副总经理（主持工作）。

### 3、公司高级管理人员

徐剑钧先生：董事长

徐剑钧先生，董事长，博士研究生，高级经济师。毕业于陕西师范大学、复旦大学及西安西北大学，分别获理学硕士（基础数学）和经济学博士学位。曾在英国爱丁堡大学从事资本市场研究工作，22年证券从业经历。1995年3月起任陕西省证监局市场部负责人。1995年10月起任陕西证券有限公司总经理助理。2001年起任西部证券股份有限公司副总经理。历任公司督察长，2016年9月起任公司董事长。

贺燕萍女士：总经理

贺燕萍女士，总经理，硕士研究生，高级经济师。毕业于中国社会科学院研究生院，获经济学硕士学位，19年证券从业经历。1990年起任北京市永安宾馆业务主管。1998年起任华夏证券股份有限公司研究所客户部经理。2006年起任中信建投证券股份有限公司机构销售部总经理助理。2007年起在光大证券股份有限公司工作，历任销售交易部副总经理、销售交易部总经理。2013年1月起任光大证券资产管理有限公司总经理。2013年8月起任国泰基金管理有限公司副总经理。自2015年11月起任公司总经理。

赵毅先生：督察长

赵毅先生，督察长，硕士研究生，毕业于加拿大卡尔加里大学工商管理硕士专业，21年证券从业经历。1988年起任北京大学社会科学处职员。1993年起任北京市波姆红外技术公司总经理助理。1996年起任华夏证券有限责任公司高级投资经理。2007年起在华夏基金管理有限公司工作，历任股票分析师、风险管理部总经理助理。历任公司风险管理部总经理，自2016年9月起任公司督察长。

### 4、本基金基金经理

刘荟女士，基金经理，硕士毕业于辽宁大学应用数学专业。9年证券从业年限。曾任群益证券股份有限公司研究员。自2014年1月起在我公司担任研究员，现任公募投资部副总经理。自2016年1月起担任西部利得策略优选混合型证券投资基金的基金经理，2016年8月至2017年10月担任西部利得景瑞灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自2016年11月起担任西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自2017年1月起担任西部利得个股精选股票型证券投资基金的基金经理，自2017年3月起担任西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自2017年7月起担任西部利得祥盈债券型证券投资基金的基金经理。

韩丽楠女士，基金经理，硕士研究生，毕业于英国约克大学经济与金融专业，获理学硕士学位。12年证券从业年限。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月加入西部利得基金管理有限公司，曾任基金经理助理。自2015年8月起担任西部利得成长精选灵活配置混合型证券投资基金、西部利得多策略优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自2016年2月起担任西部利得新盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自2016年3月起担任西部利得行业主题优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自2016年6月起担任西部利得稳健双利债券型证券投资基金的基金经理，2016年8月至2017年10月担任西部利得合享债券型证券投资基金的基金经理，2016年9月至2017年10月担任西部利得合赢债券型证券投资基金的基金经理，自2016年12月起担任西部利得天添金货币市场基金、西部利得祥运灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自2017年2月起担任西部利得汇逸债券型证券投资基金、西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自2017年3月起担任西部利得汇享债券型证券投资基金的基金经理，自2017年8月起担任西部利得天添益货币市场基金的基金经理。

林静女士，基金经理，硕士毕业于上海财经大学金融学专业。10年证券从业年限。曾任东方证券研究所研究员、国联安基金管理有限公司高级研究员。2016年11月加入西部利得基金管理有限公司。2017年3月起任西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金、西部利得祥运灵活配置混合型证券投资基金、西部利得稳

健双利债券型证券投资基金基金经理，自 2017 年 6 月起担任西部利得新富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

#### 5、基金投资决策委员会成员

本基金采取集体投资决策制度。

投资决策委员会由下述委员组成：

投资决策委员会主任委员，吴江先生，总经理助理、投资总监，硕士毕业于复旦大学财政学专业。11 年证券从业年限。曾任兴业银行资金营运中心交易员、农银汇理基金管理有限公司基金经理、固定收益部副总经理。2016 年 8 月加入本公司，现任总经理助理、投资总监，自 2017 年 3 月起担任西部利得天添富货币市场基金的基金经理，自 2017 年 4 月起担任西部利得汇享债券型证券投资基金的基金经理。

投资决策委员会副主任委员，刘荟女士，投资部副总经理，硕士毕业于辽宁大学应用数学专业。9 年证券从业年限。曾任群益证券股份有限公司研究员。自 2014 年 1 月起在我公司担任研究员，现任投资部副总经理。自 2016 年 1 月起担任西部利得策略优选混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 8 月至 2017 年 10 月担任西部利得景瑞灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自 2016 年 11 月起担任西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自 2017 年 1 月起担任西部利得个股精选股票型证券投资基金的基金经理，自 2017 年 3 月担任西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自 2017 年 7 月起担任西部利得祥盈债券型证券投资基金的基金经理。

投资决策委员会委员，周平先生，总经理助理兼机构三部总经理兼联席投资总监，硕士毕业于复旦大学国际政治专业。11 年证券从业年限。曾任普华永道中天会计师事务所审计师、中信资本资产管理有限公司分析师、国联安基金管理有限公司研究员/基金经理。2015 年 6 月加入本公司，现任总经理助理兼机构三部总经理兼联席投资总监。

投资决策委员会委员，韩丽楠女士，基金经理，硕士研究生，毕业于英国约克大学经济与金融专业，获理学硕士学位。12 年证券从业年限。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月加入西部利得基金管理有限公司，曾任基金经理助理。自2015年8月起担任西部利得成长精选灵活配置混合型证券投资基金、西部利得多策略优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自2016年2月起担任西部利得新盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自2016年3月起担任西部利得行业主题优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自2016年6月起担任西部利得稳健双利债券型证券投资基金的基金经理，2016年8月至2017年10月担任西部利得合享债券型证券投资基金的基金经理，2016年9月至2017年10月担任西部利得合赢债券型证券投资基金的基金经理，自2016年12月起担任西部利得天添金货币市场基金、西部利得祥运灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自2017年2月起担任西部利得汇逸债券型证券投资基金、西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自2017年3月起担任西部利得汇享债券型证券投资基金的基金经理，自2017年8月起担任西部利得天添益货币市场基金的基金经理。

