

西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金
证券投资基金（原西部利得久安回报灵
活配置混合型证券投资基金基金转型）
2018 年年度报告

2018 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：二〇一九年三月二十八日

§ 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 2019 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2018 年 1 月 1 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	6
2.1 基金基本情况（转型后）	6
2.1 基金基本情况（转型前）	6
2.2 基金产品说明（转型后）	6
2.2 基金产品说明（转型前）	10
2.3 基金管理人和基金托管人	11
2.4 信息披露方式	12
2.5 其他相关资料	12
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	13
3.1 主要会计数据和财务指标	13
3.2 基金净值表现（转型后）	14
3.2 基金净值表现（转型前）	18
3.3 过去三年基金的利润分配情况	20
§4 管理人报告	22
4.1 基金管理人及基金经理情况	22
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	23
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	23
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	24
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	25
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	26
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	26
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	27
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	27
§5 托管人报告	28
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	28
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	28
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	28
§6 审计报告（转型后）	29
6.1 审计报告基本信息	29
6.2 审计报告的基本内容	29
§6 审计报告（转型前）	32
6.1 审计报告基本信息	32
6.2 审计报告的基本内容	32
§7 年度财务报表（转型后）	35
7.1 资产负债表（转型后）	35
7.2 利润表	36
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	37
7.4 报表附注	38
§7 年度财务报表（转型前）	59
7.1 资产负债表（转型前）	59

7.2 利润表.....	60
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	61
7.4 报表附注.....	62
§8 投资组合报告（转型后）.....	84
8.1 期末基金资产组合情况.....	84
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	84
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.....	86
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	89
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	90
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.....	90
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	90
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.....	90
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.....	91
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	91
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	91
8.12 投资组合报告附注.....	91
§8 投资组合报告（转型前）.....	93
8.1 期末基金资产组合情况.....	93
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	93
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.....	94
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	97
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	113
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.....	113
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	113
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.....	113
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.....	113
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	113
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	114
8.12 投资组合报告附注.....	114
§9 基金份额持有人信息（转型后）.....	116
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	116
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	116
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.....	117
§9 基金份额持有人信息（转型前）.....	118
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	118
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	118
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.....	118
§10 开放式基金份额变动(转型后).....	119
§10 开放式基金份额变动(转型前).....	120
§11 重大事件揭示.....	121
11.1 基金份额持有人大会决议.....	121
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.....	121
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	121
11.4 基金投资策略的改变.....	121
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	121

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	121
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）	121
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）	122
11.9 其他重大事件（转型后）	123
11.9 其他重大事件（转型前）	123
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	124
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	124
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	124
§13 备查文件目录.....	125
13.1 备查文件目录	125
13.2 存放地点	125
13.3 查阅方式	125

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金	
基金简称	西部利得沪深 300 指数	
场内简称	—	
基金主代码	673100	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 12 月 27 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	18,506,294.50 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	西部利得沪深 300 指数 A	西部利得沪深 300 指数 C
下属分级基金的场内简称	—	—
下属分级基金的交易代码	673100	673101
下属分级基金的前端交易代码	—	—
下属分级基金的后端交易代码	—	—
报告期末下属分级基金的份额总额	18,506,294.50 份	0.00 份

2.1 基金基本情况（转型前）

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	18,506,542.92 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（转型后）

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效
------	----------------------------

	跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金以沪深 300 指数为标的指数，在有效复制标的指数、控制投资组合与业绩比较基准跟踪误差的基础上，结合“自下而上”的选股方式对投资组合进行积极的管理与风险控制，力争获得超越业绩比较基准的收益。 当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。但因特殊情况（比如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等）导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法（如买入非成份股等）进行适当的替代。本基金可以将标的指数成份股及备选股之外的股票纳入基金股票池，并构建主动型投资组合。 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，通过对宏观经济、微观经济运行态势、政策环境、利率走势、证券市场走势及证券市场现阶段的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，实现投资组合动态管理最优化。 2、股票投资策略 本基金采取指数复制结合相对增强的投资策略，在严格控制偏离度和跟踪误差的前提下进行相对增强的投资管理。 （1）指数复制策略 本策略采取全样本复制的方式，按照标的指数的成份股及其权重构建跟踪组合。 1）被动型投资组合的构建 基金管理人将根据标的指数的成份股和备选股及其权重进行相应的买卖操作，使得被动型投资组合的构建与标的指数基本一致。若出现较为特殊的情况（例如成份股或备选成份股流动性不足等），本基金将采用替代性的方法构建被动型投资组合，使得被动型投资组合尽可能跟踪标的指数，减小跟踪误差。 2）被动型投资组合的调整 本基金为开放式基金，由于开放日基金的申购、赎回、转换等业务对标的指数跟踪带来的影响，标的指数成份股及备选成份股的定期或不定期调整以及相应权重的调整等影响，使得被动型投资组合需要适时进行个股或权重的调整。 3）风险估测模型 指数化投资力求跟踪误差最小，主动性投资则需要适度风险预算的支持。风险预算即最大容忍跟踪误差。本基金将结合市场通用及自主研发的风险估测模型，将投资组合风险有效

