

西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资 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：平安银行股份有限公司

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。

基金托管人平安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 3 月 21 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	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、基金净值表现及利润分配情况	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
3.4 过去三年基金的利润分配情况	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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	48
8.1 期末基金资产组合情况	48
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	48
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	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	72
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	73

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	73
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	73
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	73
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	73
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	73
8.12 投资组合报告附注	74
§9 基金份额持有人信息	76
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	76
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	76
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	76
§10 开放式基金份额变动	77
§11 重大事件揭示	78
11.1 基金份额持有人大会决议	78
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	78
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	78
11.4 基金投资策略的改变	78
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	78
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	78
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	78
11.8 其他重大事件	79
§12 影响投资者决策的其他重要信息	81
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	81
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	81
§13 备查文件目录	82
13.1 备查文件目录	82
13.2 存放地点	82
13.3 查阅方式	82

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	西部利得久安回报混合
场内简称	—
基金主代码	673100
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 3 月 21 日
基金管理人	西部利得基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	7,314,005.94 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	本基金主要通过优化配置债券类资产、权益类资产，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	信用状况、债券市场和股票市场估值水平及预期收益等动态分析，决定债券类、权益类资产配置比例。 1、股票投资策略 通过持续、系统、深入的基本面研究，挖掘企业内在价值，寻找具备长期增长潜力的上市公司，本基金将在这些公司估值相对便宜的时候进行投资，与这些公司一起高速成长。 本基金将根据上市公司的行业特性及公司本身的特点，选择合适的股票估值方法。可供选择的估值方法包括市盈率法（P/E）、市净率法（P/B）、市盈率—长期成长法（PEG）、企业价值/销售收入（EV/SALES）、企业价值/息税折旧摊销前利润法（EV/EBITDA）、自由现金流贴现模型（FCFF，FCFE）或股利贴现模型（DDM）等。通过估值水平分析，基金管理人力争发掘出价值被低估的股票。 2、债券投资策略 债券类投资采取积极主动的投资策略包括确定债券组合久期、债券组合期限结构及类属配置、单个资产选择等。本基金根据对利率趋势的判断来确定基金资产的久期。在预期利率上升时，缩短基金资产的久期，

	以规避资本损失或获取更高的收益；在预期利率下降时，延长基金资产的久期，以获取资本利得或锁定较高的收益。 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。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。 3、资产支持证券的投资策略 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。 4、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。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*20%+中证全债指数收益率*80%。
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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵毅	方琦
	联系电话	021-38572888	0755-22160168
	电子邮箱	service@westleadfund.com	FANGQI275@pingan.com.cn
客户服务电话		4007-007-818;021-38572666	95511-3
传真		021-38572750	0755-82080387
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	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 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	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
邮政编码		200127	518001
法定代表人		徐剑钧	谢永林

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 3 月 21 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	40,713,876.55	-	-
本期利润	38,850,397.55	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.2269	-	-
本期加权平均净值利润率	20.65%	-	-
本期基金份额净值增长率	28.07%	-	-
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	1,131,398.68	-	-
期末可供分配基金份额利润	0.1547	-	-
期末基金资产净值	8,445,404.62	-	-
期末基金份额净值	1.1547	-	-
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	28.07%	-	-

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）。

4. 本基金合同生效日为 2017 年 3 月 21 日，截至 2017 年 12 月 31 日，基金合同生效未满一年。

3.2 基金净值表现

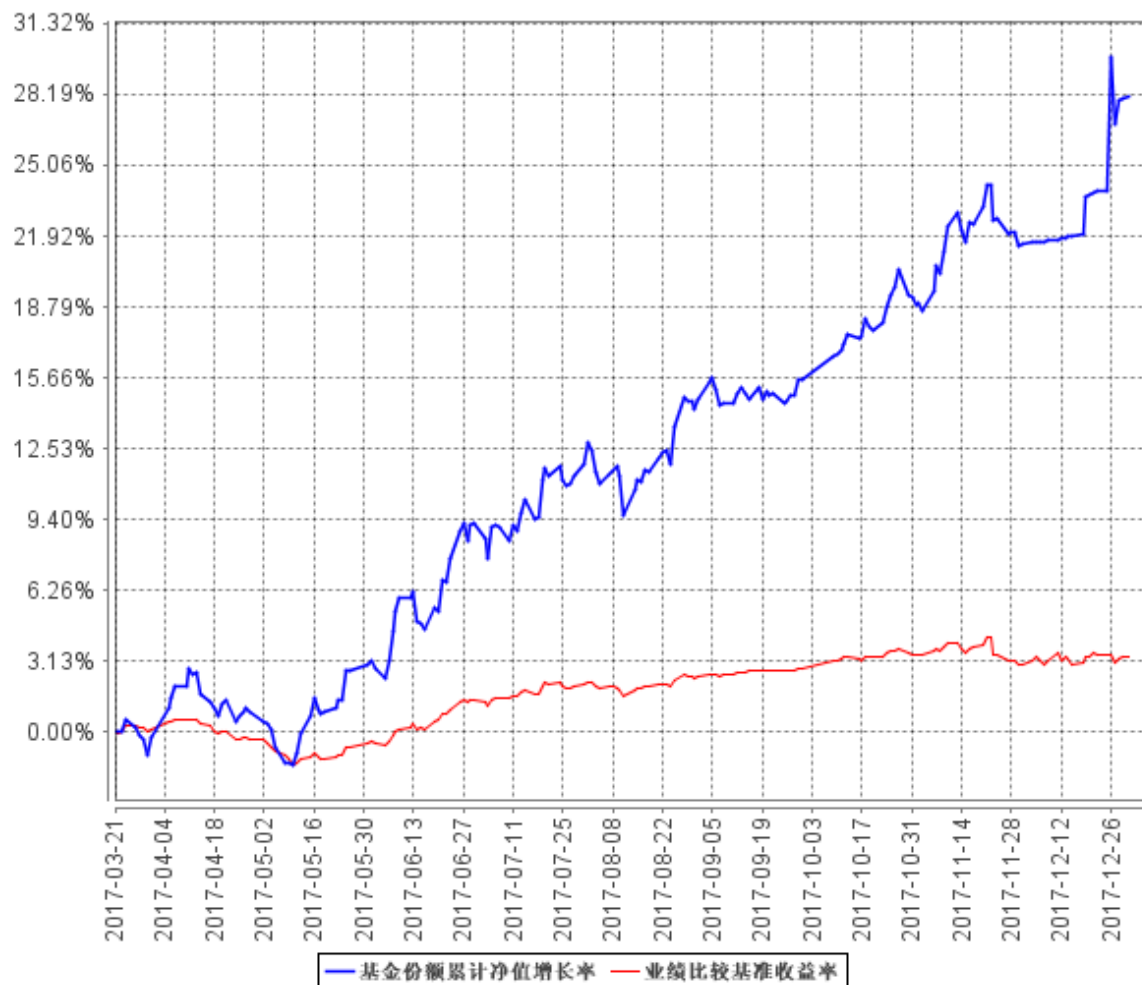
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	10.79%	0.81%	0.46%	0.17%	10.33%	0.64%
过去六个月	17.25%	0.69%	1.85%	0.15%	15.40%	0.54%
自基金合同	28.07%	0.65%	3.32%	0.14%	24.75%	0.51%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