投资决策委员会委员，陈保国先生，研究部副总经理，硕士毕业于上海理工大学系统理论专业，获理学硕士学位。7年证券从业年限。曾任西藏同信证券有限公司研究员、上海嘉华投资有限公司研究员。2016年1月加入我公司，现任研究部副总经理。

投资决策委员会委员，盛丰衍先生，基金经理，硕士毕业于复旦大学计算机应用技术专业。4年证券从业年限。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，自2016年11月起担任西部利得中证500等权重指数分级证券投资基金的基金经理。

投资决策委员会委员，刘心峰先生，基金经理，硕士毕业于英国曼彻斯特大学数量金融专业。4年证券从业年限。曾任中德安联人寿保险有限公司交易员、华泰柏瑞基金管理有限公司交易员。2016年11月加入本公司，曾任基金经理助理。自2017年2月起担任西部利得天添鑫货币市场基金、西部利得天添富货币市场基金、西部利得合享债券型证券投资基金的基金经理，自2017年8月起担任西部利得天添益货币市场基金的基金经理。

投资决策委员会委员，冷文鹏先生，基金经理，硕士毕业于中国人民银行研究生部金融学专业。12年证券从业年限。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，自2016年6月起担任西部利得新动向灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自2017年2月起担任西部利得个股精选股票型证券投资基金的基金经理，自2017年4月起担任西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

投资决策委员会委员，朱朝华先生，基金经理，硕士毕业于法国高等商业管理学院工商管理硕士专业。12年证券从业年限。曾任广东省高速公路公司项目经理助理、百德能证券有限公司上海代表处研究员、荷兰银行港汇支行理财经理、安信资产管理有限公司研究分析经理、上海日升昌行股权投资基金管理有限公司研究副总监、前海投资控股有限公司投资经理、北大方正人寿保险有限公司投资经理。2016年8月加入本公司，自2016年9月起担任西部利得景瑞灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

投资决策委员会委员，严志勇先生，基金经理，硕士毕业于复旦大学数量经济专业。6年证券从业年限。曾任上海强生有限公司管理培训生、中国国际金融股份有限公司研究员、中证指数有限公司研究员、兴业证券股份有限公司研究员、鑫元基金管理有限公司债券研究主管。2017年5月加入本公司，自2017年8月起担任西部利得汇享债券型证券投资基金、西部利得祥盈债券型证券投资基金的基金经理。

6. 上述人员之间不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责

1. 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
2. 办理基金备案手续；
3. 对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
4. 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
6. 编制季度、半年度和年度基金报告；
7. 计算并公告基金资产及基金份额（参考）净值，确定基金份额申购、赎回价格；
8. 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
9. 按照规定召集基金份额持有人大会；
10. 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
11. 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
12. 有关法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他职责。

#### **四、基金管理人关于遵守法律法规的承诺**

1. 基金管理人将遵守《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的相关规定，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法违规行的发生。

2. 基金管理人不得从事下列行为：

- (1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产或职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 侵占、挪用基金财产；
- (6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；
- (8) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3. 基金经理承诺

(1) 依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

(2) 不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益；

(3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

## 五、基金管理人的内部控制制度

### 1. 内部控制制度概述

公司内部控制是指公司为合理地评价和控制风险，保证经营运作符合公司的发展规划，防范和化解风险，保护投资人、公司和公司股东的合法权益，在充分考虑内外部环境的基础上，通过建立组织机制、运用管理方法、实施操作程序与控制措施所形成的风险导向型的内部控制系统。

#### (1) 内部控制的原则

1) 健全性原则：内部控制须覆盖公司的各项业务、各个部门或机构和各级岗位，并渗透到各项业务过程，涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节；

2) 有效性原则：通过科学的内控手段和方法，建立合理适用的内控程序，并适时调整和不断完善，维护内控制度的有效执行；

3) 独立性原则：公司各机构、部门和岗位的职责应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离；

4) 防火墙原则：公司管理的基金资产、自有资产以及其他资产的运作应当分离，基金投资研究、决策、执行、清算、评估等部门和岗位，应当在物理上和制度上适当隔离，以达到风险防范的目的；

5) 相互制约原则：公司组织机构、内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡；

6) 成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

#### (2) 内部控制的制度系统

公司内部控制制度系统包括四个层次：第一个层次是国家有关法律法规和公司章程；第二个层次是包括内部控制大纲在内的基本管理制度；第三个层次是部门管

理制度；第四个层次是各项具体业务规则。

1) 国家有关法律法规是公司一切制度的最高准则，公司章程是公司管理制度的基本原则，公司章程、董事会及其下属的专门委员会的管理规定是制订各项制度的基础和前提；

2) 内部控制大纲是依据国家相关法律法规、监管机构的有关规定以及公司章程规定的内控原则而确定的方针和策略，是内部控制纲领性文件，对制订各项基本管理制度和部门业务规章起着指导性的作用。公司内部控制是公司为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理办法、操作程序与控制措施的总称；

3) 公司基本管理制度包括了以下内容：内部控制大纲、风险控制制度、投资管理制度、监察稽核制度、基金会计制度、信息披露制度、信息技术管理制度、紧急应变制度、公司财务管理制度、人力资源管理制度和资料档案管理制度等；

4) 部门管理制度是根据公司章程和内控大纲等文件的要求，在基本管理制度的基础上，对各部门内部管理的具体说明，包括主要职责、岗位设置、岗位责任及操作规程等；

5) 各项具体业务规则是针对公司的某项具体业务，对该业务的操作要求、流程、授权等作出的详细完整的规定。

### (3) 内部控制的要素

公司内部控制的要素主要包括：控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通及内部监控。

#### 1) 控制环境

公司设立董事会，向股东会负责。董事会由 7 名董事组成，其中独立董事 3 名。董事会下设合规审核委员会、资格审查委员会及薪酬与考核委员会等各专门委员会。董事会是股东会的执行机构，依照法律法规及公司章程的规定贯彻执行股东会的决议，行使决定公司经营和投资方案等重大职权。公司设立监事会，向股东会负责，依照《公司法》和公司章程对公司经营管理活动、董事和公司管理层的经营管理行为进行监督。公司的日常经营管理工作在总经理的领导下运行，总经理直接对董事会负责。