	控制在预算范围内。 本基金采取“跟踪误差”和“跟踪偏离度”这两个指标对投资组合进行监控与评估。其中，跟踪误差为核心监控指标，跟踪偏离度为辅助监控指标，以求控制投资组合相对于标的指数的偏离风险。 本基金对标的指数的跟踪目标是力争使基金份额净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8%。 (2) 指数增强策略 本策略以国际市场上广泛认可的多因子模型框架为基础，结合中国股票市场的特定规律筛选有效因子，对因子进行多角度评价后构建多因子模型，并根据市场流动性、基金规模、因子衰减速度等因素进行组合优化，构建股票投资组合。 1) 筛选有效因子 通过对投资理论的理解，对中国市场特定规律的研究，本基金管理人从市场可获得的公开大数据中寻找出对股票收益率有预测能力的因子，经过全面且深入的因子剖析后提炼出可靠因子，以期在未来能够形成对股票优劣的区分能力。随着市场的变化，有预测能力的因子也在动态变化。因子来源包括研究员预期，市值，技术面，成长，估值。 ●研究员预期 根据研究员对上市公司未来盈利估算以及股票表现评价构成因子。 ●市值 根据上市公司的总市值进行筛选。 ●技术面 根据股票的量价信息构成因子，包括股票累计收益率，股票收益率偏度，股票相对于指数协同度等。 ●成长 根据上市公司公告的财报、业绩快报、业绩预告计算其净利润同比增长率以刻画其成长性。 ●估值 根据市净率 P/B、市盈率 P/E、股息率 D/P、市销率 P/S 等指标衡量股票目前估值水平。 2) 因子评价 每一个因子都代表了一种选股逻辑。因子评价体系通过一系列量化指标深入理解因子性质及适用的市场环境。其中包括因子组合表现，因子流动性溢价，因子稳定系数，因子衰减速度等。因子评价结果是确定因子权重的重要依据。 ●因子组合表现 利用因子分值构建多空组合，该组合称之为因子组合。因子组合的风险因子敞口为零。以因子组合表现的稳定程度衡量该因子的区分能力。 ●因子流动性溢价 因子有效性可能来源于其对流动性的补偿，即低流动性股票
--	---

	在未来有较高收益的现象。在较大规模的基金管理前提下需控制因子流动性溢价。 ●因子稳定系数 因子稳定系数衡量因子评分的稳定程度，因子较高的稳定性意味着投资组合的低换手率。 ●因子衰减速度 每一期因子评分的因子区分度会随着时间的推移而衰减，通过研究因子衰减速度可以衡量因子有效期，并配合恰当的换仓频率。因子衰减速度较快会导致很高的换手率，应当规避。 3) 多因子汇总 基金管理人根据优化算法确定因子权重基准，再根据对市场环境的判断，基金规模，市场流动性等进行微调。多因子根据因子权重进行叠加后形成对每只股票的总体评分，以此对股票的优劣进行判断。 4) 构建投资组合 首先根据业绩基准指数中的股票指数进行行业配置，以对跟踪误差形成约束，再利用多因子评分以及量化优化算法确定个股权重。参考市场流动性、基金规模、因子衰减速度等因素后找到最为合适的换仓频率，每隔一段时间对投资组合进行重新构建。 3、债券投资策略 本基金可投资于国债、金融债、央行票据、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、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。 4、股指期货投资策略 在股指期货投资上，本基金以避险保值和有效管理为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。 5、同业存单投资策略 本基金根据对存单发行银行的信用资质和存单流动性进行分析，严控信用风险底线的前提下，根据信用资质、流动性、收益率的综合考虑，选择具有良好投资价值的存单品种进行投资。信用资质分析，采用外部评级机构和内部评级相结合的方式，对信用风险进行审慎甄别。 6、融资及转融通证券出借业务投资策略 本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。参与
--	---