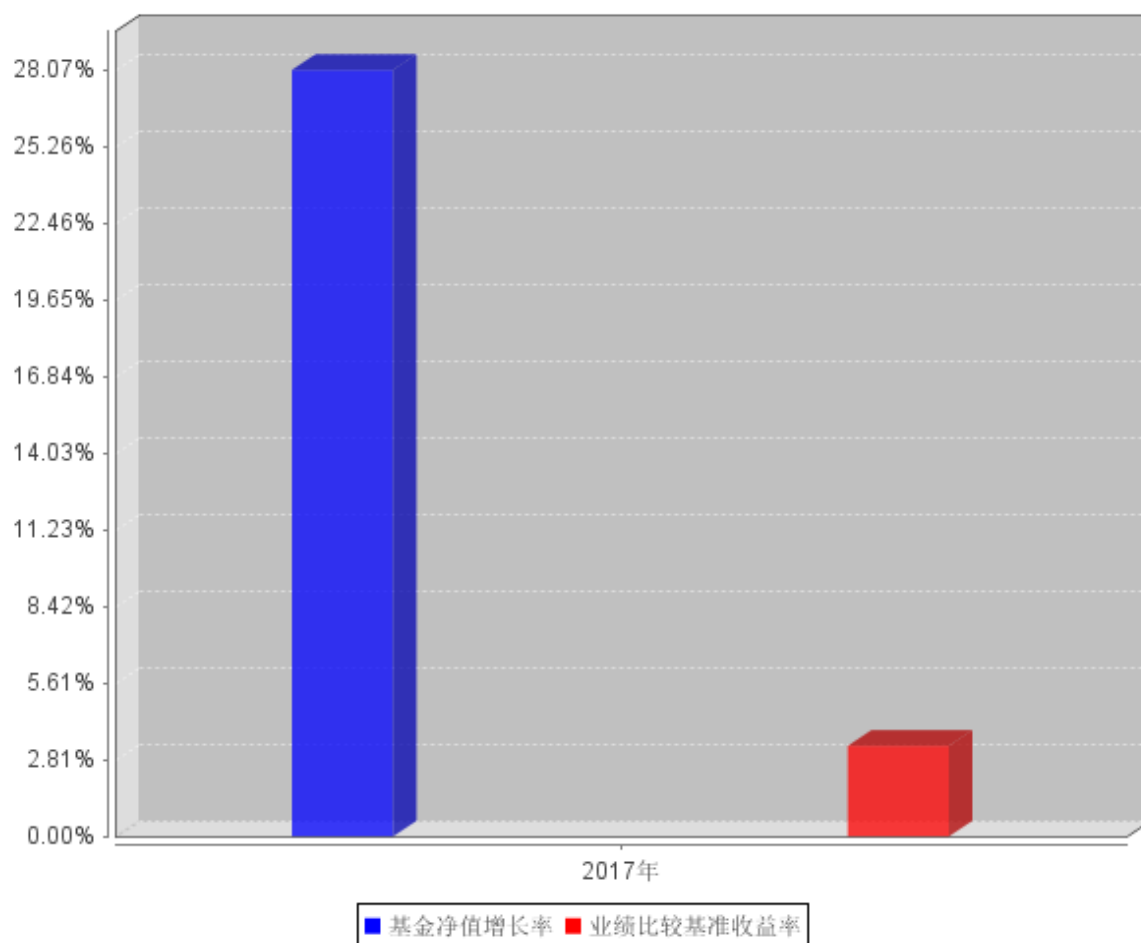
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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	1.2000	12,475,007.98	410.83	12,475,418.81	
合计	1.2000	12,475,007.98	410.83	12,475,418.81	

§ 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		
刘荟	本基金基金经理	2017年3月21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。
冷文鹏	本基金基金经理	2017年4月6日	—	十二年	中国人民银行研究生部金融学硕士，曾任中国经济技术投资担保有限公司产品经理、华夏基金管理有限公司高级经理、新华基金管理有限公司研究员、华泰柏瑞基金管理有限公司高级研究员。2016年4月加入本公司，具有基金从业资格，中国国籍。

注：1. 基金经理的任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日；

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》、本基金《基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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。

感谢持有人的支持，我们将继续以诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金，努力为持有人带来良好的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内基金业绩表现参见本报告第三部分“主要财务指标和基金净值表现”。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，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。

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

估值委员会的成员包括投资管理部、风险控制岗、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

本报告期内，平安银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在西部利得久安回报混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《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，对本基金的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

该基金本报告期内向份额持有人分配利润：12,475,418.81 元。

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 1800082 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	西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的第 1 页至第 31 页的西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“西部利得久安回报基金”)财务报表,包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表、自 2017 年 3 月 21 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。 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久安回报基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2017 年 3 月 21 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。
形成审计意见的基础	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久安回报基金,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。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	西部利得久安回报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久安回报基金 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。 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。 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。 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。

管理层和治理层对财务报表的责任	西部利得久安回报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。 在编制财务报表时，西部利得久安回报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久安回报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，除非西部利得久安回报基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 西部利得久安回报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久安回报基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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： (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。 (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。 (3) 评价西部利得久安回报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。

	(4) 对西部利得久安回报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，就可能导致对西部利得久安回报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久安回报基金不能持续经营。 (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。 我们与西部利得久安回报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。	
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：西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金

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	2,244,922.03	-
结算备付金		4,278,308.14	-
存出保证金		106,465.38	-
交易性金融资产	7.4.7.2	2,194,379.25	-
其中：股票投资		2,194,379.25	-
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	4,046.80	-
应收股利		-	-
应收申购款		3,932,091.16	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		12,760,212.76	-
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		-	-
应付赎回款		3,901,480.45	-
应付管理人报酬		61,785.64	-
应付托管费		11,584.81	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	188,599.85	-
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	151,357.39	-
负债合计		4,314,808.14	-
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	7,314,005.94	-
未分配利润	7.4.7.10	1,131,398.68	-
所有者权益合计		8,445,404.62	-
负债和所有者权益总计		12,760,212.76	-

注：1. 报告截止日 2017 年 12 月 31 日，西部利得久安回报混合基金份额净值 1.1547 元，基金份额总额 7314005.94 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 3 月 21 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：西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 3 月 21 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 3 月 21 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		41,544,060.95	-
1. 利息收入		686,392.24	-
其中：存款利息收入	7.4.7.11	326,928.93	-
债券利息收入		1.99	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		359,461.32	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		41,604,583.23	-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	37,878,509.99	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	1,763.13	-
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	3,724,310.11	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-1,863,479.00	-

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	1,116,564.48	-
减：二、费用		2,693,663.40	-
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,179,015.52	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	221,065.50	-
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,188,182.38	-
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	105,400.00	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		38,850,397.55	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		38,850,397.55	-

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：西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 3 月 21 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 3 月 21 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）	200,520,789.91	-	200,520,789.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	38,850,397.55	38,850,397.55
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）	-193,206,783.97	-25,243,580.06	-218,450,364.03
其中：1. 基金申购款	159,714,627.94	23,803,329.52	183,517,957.46
2. 基金赎回款	-352,921,411.91	-49,046,909.58	-401,968,321.49
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）	-	-12,475,418.81	-12,475,418.81
五、期末所有者权益（基	7,314,005.94	1,131,398.68	8,445,404.62

金净值)			
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
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：

<u>贺燕萍</u>	<u>贺燕萍</u>	<u>张皞骏</u>
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

西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016] 2113 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《西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2017 年 3 月 21 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 200,520,789.91 份基金份额。本基金的基金管理人为西部利得基金公司，基金托管人为平安银行

股份有限公司（以下简称“平安银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围是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、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。本基金的投资组合比例为：股票市值占基金资产的 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。本基金的业绩比较标准 = 沪深 300 指数收益率 $\times$ 20% + 中证全债指数收益率 $\times$ 80%。

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》、《西部利得久安回报混合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[2015] 125 号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、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。

对香港市场投资者（包括单位和个人）通过基金互认买卖内地基金份额免征增值税。

(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) 关于香港市场投资者通过基金互认买卖内地基金份额的所得税问题：

对香港市场投资者（包括企业和个人）通过基金互认买卖内地基金份额取得的转让差价所得，暂免征收所得税。

对香港市场投资者（包括企业和个人）通过基金互认从内地基金分配取得的收益，由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时，对香港市场投资者按照 10% 的税率代扣所得税；或发行债券的企业向该内地基金分配利息时，对香港市场投资者按照 7% 的税率代扣所得税，并由内地上市公司或发行债券的企业向其主管税务机关办理扣缴申报。该内地基金向投资者分配收益时，不再扣缴所得税。

内地基金管理人应当向相关证券登记结算机构提供内地基金的香港市场投资者的相关信息。

(f) 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。

(g) 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	2,244,922.03	-
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	2,244,922.03	-

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		4,057,858.25	2,194,379.25	-1,863,479.00
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		4,057,858.25	2,194,379.25	-1,863,479.00
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未持有衍生金融资产/负债。本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

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。本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

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未持有买断式逆回购交易中取得的债券。本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

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	1,876.28	-
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	2,117.83	-
应收债券利息	-	-
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	52.69	-
合计	4,046.80	-

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未持有其他资产。本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

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	188,599.85	-
银行间市场应付交易费用	-	-

合计	188,599.85	-
----	------------	---

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	46,357.39	-
预提费用	105,000.00	-
合计	151,357.39	-

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 3 月 21 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	200,520,789.91	200,520,789.91
本期申购	159,714,627.94	159,714,627.94
本期赎回(以“-”号填列)	-352,921,411.91	-352,921,411.91
- 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	7,314,005.94	7,314,005.94

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	40,713,876.55	-1,863,479.00	38,850,397.55
本期基金份额交易产生的变动数	-26,602,500.67	1,358,920.61	-25,243,580.06
其中：基金申购款	19,985,857.31	3,817,472.21	23,803,329.52
基金赎回款	-46,588,357.98	-2,458,551.60	-49,046,909.58
本期已分配利润	-12,475,418.81	-	-12,475,418.81
本期末	1,635,957.07	-504,558.39	1,131,398.68