公司设立督察长，对董事会负责，负责监督检查基金和公司运作的合法合规情

况及公司内部风险控制情况，行使法律法规及公司章程规定的职权。

## 2) 风险评估

A、董事会下属的合规审核委员会对公司制度的合规性和有效性进行评估，并对公司与基金运作的合法合规性进行监督检查，以协助董事会确定风险管理目标，提出风险防范措施的建议，建立并有效维持公司内部控制系统，确保公司规范健康发展；

B、公司经营层下设风险控制委员会，向总经理负责，负责对基金投资风险控制及公司运作风险控制的有效性进行分析和评估，评估公司面临的风险事项将导致公司在承担法律责任、社会和公众责任、经济损失或是在以上三个领域的任何组合损失，以及对商业机会、运营基础以及法律责任等方面的影响，具体包括负责审核公司的风险控制制度和风险管理流程，识别、监控与管理公司整体风险；

C、公司经营层下设投资决策委员会，负责对公司的基金产品及各投资品种的市场风险、流动性风险、信用风险等进行风险分析和评估，采用风险量化技术和风险限额控制等方法把控基金投资整体风险；

D、各业务部门是公司内部控制的具体实施单位，负责对职责范围内的业务所面临的风险进行识别和评估。各业务部门在公司基本管理制度的基础上，根据具体情况制订本部门的业务管理规定、操作流程及内部控制规定，对业务风险进行控制。部门管理层定期对部门内风险进行评估，确定风险管理措施并实施，监控风险管理绩效，以不断改进风险管理能力。

## 3) 控制活动

公司根据自身经营的特点，从组织结构、操作流程及报告制度等多种管理方式入手，设立顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线：

A、各岗位职责明确，有详细的岗位说明书和业务流程，各岗位人员在上岗前均应知悉并以书面方式承诺遵守，在授权范围内承担责任；

B、建立重要业务处理凭据传递和信息沟通机制，相关部门和岗位之间相互监督制衡；

C、公司督察长和内部监察稽核部门独立于其他部门，对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈。

#### 4) 信息与沟通

公司采用适当、有效的信息系统，识别、采集、加工并相互交流经营活动所需的一切信息。信息系统须保证业务经营信息和财务会计资料的真实性、准确性和完整性，必须能实现公司内部信息的沟通和共享，促进公司内部管理顺畅实施。公司根据组织架构和授权制度，建立清晰的业务报告系统，保障信息的及时、准确的传递，并且维护渠道的畅通。

#### 5) 内部监控

公司内部控制的监督系统由监事会、督察长和监察稽核部等组成，监督系统通过其监督职能的行使确保公司决策系统和执行系统合法、合规、高效地运作。根据市场环境、新的金融工具、新的技术应用和新的法律法规等情况，公司组织专门部门对原有的内部控制进行全面的自查，审查其合法合规性、合理性和有效性，适时改进。

##### (4) 内部控制的检测

内部控制检测的过程包括如下：

- 1) 内控制度设计检测；
- 2) 内部控制执行情况测试；
- 3) 将测试结果与内控目标进行比较；
- 4) 形成测试报告，得出继续运行或纠偏的结论。

##### (5) 风险控制体系

公司风险控制体系包括以下三个层次：

- 1) 第一层次为公司各业务相关部门对各自部门的风险控制负责；
- 2) 第二层次为总经理、风险控制委员会及监察稽核部；
- 3) 第三层次为董事会、合规审核委员会及督察长；

4) 为了有效地控制公司内部风险，公司各业务部门建立第一道监控防线。独立的监察稽核部，对各业务部门的各项业务全面实行监督反馈，必要时对有关部门进行不定期突击检查。同时，监察稽核部对于日常操作中发现的或认为具有潜在可能的问题出具监察稽核报告向风险控制委员会和总经理报告，形成第二道监控防线。督察长在工作上向中国证监会和董事会负责，并将检查结果汇报合规审核委

员会和董事会，形成第三道监控防线。

### 3. 基金管理人关于内部控制的声明

(1) 本基金管理人知晓建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任；

(2) 上述关于内部控制的披露真实、准确；

(3) 本公司承诺将根据市场环境变化及公司发展不断完善内部控制制度。

## 第二部分 基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：平安银行股份有限公司

住所：广东省深圳市罗湖区深南东路5047号

办公地址：广东省深圳市罗湖区深南东路5047号

法定代表人：谢永林

成立日期：1987年12月22日

组织形式：股份有限公司

注册资本：17,170,411,366元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监许可[2008]1037号

联系人：高希泉

联系电话：(0755) 2219 7701

平安银行股份有限公司是一家总部设在深圳的全国性股份制商业银行（深圳证券交易所简称：平安银行，证券代码 000001）。其前身是深圳发展银行股份有限公司，于 2012 年 6 月吸收合并原平安银行并于同年 7 月更名为平安银行。中国平安保险（集团）股份有限公司及其子公司合计持有平安银行 58% 的股份，为平安银行的控股股东。截至 2017 年 6 月末，在职员工 31721 人，通过全国 64 家分行、1081 家营业机构为客户提供多种金融服务。

截至 2017 年上半年，平安银行收入、利润、规模保持稳健发展。营业收入 540.73 亿元、准备前营业利润 401.84 亿元（同比增长 11.14%）、净利润 125.54 亿元（同比增长 2.13%）、资产总额 30,921.42 亿元（较上年末增长 4.70%）、吸收存款余额 19,123.33 亿元、发放贷款和垫款总额（含贴现）15,942.81 亿元（较上年末增幅 8.03%）。