	融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。参与转融通证券出借业务时，本基金将从基金持有的融券标的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通出借交易对象，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。	
业绩比较基准	本基金的标的指数为：沪深 300 指数。 本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*95%+商业银行活期存款利率（税后）*5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。 本基金为指数型基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。	
	西部利得沪深 300 指数 A	西部利得沪深 300 指数 C
下属分级基金的风险收益特征	-	-

2.2 基金产品说明（转型前）

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	本基金投资策略由自上而下的资产配置计划和自下而上的单个证券选择计划组成。根据对宏观经济趋势、国家宏观政策趋势、行业及企业盈利和信用状况、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	李帅帅
	联系电话	021-38572888	0755-25878287
	电子邮箱	service@westleadfund.com	LISHUAISHUAI130@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		刘建武	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	《中国证券报》
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

转型后

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	
	西部利得沪深 300 指数 A	西部利得沪深 300 指数 C
本期已实现收益	-7,582.95	-
本期利润	26,504.25	-
加权平均基金份额本期利润	0.0014	-
本期加权平均净值利润率	0.15%	-
本期基金份额净值增长率	0.15%	-
3.1.2 期末数据和指标	2018 年 12 月 31 日	
期末可供分配利润	-1,294,823.84	-
期末可供分配基金份额利润	-0.0700	-
期末基金资产净值	17,211,470.66	-
期末基金份额净值	0.9300	-
3.1.3 累计期末指标	2018 年 12 月 31 日	
基金份额累计净值增长率	0.15%	-

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）。

转型前

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 26 日	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-7,308,726.86	40,713,876.55	-
本期利润	-7,013,069.02	38,850,397.55	-
加权平均基金份额本期利润	-0.2266	0.2269	-
本期加权平均净值利润率	-21.43%	20.65%	-
本期基金份额净值增长率	-19.58%	28.07%	-
3.1.2 期末数据和指标	2018 年 12 月 26 日	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	-1,321,345.48	1,131,398.68	-
期末可供分配基金份额利润	-0.0714	0.1547	-
期末基金资产净值	17,185,197.44	8,445,404.62	-

期末基金份额净值	0.9286	1.1547	-
3.1.3 累计期末指标	2018 年 12 月 26 日	2017 年末	2016 年末
基金份额累计净值增长率	2.99%	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）。