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 3 月 21 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
活期存款利息收入	260,641.93	-
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	12,152.03	-
其他	54,134.97	-
合计	326,928.93	-

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 3 月 21 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	550,555,128.47	-
减：卖出股票成本总额	512,676,618.48	-
买卖股票差价收入	37,878,509.99	-

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3月21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	1,763.13	-
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	1,763.13	-

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3月21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	12,965.12	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	11,200.00	-
减：应收利息总额	1.99	-
买卖债券差价收入	1,763.13	-

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未持有资产支持证券。本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

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。本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

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。本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

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3月21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	3,724,310.11	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,724,310.11	-

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

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3月21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	-1,863,479.00	-
——股票投资	-1,863,479.00	-
——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	-1,863,479.00	-

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3月21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	1,116,564.48	-

合计	1,116,564.48	-
----	--------------	---

- 注：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 3 月 21 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	1,188,182.38	-
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,188,182.38	-

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 3 月 21 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	-
其他	400.00	-
合计	105,400.00	-

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
平安银行股份有限公司	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 3 月 21 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	310,687,560.42	29.22%	-	-

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

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。本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 3 月 21 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	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
西部证券	1,530,000,000.00	60.00%	-	-

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金于本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

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 3 月 21 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	133,999.98	24.66%	53,925.29	28.59%
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

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

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 3 月 21 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	1,179,015.52	-
其中：支付销售机构的客 户维护费	1,071.06	-

注：1. 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 0.80% 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 × 0.80% / 当年天数。

2. 本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 3 月 21 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	221,065.50	-

注：1. 支付基金托管人平安银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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 × 0.15% / 当年天数。

2. 本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

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未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

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运用固有资金投资本基金。本基金为本报告期内成立的基金，无上年度可比期间。

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

关联方名称	本期末 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
西部利得-汇通 3 号 资	3,016,165.97	41.2382%	-	-

产 管 理 计 划				
-----------------	--	--	--	--

本基金为本报告期内成立的基金，无上年度可比期间。

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 3 月 21 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
平安银行股份有限公司	2,244,922.03	260,641.93	-	-

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业利率计息。

2. 本基金通过“平安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 4,278,308.14 元。

3. 本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。本基金为本报告期内成立的基金，无上年度可比期间。

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 18 日	-	2017 年 12 月 18 日	1.2000	12,475,007.98	410.83	12,475,418.81	
合计	-	-		1.2000	12,475,007.98	410.83	12,475,418.81	

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	-

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
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	158,800	2,509,493.00	687,604.00	-
600332	白云山	2017 年 10 月 31 日	重大资产重组	31.77	2018 年 1 月 8 日	30.15	18,800	515,492.00	597,276.00	-
002739	万达电影	-	重大资产重组	45.91	-	-	12,700	692,601.00	583,057.00	-
600150	中国船舶	-	重大资产重组	24.07	-	-	12,700	319,519.00	305,689.00	-

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。本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

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

本基金是一只混合型证券投资基金，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中国平安银行，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。

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。于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

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	2,244,922.03	-	-	-	2,244,922.03
结算备付金	4,278,308.14	-	-	-	4,278,308.14
存出保证金	106,465.38	-	-	-	106,465.38
交易性金融资产	-	-	-	2,194,379.25	2,194,379.25
应收利息	-	-	-	4,046.80	4,046.80
应收申购款	-	-	-	3,932,091.16	3,932,091.16

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,629,695.55	-	-	-6,130,517.21	12,760,212.76
负债					
应付赎回款	-	-	-	-3,901,480.45	3,901,480.45
应付管理人报酬	-	-	-	61,785.64	61,785.64
应付托管费	-	-	-	11,584.81	11,584.81
应付交易费用	-	-	-	188,599.85	188,599.85
其他负债	-	-	-	151,357.39	151,357.39
负债总计	-	-	-	-4,314,808.14	4,314,808.14
利率敏感度缺口	6,629,695.55	-	-	-1,815,709.07	8,445,404.62
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	2,194,379.25	25.98	—	—
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	2,194,379.25	25.98	—	—

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%	1,356,000.00	—
	业绩比较基准下降 5%	-1,356,000.00	—

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无属于第一层级的余额，属于第二层级的余额为 2,194,379.25 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	2,194,379.25	17.20
	其中：股票	2,194,379.25	17.20
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	6,523,230.17	51.12
7	其他各项资产	4,042,603.34	31.68
8	合计	12,760,212.76	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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	923,718.25	10.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	687,604.00	8.14
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	583,057.00	6.90
S	综合	-	-
	合计	2,194,379.25	25.98

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	300104	乐视网	158,800	687,604.00	8.14
2	600332	白云山	18,800	597,276.00	7.07
3	002739	万达电影	12,700	583,057.00	6.90
4	600150	中国船舶	12,700	305,689.00	3.62
5	603161	科华控股	1,239	20,753.25	0.25

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	002142	宁波银行	16,781,733.84	198.71
2	000776	广发证券	9,136,826.90	108.19
3	601398	工商银行	8,734,727.82	103.43
4	601288	农业银行	7,753,264.00	91.80
5	601318	中国平安	7,544,437.17	89.33
6	601601	中国太保	6,454,318.14	76.42
7	000333	美的集团	6,037,734.00	71.49

8	601939	建设银行	5,999,984.00	71.04
9	000651	格力电器	5,921,820.00	70.12
10	600036	招商银行	5,834,971.00	69.09
11	601998	中信银行	5,449,515.93	64.53
12	601336	新华保险	4,913,007.37	58.17
13	601668	中国建筑	4,746,208.00	56.20
14	601800	中国交建	4,110,532.00	48.67
15	002146	荣盛发展	3,940,984.57	46.66
16	600030	中信证券	3,921,285.02	46.43
17	600340	华夏幸福	3,914,894.00	46.36
18	600104	上汽集团	3,900,143.00	46.18
19	600050	中国联通	3,897,678.00	46.15
20	601166	兴业银行	3,852,561.00	45.62
21	601997	贵阳银行	3,717,232.87	44.01
22	600519	贵州茅台	3,617,838.18	42.84
23	600837	海通证券	3,601,480.00	42.64
24	600028	中国石化	3,486,024.00	41.28
25	600109	国金证券	3,362,895.20	39.82
26	601211	国泰君安	3,354,549.54	39.72
27	600900	长江电力	3,295,599.00	39.02
28	002415	海康威视	3,203,380.00	37.93
29	601818	光大银行	3,106,614.00	36.78
30	000166	申万宏源	3,066,038.95	36.30
31	600999	招商证券	3,058,666.78	36.22
32	600048	保利地产	2,939,554.54	34.81
33	001979	招商蛇口	2,833,076.52	33.55
34	600383	金地集团	2,770,950.00	32.81
35	601186	中国铁建	2,609,081.83	30.89
36	601766	中国中车	2,599,271.00	30.78
37	601899	紫金矿业	2,575,346.00	30.49
38	002310	东方园林	2,548,314.86	30.17
39	601988	中国银行	2,547,875.00	30.17
40	300104	乐视网	2,509,493.00	29.71
41	600023	浙能电力	2,386,790.00	28.26
42	600000	浦发银行	2,383,741.64	28.23
43	600089	特变电工	2,361,704.51	27.96

44	002241	歌尔股份	2,344,173.60	27.76
45	000402	金融街	2,337,899.06	27.68
46	601901	方正证券	2,327,305.00	27.56
47	600549	厦门钨业	2,299,396.46	27.23
48	002304	洋河股份	2,296,403.80	27.19
49	601688	华泰证券	2,296,399.00	27.19
50	601088	中国神华	2,290,308.00	27.12
51	000063	中兴通讯	2,280,691.00	27.01
52	000338	潍柴动力	2,271,953.08	26.90
53	601881	中国银河	2,219,132.00	26.28
54	000423	东阿阿胶	2,130,610.92	25.23
55	600066	宇通客车	2,125,561.56	25.17
56	002051	中工国际	2,120,754.48	25.11
57	600019	宝钢股份	2,092,391.00	24.78
58	000060	中金岭南	2,090,141.83	24.75
59	600068	葛洲坝	2,085,460.00	24.69
60	002035	华帝股份	2,061,419.80	24.41
61	002450	康得新	2,029,772.04	24.03
62	000100	TCL 集团	2,000,754.00	23.69
63	601600	中国铝业	1,994,119.00	23.61
64	600703	三安光电	1,988,695.32	23.55
65	601225	陕西煤业	1,987,008.00	23.53
66	000709	河钢股份	1,875,078.00	22.20
67	601128	常熟银行	1,855,946.00	21.98
68	601677	明泰铝业	1,839,516.00	21.78
69	000065	北方国际	1,807,825.60	21.41
70	600338	西藏珠峰	1,806,782.00	21.39
71	600887	伊利股份	1,798,395.00	21.29
72	601377	兴业证券	1,788,843.70	21.18
73	002065	东华软件	1,777,583.00	21.05
74	600170	上海建工	1,736,350.00	20.56
75	601006	大秦铁路	1,727,566.00	20.46
76	002410	广联达	1,714,410.00	20.30
77	000157	中联重科	1,700,655.20	20.14
78	601111	中国国航	1,694,243.85	20.06
79	000917	电广传媒	1,681,763.00	19.91