平安银行总行设资产托管事业部，下设市场拓展处、创新发展处、估值核算处、资金清算处、规划发展处、IT系统支持处、督察合规处、基金服务中心8个处室，目前部门人员为60人。

## 2、主要人员情况

陈正涛,男,中共党员,经济学硕士、高级经济师、高级理财规划师、国际注册私人银行家,具备《中国证券业执业证书》。长期从事商业银行工作,具有本外币资金清算,银行经营管理及基金托管业务的经营管理经验。1985年7月至1993年2月在武汉金融高等专科学校任教;1993年3月至1993年7月在招商银行武汉分行任客户经理;1993年8月至1999年2月在招行武汉分行武昌支行任计划信贷部经理、行长助理;1999年3月—2000年1月在招行武汉分行青山支行任行长助理;2000年2月至2001年7月在招行武汉分行公司银行部任副总经理;2001年8月至2003年2月在招行武汉分行解放公园支行任行长;2003年3月至2005年4月在招行武汉分行机构业务部任总经理;2005年5月至2007年6月在招行武汉分行硚口支行任行长;2007年7月至2008年1月在招行武汉分行同业银行部任总经理;自2008年2月加盟平安银行先后任公司业务部总经理助理、产品及交易银行部副总经理,一直负责公司银行产品开发与管理,全面掌握银行产品包括托管业务产品的运作、营销和管理,尤其是对商业银行有关的各项监管政策比较熟悉。2011年12月任平安银行资产托管部副总经理;2013年5月起任平安银行资产托管事业部副总裁(主持工作);2015年3月5日起任平安银行资产托管事业部总裁。

## 3、基金托管业务经营情况

2008年8月15日获得中国证监会、银监会核准开办证券投资基金托管业务。

截至2017年6月底,平安银行股份有限公司托管净值规模合计5.68万亿,托管证券投资基金共105只,具体包括华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富量子生命力股票型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、招商保证金快线货币市场基金、平安大华日增利货币市场基金、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金、平安大华财富宝货币市场基金、红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华活期添利货币市场证券投资基金、民生加银优选股票型证券投资基金、新华阿鑫一号保本混合型

证券投资基金、新华增盈回报债券型证券投资基金、鹏华安盈宝货币市场基金、平安大华新鑫先锋混合型证券投资基金、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金、中海进取收益灵活配置混合型证券投资基金、东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金、平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金、国金通用鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、嘉合磐石混合型证券投资基金、平安大华鑫享混合型证券投资基金、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金、新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金、鹏华弘安灵活配置混合型证券投资基金、博时裕泰纯债债券型证券投资基金、德邦增利货币市场基金、中海顺鑫保本混合型证券投资基金、民生加银新收益债券型证券投资基金、东方红睿轩沪港深灵活配置混合型证券投资基金、浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金、广发安泽回报纯债债券型证券投资基金、博时裕景纯债债券型证券投资基金、平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金、长城久源保本混合型证券投资基金、平安大华安盈保本混合型证券投资基金、嘉实稳丰债券型证券投资基金、嘉实稳盛债券型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、华润元大现金通货币市场基金、平安大华鼎信定期开放债券型证券投资基金、平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金、南方荣欢定期开放混合型发起式证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、中海合嘉增强收益债券型证券投资基金、鹏华丰安债券型证券投资基金、富兰克林国海新活力灵活配置混合型证券投资基金、南方颐元债券型发起式证券投资基金、鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金、鹏华兴安定期开放灵活配置混合型证券投资基金、西部利得天添利货币市场基金、鹏华弘腾灵活配置混合型证券投资基金、博时安祺一年定期开放债券型证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、广发鑫源灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠享纯债债券型证券投资基金、广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠融纯债债券型证券投资基金、广发沪港深新起点股票型证券投资基金、平安大华惠金定期开放债券型证券投资基金、平安大华量化成长多策略灵活配置混合型证券投资基金、博时丰达纯债6个月定期开放债券型发起式证券投资基金、英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金、西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金、天弘安盈灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠利纯债债券型证券投资基金、广发鑫盛18个月定期开放混合型证券投资基

金、长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金、鹏华丰盈债券型证券投资基金、平安大华惠隆纯债债券型证券投资基金、广发新常态灵活配置混合型证券投资基金、平安大华管家货币市场基金、平安大华鑫利定期开放灵活配置混合型证券投资基金、博时泰安债券型证券投资基金、新华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金、国联安睿智定期开放混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、广发汇平一年定期开放债券型证券投资基金、华安新安平灵活配置混合型证券投资基金、平安大华量化灵活配置混合型证券投资基金、平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、前海开源聚财宝货币市场基金、招商招弘纯债债券型证券投资基金、招商稳阳定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金、前海开源沪港深隆鑫灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠益纯债债券型证券投资基金、金鹰添荣纯债债券型证券投资基金、西部利得汇享债券型证券投资基金、鹏华丰玉债券型证券投资基金、华安睿安定期开放混合型证券投资基金、西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金、广发汇安18个月定期开放债券型证券投资基金、上投摩根岁岁金定期开放债券型证券投资基金、平安大华转型创新灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫丰灵活配置混合型证券投资基金、天弘天盈灵活配置混合型证券投资基金、南方和元债券型证券投资基金、长盛盛通纯债债券型证券投资基金、平安大华添益债券型证券投资基金、平安大华惠元纯债债券型证券投资基金、中金丰沃灵活配置混合型证券投资基金、兴银消费新趋势灵活配置混合型证券投资基金、南方高元债券型发起式证券投资基金、易方达瑞智灵活配置混合型证券投资基金。

## 二、基金托管人的内部风险控制制度说明

### 1、内部控制目标

作为基金托管人，平安银行股份有限公司严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管要求，自觉形成守法经营、规范运作的经营理念和经营风格；确保基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益；确保内部控制和风险管理体系的有效性；防范和化解经营风险，确保业务的安全、稳健运行，促进经营目标的实现。