3.2 基金净值表现（转型后）

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

西部利得沪深 300 指数 A

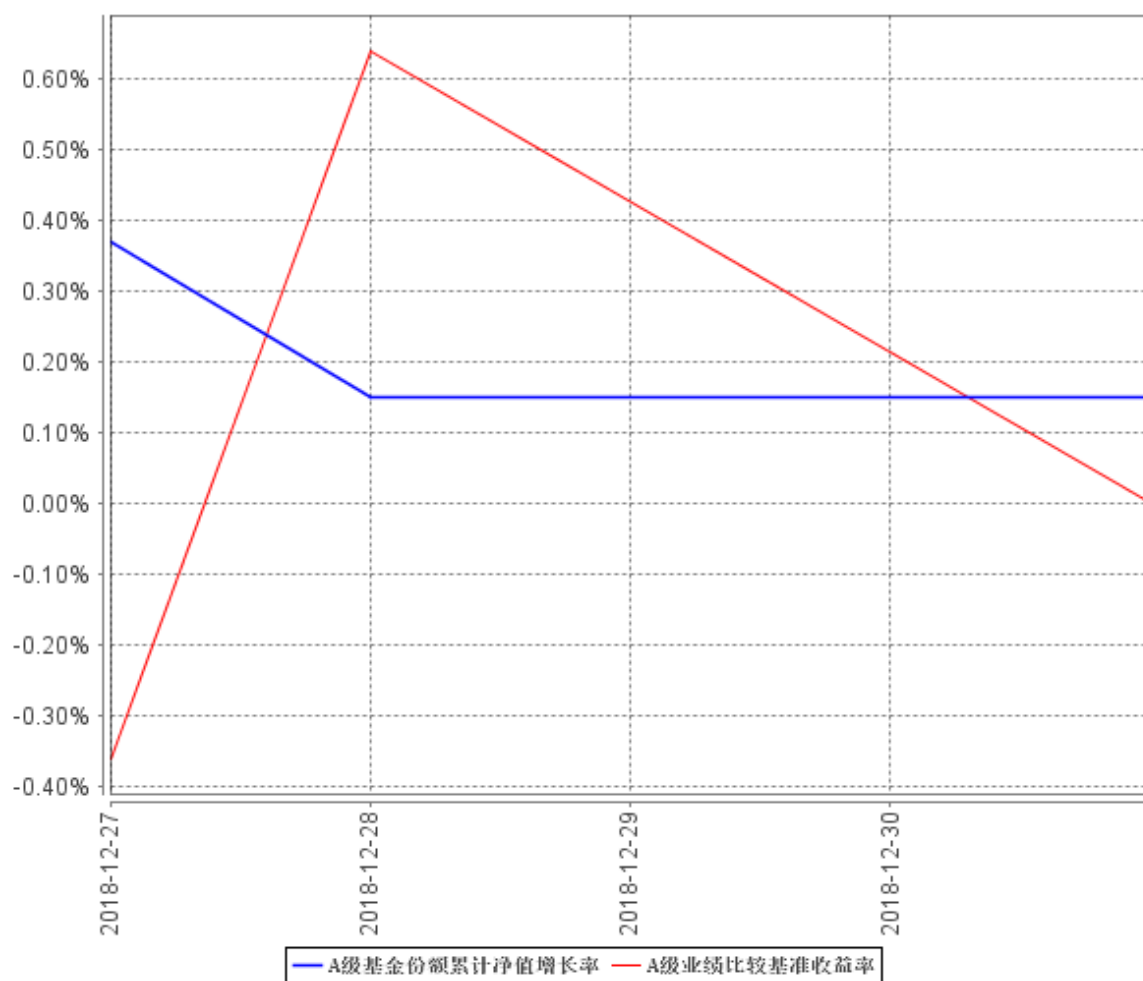
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
自基金合同 生效起至今	0.15%	0.46%	0.27%	0.51%	-0.12%	-0.05%

西部利得沪深 300 指数 C

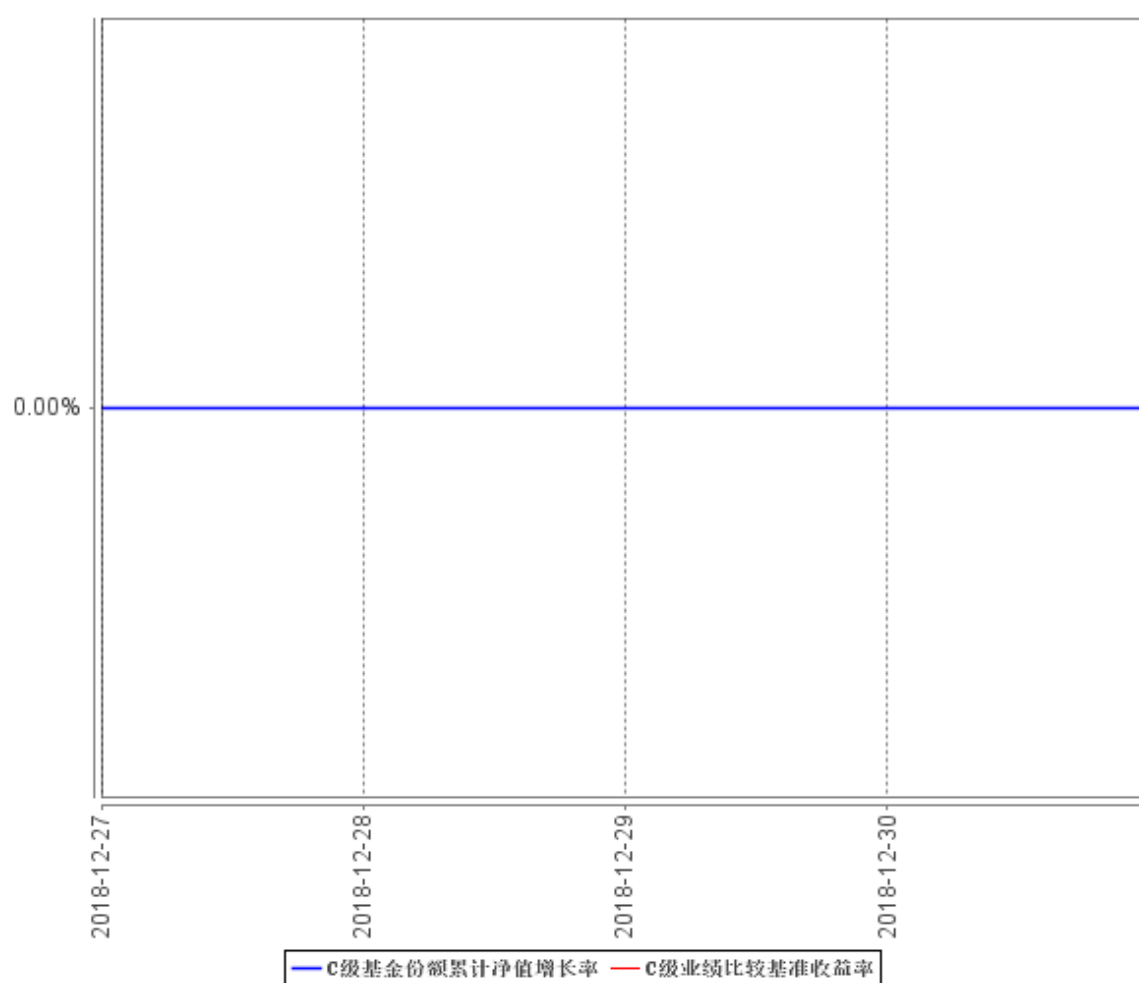
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
自基金合同 生效起至今	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%