80	600741	华域汽车	1,674,527.00	19.83
81	000069	华侨城 A	1,619,593.00	19.18
82	600795	国电电力	1,615,728.00	19.13
83	601877	正泰电器	1,601,960.00	18.97
84	000858	五粮液	1,601,248.66	18.96
85	600208	新潮中宝	1,598,060.00	18.92
86	000568	泸州老窖	1,581,614.75	18.73
87	600886	国投电力	1,573,846.00	18.64
88	601018	宁波港	1,558,546.00	18.45
89	600309	万华化学	1,556,999.00	18.44
90	600663	陆家嘴	1,550,586.00	18.36
91	000596	古井贡酒	1,549,517.51	18.35
92	600021	上海电力	1,527,718.00	18.09
93	600062	华润双鹤	1,523,344.90	18.04
94	000665	湖北广电	1,521,639.79	18.02
95	002242	九阳股份	1,514,059.00	17.93
96	600660	福耀玻璃	1,486,201.00	17.60
97	601117	中国化学	1,465,765.00	17.36
98	300232	洲明科技	1,443,844.64	17.10
99	000895	双汇发展	1,438,148.00	17.03
100	002153	石基信息	1,436,198.84	17.01
101	600031	三一重工	1,426,707.00	16.89
102	002008	大族激光	1,421,224.93	16.83
103	600873	梅花生物	1,417,014.04	16.78
104	600718	东软集团	1,405,870.36	16.65
105	000156	华数传媒	1,398,432.80	16.56
106	600153	建发股份	1,386,575.96	16.42
107	002013	中航机电	1,380,424.25	16.35
108	601390	中国中铁	1,366,366.00	16.18
109	600850	华东电脑	1,364,896.97	16.16
110	600893	航发动力	1,360,504.22	16.11
111	002236	大华股份	1,359,950.47	16.10
112	600588	用友网络	1,354,807.00	16.04
113	600188	兖州煤业	1,353,959.46	16.03
114	000671	阳光城	1,350,929.40	16.00
115	002152	广电运通	1,349,591.41	15.98

116	002078	太阳纸业	1,331,061.00	15.76
117	600009	上海机场	1,329,572.48	15.74
118	002456	欧菲科技	1,293,356.00	15.31
119	600015	华夏银行	1,268,800.00	15.02
120	000488	晨鸣纸业	1,267,438.00	15.01
121	002171	楚江新材	1,262,648.00	14.95
122	600409	三友化工	1,251,224.00	14.82
123	000997	新大陆	1,249,041.21	14.79
124	600018	上港集团	1,239,968.00	14.68
125	002202	金风科技	1,239,489.00	14.68
126	002475	立讯精密	1,213,753.00	14.37
127	000826	启迪桑德	1,207,630.00	14.30
128	600373	中文传媒	1,203,996.61	14.26
129	000538	云南白药	1,198,036.72	14.19
130	600585	海螺水泥	1,194,979.00	14.15
131	002238	天威视讯	1,190,563.27	14.10
132	002308	威创股份	1,190,047.28	14.09
133	601928	凤凰传媒	1,189,809.00	14.09
134	600037	歌华有线	1,189,382.00	14.08
135	000425	徐工机械	1,188,535.00	14.07
136	600958	东方证券	1,186,066.00	14.04
137	002244	滨江集团	1,183,320.00	14.01
138	002027	分众传媒	1,177,589.00	13.94
139	600642	申能股份	1,170,614.86	13.86
140	300271	华宇软件	1,160,651.00	13.74
141	000039	中集集团	1,142,873.00	13.53
142	002376	新北洋	1,142,091.00	13.52
143	300183	东软载波	1,137,522.00	13.47
144	600196	复星医药	1,130,405.99	13.38
145	600276	恒瑞医药	1,121,978.60	13.29
146	000963	华东医药	1,121,505.30	13.28
147	600252	中恒集团	1,120,583.00	13.27
148	600198	大唐电信	1,118,814.00	13.25
149	600216	浙江医药	1,118,412.00	13.24
150	600436	片仔癀	1,118,130.00	13.24
151	000999	华润三九	1,115,121.10	13.20

152	000725	京东方 A	1,114,147.00	13.19
153	600415	小商品城	1,113,061.00	13.18
154	600056	中国医药	1,112,403.00	13.17
155	600739	辽宁成大	1,106,290.00	13.10
156	600132	重庆啤酒	1,104,819.00	13.08
157	601231	环旭电子	1,077,979.66	12.76
158	002190	成飞集成	1,037,689.00	12.29
159	600690	青岛海尔	1,032,323.00	12.22
160	002419	天虹股份	1,031,754.02	12.22
161	601989	中国重工	1,022,497.00	12.11
162	300115	长盈精密	1,022,398.00	12.11
163	002411	必康股份	1,022,317.00	12.11
164	000525	红太阳	1,016,055.79	12.03
165	601985	中国核电	1,015,876.00	12.03
166	600757	长江传媒	1,014,737.00	12.02
167	300136	信维通信	1,014,337.00	12.01
168	601238	广汽集团	1,013,802.00	12.00
169	601607	上海医药	1,007,571.88	11.93
170	600535	天士力	1,007,540.20	11.93
171	600681	百川能源	1,005,933.00	11.91
172	000541	佛山照明	997,726.00	11.81
173	600820	隧道股份	997,255.00	11.81
174	600547	山东黄金	989,193.00	11.71
175	600809	山西汾酒	980,126.00	11.61
176	601669	中国电建	979,969.00	11.60
177	000413	东旭光电	967,786.00	11.46
178	600362	江西铜业	957,387.00	11.34
179	002230	科大讯飞	942,534.99	11.16
180	002024	苏宁云商	932,108.00	11.04
181	000876	新希望	927,419.37	10.98
182	600518	康美药业	925,046.00	10.95
183	600570	恒生电子	903,640.17	10.70
184	601633	长城汽车	897,870.00	10.63
185	600185	格力地产	896,660.14	10.62
186	000050	深天马 A	896,626.00	10.62
187	601919	中远海控	883,823.00	10.47

188	600029	南方航空	883,745.00	10.46
189	300002	神州泰岳	873,060.00	10.34
190	600100	同方股份	870,026.00	10.30
191	000021	深科技	868,941.00	10.29
192	601618	中国中冶	864,519.00	10.24
193	603589	口子窖	858,189.00	10.16
194	600674	川投能源	848,556.00	10.05
195	000601	韶能股份	846,877.60	10.03
196	600008	首创股份	845,021.00	10.01
197	600236	桂冠电力	842,490.00	9.98
198	002611	东方精工	841,566.00	9.96
199	600835	上海机电	828,783.00	9.81
200	600426	华鲁恒升	821,918.00	9.73
201	002050	三花智控	817,074.62	9.67
202	300418	昆仑万维	806,864.00	9.55
203	002555	三七互娱	805,943.00	9.54
204	600702	沱牌舍得	801,978.00	9.50
205	002429	兆驰股份	799,932.00	9.47
206	601857	中国石油	798,462.00	9.45
207	601799	星宇股份	797,205.00	9.44
208	300113	顺网科技	794,486.25	9.41
209	000888	峨眉山 A	791,479.08	9.37
210	002624	完美世界	790,903.00	9.36
211	300258	精锻科技	786,183.00	9.31
212	601933	永辉超市	780,383.00	9.24
213	600872	中炬高新	777,546.00	9.21
214	600352	浙江龙盛	734,265.00	8.69
215	600491	龙元建设	731,469.00	8.66
216	603018	中设集团	731,228.00	8.66
217	300197	铁汉生态	728,879.00	8.63
218	000417	合肥百货	724,384.00	8.58
219	600522	中天科技	722,350.00	8.55
220	600487	亨通光电	713,384.00	8.45
221	600754	锦江股份	713,267.00	8.45
222	000418	小天鹅 A	711,578.00	8.43
223	600038	中直股份	709,613.00	8.40