### 2、内部控制组织结构

平安银行股份有限公司设有总行独立一级部门资产托管事业部，是全行资产托管业务的管理和运营部门，专门配备了专职内部监察稽核人员负责托管业务的内部控制和风险管理，具有独立行使监督稽核工作的职权和能力。

### 3、内部控制制度及措施

资产托管事业部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；取得基金从业资格的人员符合监管要求；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### 1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用行业普遍使用的“资产托管业务系统——监控子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

### 2、监督流程

(1) 每工作日按时通过监控子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

(2) 收到基金管理人的投资指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

(3) 根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

(4) 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

## 第三部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、直销机构

名称：西部利得基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 11 层 02、03 单元

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 11 层 02、03 单元

法定代表人：徐剑钧

联系人：陈眉媚

联系电话：（021）38572888

网址：[www.westleadfund.com](http://www.westleadfund.com)

#### 2、代销机构

##### 1) 光大证券股份有限公司

地址：上海市新闸路 1508 号

法定代表人：薛峰

联系人：刘晨

客服热线：95525、400-8888-788

网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

##### 2) 上海联泰资产管理有限公司

地址：上海市长宁区金钟路 658 弄 2 号楼 B 座 6 楼

法定代表人：燕斌

联系人：陈东

电话：021-52822063

公司网址：[www.91fund.com.cn](http://www.91fund.com.cn)

##### 3) 中国银河证券股份有限公司

地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈共炎

联系人：田薇

客服热线：400-888-8888

网址：www.chinastock.com.cn

4) 平安证券有限责任公司

地址：深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 号

法定代表人：谢永林

联系人：石静武

客服热线：95511-820

网址：http://stock.pingan.com

5) 上海天天基金销售有限公司

地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

法定代表人：其实

联系人：朱钰

客服热线：400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

6) 上海陆金所资产管理有限公司

地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

客服热线：400-821-9031

网址：www.lufunds.com

7) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

客服热线：400-089-1289

网址：www.erichfund.com

8) 北京钱景财富投资管理有限公司

地址：北京市海淀区丹棱街丹棱 SOHO10 层

法定代表人：赵荣春

联系人：盛海娟

客服热线：400-893-6885

网址：www.qianjing.com

9) 国金证券股份有限公司

地址：上海市浦东新区芳甸路 1088 号紫竹国际大厦

法定代表人：冉云

客服热线：95310

网址：www.gjzq.com.cn

10) 浙江同花顺基金销售有限公司

公司地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼21

法定代表人：凌顺平

联系人：杨翼

客服热线：4008-773-772

网址：www.5ifund.com

11) 北京汇成基金销售有限公司

公司地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号

法定代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

客服热线：400-619-9059

网址：www.fundzone.cn

12) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

联系人：张裕

客服热线：400-0766-123

网址：www.fund123.cn

13) 中泰证券股份有限公司

地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

客服热线：95538

网址：www.zts.com.cn

14) 上海利得基金销售有限公司

地址：上海市浦东新区峨山路 91 弄 61 号 1 幢 12 层（陆家嘴软件园 10 号楼）

法定代表人：沈继伟

客服热线：400-033-7933

网址：www.leadbank.com.cn

15) 西部证券股份有限公司

地址：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

法定代表人：刘建武

联系人：冯萍

客服热线：95582

网址：www.westsecu.com

16) 东海证券股份有限公司

地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：刘化军

联系人：王一彦

客服热线：95531；400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

17) 泛华普益基金销售有限公司

地址：四川省成都市锦江区东大街 99 号平安金融中心 1501

法定代表人：于海锋

联系人：陈金红

客服热线：400-8878-566

网址：www.pyfund.cn

18) 申万宏源证券有限公司

地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

法定代表人：李梅

客服热线：95523、400-889-5523

网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

19) 申万宏源西部证券有限公司

地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

法定代表人：许建平

客服电话：400-800-0562

网址：[www.hysec.com](http://www.hysec.com)

20) 中信建投证券股份有限公司

地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：魏明

客服热线：400-8888-108

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

21) 招商证券股份有限公司

地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层

客服电话：95565

网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

22) 京东金融-北京肯特瑞财富投资管理有限公司

公司地址：北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部

法定代表人：陈超

联系人：赵德赛

客服热线：95118

网址：<http://fund.jd.com>

23) 上海华信证券有限责任公司

公司地址：上海市黄浦区南京西路 399 号明天广场 18-23 层

法定代表人：郭林

联系人：李颖

客服热线：4008205999

网址：www.shhxzq.com

24) 平安银行股份有限公司

公司地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

法定代表人：孙建一

联系人：鲁承文

客服热线：95511-3

网址：http://bank.pingan.com

25) 大泰金石基金销售有限公司

地址：南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

法定代表人：袁顾明

联系人：朱海涛

客服热线：4009282266

网址：www.dtfunds.com

26) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

法定代表人：张彦

联系人：文雯

客服电话：4001661188

网址：http://www.new-rand.cn

27) 上海万得投资顾问有限公司

地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

法定代表人：王廷富

联系人：徐亚丹

客服电话：400-821-0203

网址：www.520fund.com.cn

28) 奕丰金融服务（深圳）有限公司

地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

法定代表人：TAN YIK KUAN

联系人：叶健

客服电话：400-684-0500

网址：[www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

29) 长城证券股份有限公司

地址：深圳市福田区深南大道 6008 号报业大厦 14 楼、16 楼、17 楼

法定代表人：何伟

联系人：金夏

客服热线：400-6666-888

网址：<http://www.cgws.com>

30) 上海好买基金销售有限公司

地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：王诗琦

客服热线：400-700-9665

网址：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

31) 泰诚财富基金销售（大连）有限公司

地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

法定代表人：林卓

联系人：姜焕洋

客服热线：0411-88891212

网址：<http://www.taichengcaifu.com>

32) 武汉市伯嘉基金销售有限公司

地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第七幢 23 层 1 号 4 号

法定代表人：陶捷

联系人：徐博

客服热线：400-027-9899

网址：[www.buyfunds.cn](http://www.buyfunds.cn)