3.2.2 自基金转型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

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



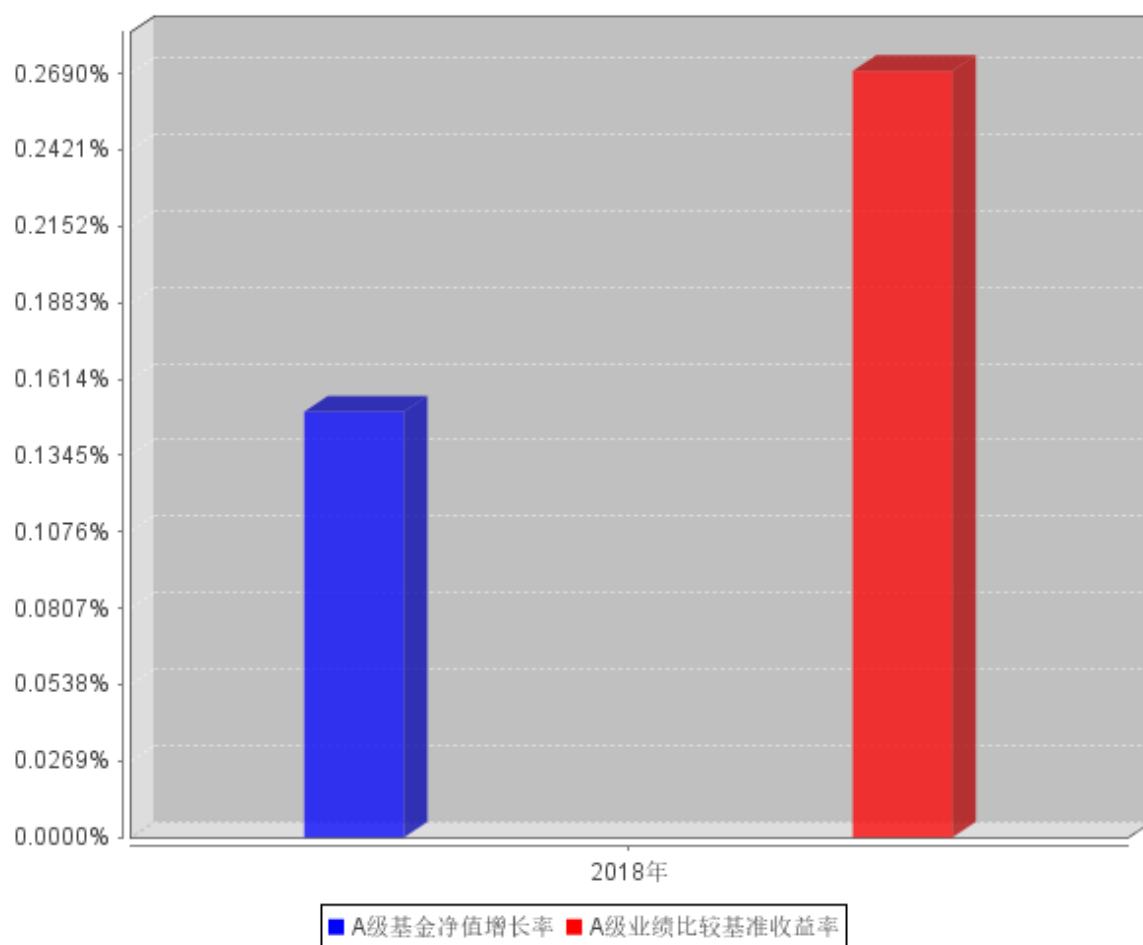
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