224	300098	高新兴	709,590.00	8.40
225	600098	广州发展	707,133.00	8.37
226	300231	银信科技	699,262.00	8.28
227	002739	万达电影	692,601.00	8.20
228	002087	新野纺织	685,202.80	8.11
229	002343	慈文传媒	682,877.00	8.09
230	002385	大北农	679,259.00	8.04
231	002110	三钢闽光	675,535.00	8.00
232	000625	长安汽车	673,009.00	7.97
233	600808	马钢股份	672,598.00	7.96
234	603806	福斯特	669,430.00	7.93
235	600498	烽火通信	668,825.00	7.92
236	000768	中航飞机	660,652.00	7.82
237	002717	岭南园林	660,652.00	7.82
238	002493	荣盛石化	656,661.26	7.78
239	600475	华光股份	654,794.00	7.75
240	601098	中南传媒	653,320.00	7.74
241	300284	苏交科	651,875.00	7.72
242	600959	江苏有线	646,194.50	7.65
243	601567	三星医疗	645,462.54	7.64
244	300208	恒顺众昇	644,825.00	7.64
245	002090	金智科技	643,144.00	7.62
246	600816	安信信托	642,699.60	7.61
247	300285	国瓷材料	642,691.00	7.61
248	600885	宏发股份	639,519.00	7.57
249	600201	生物股份	638,696.00	7.56
250	600039	四川路桥	636,661.00	7.54
251	603167	渤海轮渡	636,181.00	7.53
252	000582	北部湾港	635,584.50	7.53
253	600970	中材国际	634,849.00	7.52
254	000951	中国重汽	633,582.00	7.50
255	002311	海大集团	633,252.32	7.50
256	601179	中国西电	629,087.00	7.45
257	601012	隆基股份	627,183.00	7.43
258	002203	海亮股份	621,950.00	7.36
259	603799	华友钴业	621,080.00	7.35

260	000661	长春高新	612,225.00	7.25
261	002460	赣锋锂业	607,533.00	7.19
262	600177	雅戈尔	607,086.00	7.19
263	002237	恒邦股份	603,391.00	7.14
264	603788	宁波高发	602,900.00	7.14
265	000728	国元证券	602,789.00	7.14
266	000513	丽珠集团	600,237.00	7.11
267	300003	乐普医疗	591,023.00	7.00
268	603355	莱克电气	587,887.00	6.96
269	600742	一汽富维	587,401.00	6.96
270	601888	中国国旅	584,146.00	6.92
271	601021	春秋航空	574,052.00	6.80
272	600258	首旅酒店	561,383.00	6.65
273	002470	金正大	556,224.00	6.59
274	600297	广汇汽车	554,482.50	6.57
275	000915	山大华特	553,887.00	6.56
276	300070	碧水源	553,470.00	6.55
277	600271	航天信息	552,194.59	6.54
278	000792	盐湖股份	550,757.00	6.52
279	600176	中国巨石	550,568.00	6.52
280	000581	威孚高科	549,854.00	6.51
281	600312	平高电气	549,817.00	6.51
282	601216	君正集团	546,774.00	6.47
283	603993	洛阳钼业	545,898.00	6.46
284	002680	长生生物	527,962.00	6.25
285	601699	潞安环能	522,938.00	6.19
286	002668	奥马电器	522,386.20	6.19
287	000881	中广核技	521,761.00	6.18
288	002120	韵达股份	519,731.00	6.15
289	601929	吉视传媒	519,453.00	6.15
290	600566	济川药业	519,167.00	6.15
291	600332	白云山	515,492.00	6.10
292	601801	皖新传媒	515,247.00	6.10
293	002572	索菲亚	512,155.00	6.06
294	002405	四维图新	510,671.00	6.05
295	600572	康恩贝	509,032.58	6.03

296	600637	东方明珠	505,774.43	5.99
297	600997	开滦股份	502,203.00	5.95
298	600884	杉杉股份	499,187.00	5.91
299	300310	宜通世纪	497,090.00	5.89
300	600971	恒源煤电	495,815.00	5.87
301	002465	海格通信	491,576.00	5.82
302	603179	新泉股份	490,130.00	5.80
303	000848	承德露露	490,023.00	5.80
304	002292	奥飞娱乐	489,562.00	5.80
305	600282	南钢股份	489,098.00	5.79
306	002396	星网锐捷	486,778.00	5.76
307	600995	文山电力	483,262.75	5.72
308	000883	湖北能源	481,880.00	5.71
309	601139	深圳燃气	479,870.00	5.68
310	600782	新钢股份	479,722.00	5.68
311	600323	瀚蓝环境	478,730.00	5.67
312	002573	清新环境	477,581.00	5.65
313	002478	常宝股份	475,700.00	5.63
314	002479	富春环保	474,931.00	5.62
315	002094	青岛金王	464,928.00	5.51
316	002061	浙江交科	456,272.00	5.40
317	002674	兴业科技	455,119.00	5.39
318	600348	阳泉煤业	450,589.00	5.34
319	600507	方大特钢	449,262.00	5.32
320	300365	恒华科技	449,038.00	5.32
321	002562	兄弟科技	448,494.00	5.31
322	002597	金禾实业	448,438.00	5.31
323	600827	百联股份	447,072.00	5.29
324	002440	闰土股份	445,991.00	5.28
325	002136	安纳达	443,383.00	5.25
326	000830	鲁西化工	442,620.00	5.24
327	002749	国光股份	442,195.00	5.24
328	002195	二三四五	439,322.00	5.20
329	002145	中核钛白	438,904.00	5.20
330	000703	恒逸石化	437,582.00	5.18
331	600697	欧亚集团	421,134.00	4.99

332	600231	凌钢股份	418,887.00	4.96
333	600596	新安股份	416,484.00	4.93
334	300335	迪森股份	413,393.00	4.89
335	600160	巨化股份	408,102.00	4.83
336	603599	广信股份	407,225.00	4.82
337	000598	兴蓉环境	406,818.00	4.82
338	601333	广深铁路	404,524.00	4.79
339	600668	尖峰集团	402,397.18	4.76
340	600388	龙净环保	401,503.00	4.75
341	300286	安科瑞	400,767.00	4.75
342	300124	汇川技术	399,875.00	4.73
343	600705	中航资本	399,168.00	4.73
344	002335	科华恒盛	396,920.00	4.70
345	002677	浙江美大	396,717.00	4.70
346	600054	黄山旅游	394,793.72	4.67
347	601222	林洋能源	394,642.87	4.67
348	300342	天银机电	394,320.50	4.67
349	300144	宋城演艺	390,983.00	4.63
350	002247	帝龙文化	375,531.24	4.45
351	600229	城市传媒	375,501.00	4.45
352	600760	中航黑豹	372,530.00	4.41
353	000022	深赤湾 A	371,073.00	4.39
354	000547	航天发展	365,925.00	4.33
355	000543	皖能电力	344,667.00	4.08
356	603338	浙江鼎力	342,212.00	4.05
357	603111	康尼机电	337,463.00	4.00
358	000976	华铁股份	337,207.00	3.99
359	002026	山东威达	336,472.00	3.98
360	600528	中铁工业	335,166.00	3.97
361	000759	中百集团	334,441.00	3.96
362	002714	牧原股份	333,100.00	3.94
363	603019	中科曙光	332,034.00	3.93
364	000786	北新建材	331,582.00	3.93
365	600298	安琪酵母	328,874.00	3.89
366	601100	恒立液压	328,104.00	3.89
367	002354	天神娱乐	326,925.00	3.87

368	300182	捷成股份	326,158.00	3.86
369	600548	深高速	325,987.00	3.86
370	002402	和而泰	325,917.50	3.86
371	300219	鸿利智汇	325,435.83	3.85
372	002712	思美传媒	324,876.00	3.85
373	300031	宝通科技	324,619.00	3.84
374	603556	海兴电力	324,389.00	3.84
375	300032	金龙机电	324,035.00	3.84
376	000738	航发控制	323,891.00	3.84
377	600859	王府井	321,538.00	3.81
378	600879	航天电子	321,523.00	3.81
379	601127	小康股份	321,093.14	3.80
380	600967	内蒙一机	320,827.00	3.80
381	600761	安徽合力	320,010.00	3.79
382	300193	佳士科技	320,004.80	3.79
383	600482	中国动力	319,955.00	3.79
384	002111	威海广泰	319,846.00	3.79
385	600150	中国船舶	319,519.00	3.78
386	000530	大冷股份	318,750.00	3.77
387	601636	旗滨集团	318,570.00	3.77
388	600004	白云机场	318,106.00	3.77
389	000501	鄂武商 A	317,930.39	3.76
390	000429	粤高速 A	315,952.00	3.74
391	002179	中航光电	315,140.00	3.73
392	002366	台海核电	314,952.00	3.73
393	600270	外运发展	314,480.00	3.72
394	000778	新兴铸管	311,498.00	3.69
395	000761	本钢板材	308,657.00	3.65
396	002640	跨境通	304,533.00	3.61
397	002033	丽江旅游	303,114.00	3.59
398	002434	万里扬	298,726.00	3.54
399	002746	仙坛股份	298,237.00	3.53
400	002187	广百股份	297,510.00	3.52
401	002477	雏鹰农牧	292,082.00	3.46
402	002041	登海种业	290,752.00	3.44
403	000998	隆平高科	287,578.00	3.41