33) 天津万家财富资产管理有限公司

地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 5 层

法定代表人：李修辞

联系人：邵玉磊

客服热线：010-59013825

网址：<http://www.wanjiawealth.com/>

34) 北京晟视天下投资管理有限公司

地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

法定代表人：蒋煜

联系人：殷雯

客服热线：400-818-8866

网址：[www.shengshiview.com](http://www.shengshiview.com)

35) 海银基金

地址：上海市浦东新区银城中路 8 号 4 楼

法定代表人：刘惠

联系人：毛林

客服热线：400-808-1016

网址：[www.fundhaiyin.com](http://www.fundhaiyin.com)

36) 成都华弈恒信财富投资管理有限公司

地址：成都市高新区天府大道中段 199 号棕榈泉国际中心 1 幢 1 单元 19 层  
4 号

法定代表人：赵壁

联系人：谭佳洲

客服热线：400-8010-009

网址: <http://www.huayihengxin.com>

37) 联储证券有限责任公司

地址: 广东省深圳市福田区华强北路圣廷苑酒店 B 座 26 楼

法定代表人: 沙常明

联系人: 丁倩云

客服热线: 4006206868

网址: [www.lczq.com](http://www.lczq.com)

38) 喜鹊财富基金销售有限公司

地址: 西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦 1513 室

法定代表人: 陈皓

联系人: 曹砚财、张萌

客服热线: 0891-6177483

网址: [www.xiquefund.com](http://www.xiquefund.com)

3. 基金管理人可根据有关法律法规要求, 选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述销售机构, 并及时公告。

## 二、注册登记机构

名称: 西部利得基金管理有限公司

住所: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 799 号 11 层 02、03 单元

办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 799 号 11 层 02、03 单元

法定代表人: 徐剑钧

电话: (021) 38572888

传真: (021) 38572750

联系人: 张皞骏

客户服务电话: 4007-007-818; (021) 38572666

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称: 上海源泰律师事务所

住所: 上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室

办公地址: 上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室

负责人：廖海

联系电话：（021）51150298

传真：（021）51150398

联系人：刘佳

经办律师：廖海、刘佳

#### **四、审计基金财产的会计师事务所**

名称：毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：北京市东长安街1号东方广场毕马威大楼8层

办公地址：上海市南京西路1266号恒隆广场50楼

法定代表人：邹俊

联系电话：（021）2212 2888

传真：（021）6288 1889

联系人：黄小熠

### **第四部分 基金的名称**

西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金

### **第五部分 基金的类型**

契约型开放式

### **第六部分 基金的投资目标**

本基金通过投资于促进中国经济发展方式转变的消费服务和技术创新等领域的上市公司，在严格控制风险的前提下，力求获得长期稳定的收益。

### **第七部分 基金的投资范围**

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（包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、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、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据、公开发行次级债券等）、同业存单、债券回购、货币市场工具、权证、股指期货、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。

## 第八部分 基金的投资策略

### 1、大类资产配置策略

本基金采取积极的大类资产配置策略，通过评估整个股票市场的系统性风险来调整本基金股票资产的投资比例，随着股票市场系统风险的增大而逐步降低股票资产的投资比例，随着股票市场系统风险的减少而逐步提高股票资产的投资比例，努力实现投资组合的风险收益最优化。

### 2、股票投资策略

本基金遵循行业间优势配置、各行业内优选个股相结合的股票投资策略，综合评判行业所处的状况和未来发展趋势，筛选出经济周期不同阶段的优势行业，这些优势行业具有综合性的比较优势、较高的投资价值、能够取得超越各行业平均收益率的投资收益；行业内优选个股是以若干财务指标、成长性、估值、在所属行业当中的竞争地位、企业的盈利前景及成长空间、是否具有主题型投资机会等定性定量指标为基础，筛选出经济周期与行业发展的不同阶段下，具有较高投资价值、持续成长性较好的优势个股。

#### （1）行业间优势配置策略

本基金管理人在进行行业配置时，将采用自上而下与自下而上相结合的方式，以证监会行业分类为标准，对行业配置定期进行综合评估，遴选出优势行业，并制

定以及调整行业资产配置比例。在投资组合管理过程中，基金管理人也将根据宏观经济形势以及各个行业的基本面特征对行业配置进行持续动态地调整，以把握行业景气轮动带来的投资机会。

## （2）个股筛选策略

在行业配置策略的基础上，本基金重点投资于优势行业中获益程度较高且具有核心竞争优势的上市公司。基金管理人将综合采用定量和定性相结合的方式；基于公司基本面全面考量、筛选优势企业，分析股票内在价值，结合风险管理，构建股票组合并对其进行动态调整。

### 定量分析：

成长性指标包括未来3年公司主营业务收入、毛利率及净利率增长率；累计及新增研发支出；资本支出；人员招聘情况等。

盈利能力指标包括毛利率和净利率的变动趋势；净资产回报率等。

估值水平指标包括 P/E； P/S； P/B 等。

### 定性分析：

在定量分析的基础上，基金管理人还将发挥其在股票研究方面的专业优势，综合利用卖方研究报告、实地调研和财务分析等多种手段，对进入研究范围的上市公司基本面进行深入分析，从定性的角度筛选出基本面良好、成长潜力较大的股票进行投资。

## 3、债券投资策略

本基金可投资于国债、金融债、公司债、企业债、可转换债券（含可交换债券）、央行票据、次级债、地方政府债券等债券品种，基金经理通过对收益率、流动性、信用风险和风险溢价等因素的综合评估，合理分配固定收益类证券组合中投资于国债、金融债、企业债、短期金融工具等产品的比例，构造债券组合。

在选择国债品种中，本产品将重点分析国债品种所蕴含的利率风险和流动性风险，根据利率预测模型构造最佳期限结构的国债组合；在选择金融债、企业债品种时，本基金将重点分析债券的市场风险以及发行人的资信品质。资信品质主要考察发行机构及担保机构的财务结构安全性、历史违约/担保纪录等。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，决定投资可转债的品种和比例，捕捉其套利机会。