404	002124	天邦股份	272,955.00	3.23
405	600537	亿晶光电	264,002.00	3.13
406	002042	华孚时尚	247,349.25	2.93
407	000726	鲁泰 A	247,271.00	2.93
408	600438	通威股份	241,958.00	2.86
409	002018	华信国际	240,753.00	2.85
410	000936	华西股份	223,704.00	2.65
411	002496	辉丰股份	223,482.00	2.65
412	603188	亚邦股份	222,833.00	2.64
413	000890	法尔胜	221,624.00	2.62
414	600612	老凤祥	221,066.00	2.62
415	002790	瑞尔特	198,472.00	2.35
416	002191	劲嘉股份	197,031.00	2.33

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。

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	002142	宁波银行	18,427,299.98	218.19
2	601318	中国平安	13,004,300.96	153.98
3	601398	工商银行	9,914,720.40	117.40
4	000776	广发证券	9,885,002.81	117.05
5	601288	农业银行	8,546,724.00	101.20
6	600036	招商银行	8,359,261.64	98.98
7	601601	中国太保	7,937,030.00	93.98
8	000651	格力电器	7,057,850.00	83.57
9	000333	美的集团	6,790,221.80	80.40
10	601939	建设银行	6,717,510.96	79.54
11	601336	新华保险	5,878,937.60	69.61
12	601998	中信银行	5,447,343.00	64.50
13	002146	荣盛发展	4,939,212.20	58.48
14	600340	华夏幸福	4,885,024.00	57.84
15	601668	中国建筑	4,851,526.62	57.45
16	600519	贵州茅台	4,718,140.72	55.87
17	600104	上汽集团	4,354,002.00	51.55

18	600030	中信证券	4,244,144.00	50.25
19	601166	兴业银行	4,026,454.00	47.68
20	600050	中国联通	3,892,740.00	46.09
21	601800	中国交建	3,883,956.66	45.99
22	600900	长江电力	3,652,385.00	43.25
23	601211	国泰君安	3,629,896.86	42.98
24	002415	海康威视	3,575,265.60	42.33
25	600028	中国石化	3,539,612.00	41.91
26	600837	海通证券	3,527,118.00	41.76
27	600048	保利地产	3,378,806.00	40.01
28	601997	贵阳银行	3,370,022.00	39.90
29	000063	中兴通讯	3,320,753.00	39.32
30	601818	光大银行	3,220,106.00	38.13
31	600109	国金证券	3,205,162.00	37.95
32	600999	招商证券	3,116,419.00	36.90
33	001979	招商蛇口	3,094,871.48	36.65
34	000166	申万宏源	2,943,886.58	34.86
35	601600	中国铝业	2,760,836.00	32.69
36	600383	金地集团	2,760,258.00	32.68
37	601901	方正证券	2,692,341.00	31.88
38	000709	河钢股份	2,655,388.00	31.44
39	601088	中国神华	2,638,100.08	31.24
40	002310	东方园林	2,587,856.19	30.64
41	601766	中国中车	2,559,418.00	30.31
42	600887	伊利股份	2,547,787.00	30.17
43	601688	华泰证券	2,514,151.00	29.77
44	601899	紫金矿业	2,491,604.00	29.50
45	601186	中国铁建	2,490,432.00	29.49
46	002241	歌尔股份	2,486,467.00	29.44
47	000402	金融街	2,459,420.14	29.12
48	002304	洋河股份	2,427,943.00	28.75
49	600089	特变电工	2,363,285.55	27.98
50	601988	中国银行	2,356,668.00	27.90
51	600023	浙能电力	2,332,395.99	27.62
52	600000	浦发银行	2,321,499.60	27.49
53	600019	宝钢股份	2,317,679.00	27.44
54	600703	三安光电	2,312,589.83	27.38
55	000338	潍柴动力	2,283,897.00	27.04

56	002450	康得新	2,268,664.00	26.86
57	000060	中金岭南	2,266,319.00	26.83
58	002035	华帝股份	2,202,442.00	26.08
59	600549	厦门钨业	2,086,305.25	24.70
60	601881	中国银河	2,068,399.00	24.49
61	600338	西藏珠峰	2,066,268.00	24.47
62	600741	华域汽车	2,061,943.63	24.41
63	000858	五粮液	2,050,516.00	24.28
64	000423	东阿阿胶	2,036,156.00	24.11
65	002051	中工国际	2,028,762.00	24.02
66	002008	大族激光	2,017,370.02	23.89
67	600066	宇通客车	2,016,380.00	23.88
68	000568	泸州老窖	2,000,654.78	23.69
69	002236	大华股份	1,974,475.00	23.38
70	601006	大秦铁路	1,972,417.10	23.35
71	600309	万华化学	1,914,747.00	22.67
72	601225	陕西煤业	1,897,098.00	22.46
73	000100	TCL 集团	1,889,987.00	22.38
74	600068	葛洲坝	1,836,536.00	21.75
75	002410	广联达	1,833,624.00	21.71
76	601111	中国国航	1,813,902.00	21.48
77	600009	上海机场	1,784,613.00	21.13
78	002456	欧菲科技	1,783,583.20	21.12
79	600170	上海建工	1,734,893.00	20.54
80	002065	东华软件	1,704,900.00	20.19
81	601377	兴业证券	1,694,533.56	20.06
82	601677	明泰铝业	1,691,156.00	20.02
83	000069	华侨城 A	1,676,313.00	19.85
84	002475	立讯精密	1,670,700.00	19.78
85	600062	华润双鹤	1,667,261.00	19.74
86	000157	中联重科	1,618,724.00	19.17
87	601877	正泰电器	1,603,979.00	18.99
88	600031	三一重工	1,600,646.00	18.95
89	601018	宁波港	1,596,216.18	18.90
90	600795	国电电力	1,590,820.00	18.84
91	600886	国投电力	1,575,646.80	18.66
92	601128	常熟银行	1,559,606.00	18.47
93	600276	恒瑞医药	1,541,985.20	18.26

94	000917	电广传媒	1,533,706.00	18.16
95	000065	北方国际	1,507,348.00	17.85
96	002242	九阳股份	1,498,160.00	17.74
97	000596	古井贡酒	1,497,659.00	17.73
98	600660	福耀玻璃	1,496,739.00	17.72
99	600663	陆家嘴	1,485,678.00	17.59
100	600008	首创股份	1,477,968.00	17.50
101	600153	建发股份	1,468,056.42	17.38
102	000895	双汇发展	1,463,060.00	17.32
103	600588	用友网络	1,441,931.00	17.07
104	600021	上海电力	1,438,560.00	17.03
105	600208	新湖中宝	1,428,820.00	16.92
106	000671	阳光城	1,422,104.20	16.84
107	002153	石基信息	1,417,692.00	16.79
108	000665	湖北广电	1,398,987.69	16.57
109	600585	海螺水泥	1,391,664.00	16.48
110	600809	山西汾酒	1,374,762.00	16.28
111	600188	兖州煤业	1,357,186.62	16.07
112	601390	中国中铁	1,349,227.00	15.98
113	002013	中航机电	1,339,795.72	15.86
114	000997	新大陆	1,337,177.00	15.83
115	000725	京东方 A	1,334,846.00	15.81
116	000156	华数传媒	1,329,831.01	15.75
117	600873	梅花生物	1,327,030.17	15.71
118	601231	环旭电子	1,322,931.51	15.66
119	300232	洲明科技	1,322,887.00	15.66
120	600018	上港集团	1,317,611.00	15.60
121	600690	青岛海尔	1,310,064.00	15.51
122	002152	广电运通	1,304,545.75	15.45
123	002027	分众传媒	1,293,627.00	15.32
124	000538	云南白药	1,288,417.00	15.26
125	002078	太阳纸业	1,278,719.00	15.14
126	600850	华东电脑	1,277,518.59	15.13
127	000039	中集集团	1,268,885.00	15.02
128	600718	东软集团	1,241,467.31	14.70
129	600015	华夏银行	1,229,527.31	14.56
130	000488	晨鸣纸业	1,223,974.00	14.49
131	601919	中远海控	1,223,952.00	14.49

132	600436	片仔癀	1,221,493.00	14.46
133	601117	中国化学	1,218,993.00	14.43
134	600893	航发动力	1,218,529.00	14.43
135	000963	华东医药	1,210,831.00	14.34
136	600056	中国医药	1,210,667.00	14.34
137	002230	科大讯飞	1,194,995.00	14.15
138	000826	启迪桑德	1,192,854.00	14.12
139	002244	滨江集团	1,183,829.00	14.02
140	600409	三友化工	1,181,358.00	13.99
141	002202	金风科技	1,181,062.00	13.98
142	600196	复星医药	1,175,299.00	13.92
143	600132	重庆啤酒	1,166,090.00	13.81
144	600037	歌华有线	1,162,997.44	13.77
145	600547	山东黄金	1,160,385.00	13.74
146	000999	华润三九	1,156,697.35	13.70
147	600642	申能股份	1,147,324.00	13.59
148	600570	恒生电子	1,143,186.00	13.54
149	601928	凤凰传媒	1,127,785.00	13.35
150	002171	楚江新材	1,124,357.16	13.31
151	600958	东方证券	1,122,041.00	13.29
152	300136	信维通信	1,119,313.00	13.25
153	600739	辽宁成大	1,115,429.46	13.21
154	600373	中文传媒	1,097,208.37	12.99
155	000425	徐工机械	1,085,944.00	12.86
156	601933	永辉超市	1,085,124.00	12.85
157	002376	新北洋	1,072,342.00	12.70
158	300271	华宇软件	1,059,846.90	12.55
159	600252	中恒集团	1,050,795.00	12.44
160	601607	上海医药	1,047,757.00	12.41
161	002308	威创股份	1,046,184.00	12.39
162	601985	中国核电	1,040,764.00	12.32
163	600216	浙江医药	1,040,551.00	12.32
164	600415	小商品城	1,035,089.00	12.26
165	002024	苏宁云商	1,019,490.00	12.07
166	002238	天威视讯	1,018,081.32	12.05
167	601669	中国电建	1,016,987.00	12.04
168	600029	南方航空	1,012,668.00	11.99
169	600820	隧道股份	1,003,562.00	11.88

170	600535	天士力	981,234.80	11.62
171	601238	广汽集团	979,016.00	11.59
172	300183	东软载波	972,340.00	11.51
173	600757	长江传媒	968,344.00	11.47
174	000541	佛山照明	966,593.00	11.45
175	002411	必康股份	964,112.00	11.42
176	000525	红太阳	958,031.00	11.34
177	600518	康美药业	954,737.00	11.30
178	600198	大唐电信	945,545.00	11.20
179	000050	深天马 A	942,273.00	11.16
180	600702	沱牌舍得	928,109.00	10.99
181	601633	长城汽车	926,424.00	10.97
182	002419	天虹股份	916,222.00	10.85
183	300115	长盈精密	896,553.00	10.62
184	600185	格力地产	892,299.10	10.57
185	600487	亨通光电	884,415.00	10.47
186	000876	新希望	877,255.00	10.39
187	002429	兆驰股份	876,374.00	10.38
188	601989	中国重工	869,075.00	10.29
189	600674	川投能源	864,579.00	10.24
190	601618	中国中冶	856,976.00	10.15
191	002190	成飞集成	853,245.00	10.10
192	601799	星宇股份	845,329.00	10.01
193	600872	中炬高新	844,457.00	10.00
194	002624	完美世界	843,516.00	9.99
195	600362	江西铜业	842,109.00	9.97
196	000413	东旭光电	840,184.00	9.95
197	601888	中国国旅	838,702.00	9.93
198	600352	浙江龙盛	828,973.00	9.82
199	000601	韶能股份	828,571.00	9.81
200	600498	烽火通信	825,602.00	9.78
201	600835	上海机电	825,513.99	9.77
202	600522	中天科技	809,188.00	9.58
203	002555	三七互娱	802,746.00	9.51
204	601857	中国石油	800,405.00	9.48
205	600681	百川能源	798,548.00	9.46
206	002611	东方精工	796,043.00	9.43
207	000513	丽珠集团	795,495.00	9.42

208	603589	口子窖	789,939.00	9.35
209	000661	长春高新	783,415.54	9.28
210	600426	华鲁恒升	782,058.00	9.26
211	600100	同方股份	771,718.00	9.14
212	300113	顺网科技	769,242.49	9.11
213	300418	昆仑万维	768,629.00	9.10
214	300258	精锻科技	767,573.00	9.09
215	000888	峨眉山 A	758,143.00	8.98
216	600236	桂冠电力	746,215.00	8.84
217	600754	锦江股份	738,085.00	8.74
218	000021	深科技	738,058.00	8.74
219	000418	小天鹅 A	733,093.70	8.68
220	002050	三花智控	721,923.00	8.55
221	600885	宏发股份	706,760.00	8.37
222	002493	荣盛石化	700,425.53	8.29
223	300002	神州泰岳	697,693.99	8.26
224	300098	高新兴	693,579.00	8.21
225	600098	广州发展	692,313.00	8.20
226	603806	福斯特	679,378.00	8.04
227	600038	中直股份	675,823.00	8.00
228	002311	海大集团	673,783.16	7.98
229	600959	江苏有线	673,396.50	7.97
230	002343	慈文传媒	670,299.00	7.94
231	600491	龙元建设	667,718.00	7.91
232	601098	中南传媒	663,496.00	7.86
233	000728	国元证券	658,414.00	7.80
234	000417	合肥百货	653,767.00	7.74
235	300208	恒顺众昇	653,133.00	7.73
236	000625	长安汽车	652,665.00	7.73
237	002717	岭南园林	651,154.00	7.71
238	601699	潞安环能	648,856.00	7.68
239	002385	大北农	647,668.63	7.67
240	000768	中航飞机	641,130.00	7.59
241	600475	华光股份	635,631.00	7.53
242	002110	三钢闽光	634,597.00	7.51
243	600970	中材国际	633,771.00	7.50
244	601179	中国西电	632,888.00	7.49
245	000582	北部湾港	629,138.60	7.45

246	601021	春秋航空	626,736.00	7.42
247	600177	雅戈尔	626,390.20	7.42
248	002470	金正大	626,312.00	7.42
249	603018	中设集团	623,820.00	7.39
250	600201	生物股份	621,195.00	7.36
251	300003	乐普医疗	621,194.00	7.36
252	600808	马钢股份	615,836.00	7.29
253	601216	君正集团	613,922.00	7.27
254	000951	中国重汽	612,142.00	7.25
255	600039	四川路桥	607,173.00	7.19
256	603167	渤海轮渡	606,437.00	7.18
257	002087	新野纺织	606,101.32	7.18
258	000830	鲁西化工	602,912.00	7.14
259	300285	国瓷材料	602,197.00	7.13
260	300231	银信科技	601,718.00	7.12
261	600816	安信信托	597,186.20	7.07
262	600297	广汇汽车	596,475.00	7.06
263	603355	莱克电气	593,267.00	7.02
264	300284	苏交科	589,836.56	6.98
265	300197	铁汉生态	582,464.00	6.90
266	002090	金智科技	580,988.00	6.88
267	603799	华友钴业	579,289.00	6.86
268	603788	宁波高发	574,008.00	6.80
269	601567	三星医疗	573,538.00	6.79
270	600176	中国巨石	571,563.80	6.77
271	600742	一汽富维	569,257.00	6.74
272	600271	航天信息	569,050.00	6.74
273	600258	首旅酒店	563,067.60	6.67
274	000581	威孚高科	561,785.00	6.65
275	600566	济川药业	557,840.00	6.61
276	002572	索菲亚	540,106.00	6.40
277	601012	隆基股份	540,066.00	6.39
278	000792	盐湖股份	539,182.00	6.38
279	002203	海亮股份	535,953.00	6.35
280	002668	奥马电器	530,325.60	6.28
281	002680	长生生物	528,157.00	6.25
282	600348	阳泉煤业	525,625.31	6.22
283	600572	康恩贝	523,510.50	6.20