#### 4、资产支持证券的投资策略

本基金将综合运用定性方法和定量方法，基本面分析和数量化模型相结合，对资产证券化产品的基础资产质量及未来现金流进行分析，并结合发行条款、提前偿还率、风险补偿收益等个券因素以及市场利率、流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析和价值评估后进行投资。本基金将严格遵守法律法规和基金合同的约定，严格控制资产支持证券的投资比例、信用等级并密切跟踪评级变化，采用分散投资方式以降低流动性风险，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。

#### 5、股指期货投资策略

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。

#### 6、权证投资策略

本基金将因为上市公司进行股权分置改革、或增发配售等原因被动获得权证，或者本基金在进行套利交易、避险交易等情形下将主动投资权证。本基金进行权证投资时，将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合隐含波动率、剩余期限、标的证券价格走势等参数，运用数量化期权定价模型，确定其合理内在价值，从而构建套利交易或避险交易组合，力求取得最优的风险调整收益。

## 第九部分 基金的业绩比较标准

沪深 300 指数收益率\*50%+中证全债指数收益率\*50%

沪深 300 指数是上海证券交易所和深圳证券交易所共同推出的沪深两个市场第一个统一指数，该指数编制合理、透明，有一定市场覆盖率，抗操纵性强，并且有较高的知名度和市场影响力。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。综合考虑

基金资产配置与市场指数代表性等因素，本基金选用沪深 300 指数和中证全债指数加权作为本基金的投资业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准，或者本基金的业绩比较基准停止发布时，本基金可以经基金管理人和基金托管人协商一致后变更业绩比较基准并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

## 第十部分 基金的风险收益特征

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。

## 第十一部分 基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据基金合同规定，复核了本报告中的投资组合报告内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截止 2017 年 9 月 30 日，本报告所列财务数据未经审计。

### 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	102,191,995.07	18.16
	其中：股票	102,191,995.07	18.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	371,560,300.00	66.03
	其中：债券	371,560,300.00	66.03

	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	53,000,195.00	9.42
	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	29,535,471.27	5.25
8	其他资产	6,423,013.24	1.14
9	合计	562,710,974.58	100.00

## 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

### (1) 报告期末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	4,191,740.00	0.75
C	制造业	55,729,765.83	9.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,779,507.00	0.32
E	建筑业	3,354,640.00	0.60
F	批发和零售业	1,218,475.00	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	3,563,231.00	0.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,347,832.00	0.77
J	金融业	16,308,874.30	2.90
K	房地产业	3,833,947.00	0.68
L	租赁和商务服务业	3,529,957.94	0.63
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,031,528.00	0.36
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,302,497.00	0.41
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	102,191,995.07	18.19

(2) 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

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

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	600519	贵州茅台	12,800	6,625,792.00	1.18
2	600887	伊利股份	144,800	3,982,000.00	0.71
3	000488	晨鸣纸业	130,400	2,557,144.00	0.46
4	002859	洁美科技	65,415	2,468,107.95	0.44
5	601988	中国银行	595,000	2,451,400.00	0.44
6	002185	华天科技	286,100	2,400,379.00	0.43
7	601857	中国石油	294,600	2,353,854.00	0.42
8	002310	东方园林	111,400	2,340,514.00	0.42
9	002127	南极电商	148,514	2,333,154.94	0.42
10	300015	爱尔眼科	90,900	2,302,497.00	0.42

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	8,983,300.00	1.60
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,938,000.00	3.55
	其中：政策性金融债	19,938,000.00	3.55
4	企业债券	138,142,000.00	24.59
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	204,497,000.00	36.40
9	其他	-	-
10	合计	371,560,300.00	66.14

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值 （元）	占基金资 产净值比 例（%）
1	111712178	17北京银行 CD178	300,000	29,667,000.00	5.28
2	111798 544	17唐山银 行CD100	300,000	28,575,000.00	5.09
3	112232	14长证债	200,000	20,114,000.00	3.58
4	150418	15农发18	200,000	19,938,000.00	3.55
5	122437	15远洋01	200,000	19,828,000.00	3.53

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。

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  
贵金属不在本基金投资范围内。

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。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

股指期货不在本基金投资范围内。

## 10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

国债期货不在本基金投资范围内。

## 11. 投资组合报告附注

(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。

(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。

(3) 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	183,756.56
2	应收证券清算款	343,673.42
3	应收股利	-
4	应收利息	5,895,518.26
5	应收申购款	65.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,423,013.24

(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) 报告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。

(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。

## 第十二部分 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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

1) 西部利得新动力混合 A:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	-
2016年11月17日-2016年12月31日	21.31%	2.34%	-2.65%	0.43%	23.96%	1.91%
2017年1月1日-2017年9月30日	4.19%	0.11%	7.93%	0.29%	-3.74%	-0.18%
2016年11月17日-2017年9月30日	26.39%	0.92%	5.07%	0.32%	21.32%	0.60%

2) 西部利得新动力混合 C:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	-
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	---

2016年11月 17日-2016年 12月31日	-0.39%	0.06%	-2.65%	0.43%	2.26%	-0.37%
2017年1月1 日-2017年9 月30日	4.08%	0.11%	7.93%	0.29%	-3.86%	-0.18%
2016年11月 17日-2017年 9月30日	3.67%	0.11%	5.07%	0.32%	-1.40%	-0.21%