284	002237	恒邦股份	517,955.00	6.13
285	002597	金禾实业	515,931.68	6.11
286	601929	吉视传媒	515,424.00	6.10
287	300070	碧水源	508,907.00	6.03
288	000848	承德露露	505,094.00	5.98
289	000881	中广核技	503,809.00	5.97
290	601222	林洋能源	502,745.00	5.95
291	002465	海格通信	500,886.00	5.93
292	002478	常宝股份	498,395.00	5.90
293	000915	山大华特	496,693.50	5.88
294	002460	赣锋锂业	495,095.00	5.86
295	603993	洛阳钼业	493,290.00	5.84
296	002573	清新环境	485,090.00	5.74
297	002749	国光股份	482,747.00	5.72
298	002396	星网锐捷	481,913.49	5.71
299	600323	瀚蓝环境	481,605.00	5.70
300	002562	兄弟科技	479,937.04	5.68
301	600782	新钢股份	479,689.00	5.68
302	601801	皖新传媒	479,157.00	5.67
303	002292	奥飞娱乐	476,176.00	5.64
304	600507	方大特钢	470,727.00	5.57
305	601333	广深铁路	469,403.00	5.56
306	000883	湖北能源	469,042.00	5.55
307	600997	开滦股份	467,640.00	5.54
308	603179	新泉股份	467,375.00	5.53
309	002674	兴业科技	464,438.00	5.50
310	601139	深圳燃气	462,949.60	5.48
311	600312	平高电气	461,270.00	5.46
312	601100	恒立液压	458,081.44	5.42
313	002479	富春环保	454,457.00	5.38
314	002094	青岛金王	450,340.00	5.33
315	600995	文山电力	449,682.00	5.32
316	600637	东方明珠	449,505.00	5.32
317	600884	杉杉股份	444,006.00	5.26
318	002405	四维图新	441,524.00	5.23
319	002061	浙江交科	440,784.00	5.22
320	300310	宜通世纪	435,667.06	5.16
321	300335	迪森股份	435,578.00	5.16

322	300365	恒华科技	433,325.00	5.13
323	000703	恒逸石化	430,056.00	5.09
324	002120	韵达股份	425,386.00	5.04
325	600971	恒源煤电	421,582.15	4.99
326	002145	中核钛白	420,177.00	4.98
327	002136	安纳达	418,072.00	4.95
328	603599	广信股份	411,409.00	4.87
329	600697	欧亚集团	408,638.00	4.84
330	300286	安科瑞	404,883.00	4.79
331	002677	浙江美大	402,988.00	4.77
332	600827	百联股份	398,527.00	4.72
333	600438	通威股份	393,585.00	4.66
334	600668	尖峰集团	393,579.00	4.66
335	002247	帝龙文化	393,412.00	4.66
336	300124	汇川技术	392,953.00	4.65
337	600282	南钢股份	391,152.00	4.63
338	600859	王府井	388,925.00	4.61
339	000598	兴蓉环境	388,792.00	4.60
340	600054	黄山旅游	387,288.00	4.59
341	600705	中航资本	384,912.00	4.56
342	600231	凌钢股份	379,642.00	4.50
343	600388	龙净环保	378,175.00	4.48
344	002335	科华恒盛	376,499.00	4.46
345	600229	城市传媒	374,258.00	4.43
346	603338	浙江鼎力	372,166.00	4.41
347	002440	闰土股份	371,939.00	4.40
348	300144	宋城演艺	365,825.00	4.33
349	000022	深赤湾 A	361,581.00	4.28
350	000547	航天发展	357,055.00	4.23
351	002712	思美传媒	354,197.00	4.19
352	600004	白云机场	352,790.00	4.18
353	600160	巨化股份	351,256.00	4.16
354	000786	北新建材	351,067.00	4.16
355	601127	小康股份	347,901.00	4.12
356	600596	新安股份	344,241.00	4.08
357	002195	二三四五	344,147.00	4.07
358	600760	中航黑豹	340,797.00	4.04
359	300342	天银机电	340,327.00	4.03

360	300699	光威复材	338,149.44	4.00
361	600298	安琪酵母	335,122.00	3.97
362	000976	华铁股份	333,695.00	3.95
363	603111	康尼机电	332,354.00	3.94
364	600482	中国动力	332,230.00	3.93
365	603019	中科曙光	328,591.00	3.89
366	600548	深高速	327,796.00	3.88
367	002111	威海广泰	322,240.00	3.82
368	002033	丽江旅游	320,824.00	3.80
369	002366	台海核电	320,785.00	3.80
370	000543	皖能电力	317,204.00	3.76
371	002179	中航光电	315,359.00	3.73
372	600270	外运发展	314,138.00	3.72
373	300032	金龙机电	311,494.00	3.69
374	000429	粤高速 A	309,841.00	3.67
375	300182	捷成股份	309,836.00	3.67
376	000761	本钢板材	309,388.00	3.66
377	300031	宝通科技	309,204.00	3.66
378	300219	鸿利智汇	308,804.00	3.66
379	600879	航天电子	308,113.00	3.65
380	002402	和而泰	306,888.00	3.63
381	600761	安徽合力	306,790.00	3.63
382	600967	内蒙一机	306,580.00	3.63
383	002477	雏鹰农牧	306,215.00	3.63
384	000738	航发控制	305,317.00	3.62
385	600528	中铁工业	302,017.00	3.58
386	002746	仙坛股份	301,903.00	3.57
387	000778	新兴铸管	300,957.00	3.56
388	601636	旗滨集团	300,582.00	3.56
389	000759	中百集团	299,404.00	3.55
390	603556	海兴电力	298,336.00	3.53
391	000998	隆平高科	296,084.00	3.51
392	002026	山东威达	294,405.00	3.49
393	000501	鄂武商 A	291,795.40	3.46
394	300193	佳士科技	291,489.00	3.45
395	002354	天神娱乐	285,708.00	3.38
396	000530	大冷股份	284,096.40	3.36
397	002187	广百股份	279,496.00	3.31

398	002434	万里扬	277,980.00	3.29
399	002124	天邦股份	277,747.00	3.29
400	002714	牧原股份	275,121.00	3.26
401	002640	跨境通	273,844.00	3.24
402	002042	华孚时尚	269,203.38	3.19
403	002041	登海种业	265,200.00	3.14
404	600537	亿晶光电	263,329.00	3.12
405	002018	华信国际	252,224.00	2.99
406	002916	深南电路	243,292.40	2.88
407	603188	亚邦股份	239,198.00	2.83
408	002496	辉丰股份	231,329.00	2.74
409	000936	华西股份	230,908.00	2.73
410	000726	鲁泰 A	222,172.00	2.63
411	600612	老凤祥	221,322.00	2.62
412	000890	法尔胜	217,538.00	2.58
413	002191	劲嘉股份	201,877.00	2.39
414	601952	苏垦农发	200,895.00	2.38
415	300676	华大基因	197,630.00	2.34
416	601108	财通证券	196,950.60	2.33
417	603260	合盛硅业	192,320.00	2.28
418	601326	秦港股份	190,700.51	2.26
419	601878	浙商证券	183,727.81	2.18
420	002790	瑞尔特	180,235.00	2.13

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。

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	516,734,476.73
卖出股票收入（成交）总额	550,555,128.47

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。

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

本基金于本报告期内未持有国债期货。

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	106,465.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,046.80
5	应收申购款	3,932,091.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,042,603.34

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

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	300104	乐视网	687,604.00	8.14	停牌
2	600332	白云山	597,276.00	7.07	停牌
3	002739	万达电影	583,057.00	6.90	停牌
4	600150	中国船舶	305,689.00	3.62	停牌
5	603161	科华控股	20,753.25	0.25	新股锁定

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
386	18,948.20	5,696,165.97	77.88%	1,617,839.97	22.12%

注：1. “持有人户数”合计数小于各份额级别持有人户数的总和，是由于一个持有人同时持有多
个级别基金份额；

2. 分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用
各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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 3 月 21 日 ）基金份额总额	200,520,789.91
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	159,714,627.94
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	352,921,411.91
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	7,314,005.94

§ 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	

中信证券	2470,314,255.84	44.23%	202,846.90	37.34%	-
西部证券	2310,687,560.42	29.22%	133,999.98	24.66%	-
信达证券	2282,304,736.23	26.55%	206,448.50	38.00%	-

注：1. 基金租用席位的选择标准是：（1）资质雄厚，信誉良好；（2）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；（3）经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；（4）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；（5）公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。选择程序是：根据对各券商提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合席位券商标准的，由公司研究部提出席位券商的调整意见（调整名单及调整原因），并经公司批准。

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
中信证券	-	-	100,000,000.00	3.92%	-	-
西部证券	-	-	1,530,000,000.00	60.00%	-	-
信达证券	12,965.12	100.00%	920,000,000.00	36.08%	-	-

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	《中国证券报》、《证	2017 年 1 月 25 日

	等比例增加注册资本及修改公司章程事项的公告	券时报》、《证券日报》、《上海证券报》、本基金管理人网站	
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》、本基金管理人网站	2017 年 3 月 28 日

§ 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	-	3,016,165.97	-	3,016,165.97	41.24%
	2	1-3 个月	-	2,680,000.00	-	2,680,000.00	36.64%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金为混合型基金，其主要风险包括但不限于：股票价格波动风险、信用风险、流动性风险等。							

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