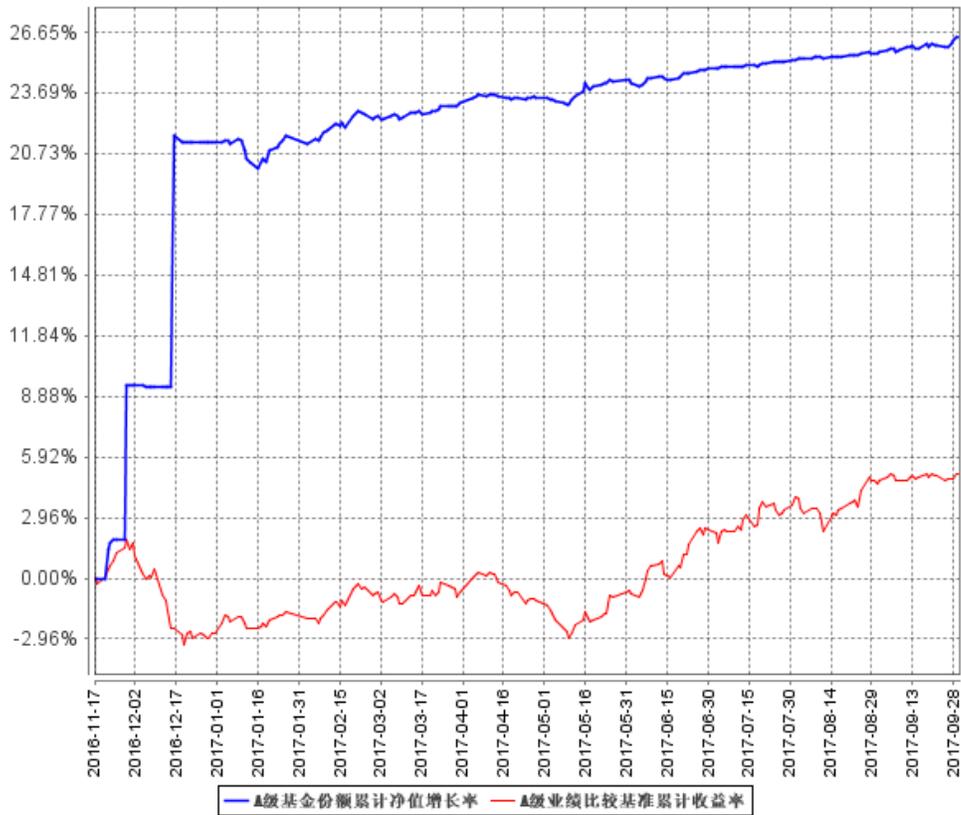
2. 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

1) 西部利得新动力混合 A:

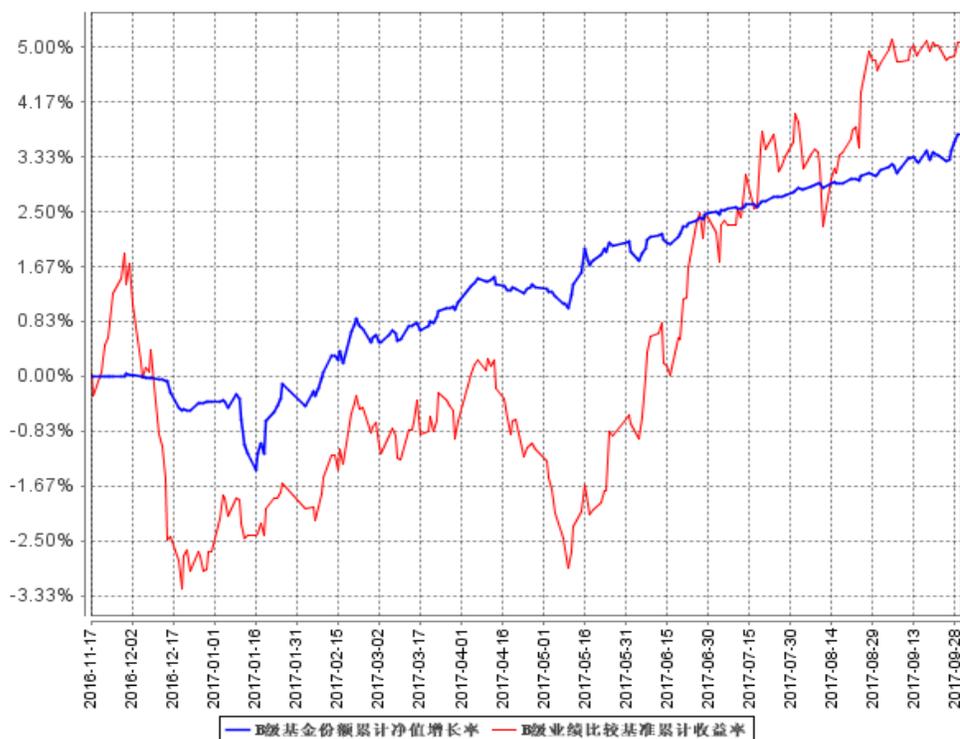
(2016年11月17日至2017年9月30日)

A级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



2) 西部利得新动力混合 C:  
(2016年11月17日至2017年9月30日)

B级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



## 第十三部分 费用概览

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、本基金从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券/期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、证券/期货账户开户费用、账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

## 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 3、C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.2%年费率计提。C 类基金份额的销售服务费计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金份额销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金

财产中一次性支取并付给基金管理人，由基金管理人代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第4—10项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### **三、不列入基金费用的项目**

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### **四、基金税收**

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

**五、在法律法规规定的范围内，基金管理人和基金托管人在履行适当程序后可协商酌情调整基金管理费、基金托管费或C类基金份额销售服务费等相关费率。基金管理人必须依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介和基金管理人网站上刊登公告。**

## 第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，对2016年11月10日公布的《西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》进行了更新，并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要更新的内容如下：

1. 根据最新资料，更新了“标题”部分。
2. 根据最新资料，更新了“重要提示”部分。
3. 根据最新资料，更新了“第三部分 基金管理人”部分。
4. 根据最新资料，更新了“第四部分 基金托管人”部分。
5. 根据最新资料，更新了“第五部分 相关服务机构”部分。
6. 根据最新资料，更新了“第六部分 基金的募集”部分。
7. 根据最新资料，更新了“第七部分 基金合同的生效”部分。
8. 根据最新资料，新增了“第九部分 与基金管理人管理的其他基金转换”部分。
9. 根据最新资料，更新了“第十一部分 基金的投资”部分。
10. 根据最新公告，新增了“第二十二部分 其他应披露事项”部分。

西部利得基金管理有限公司

二零一七年十二月二十九日