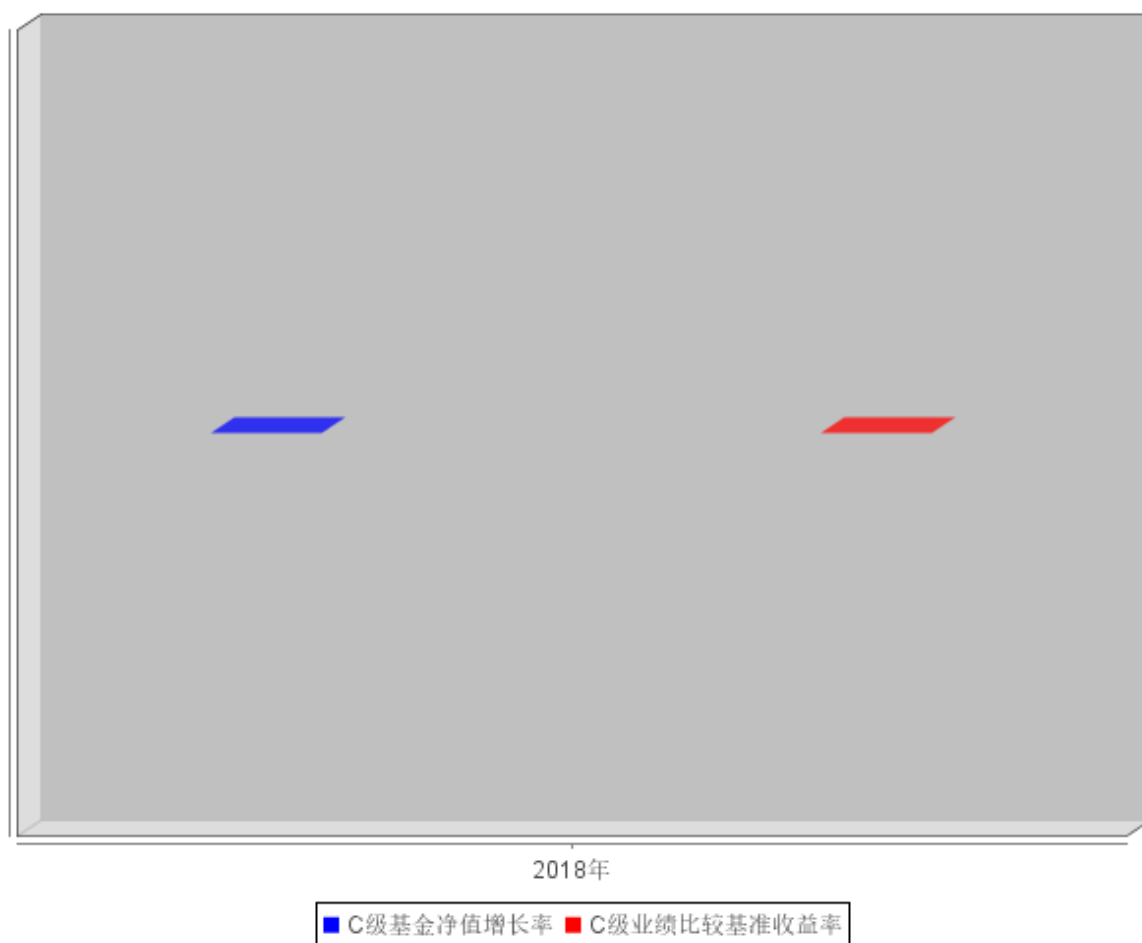
本基金于 2018 年 12 月 27 日转型，截至 2018 年 12 月 31 日，基金合同生效未满一年。

3.2.3 自基金转型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

A级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



C级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



注：1. 本基金于 2018 年 12 月 27 日转型，截至报告期末，基金运作未满五年。

2. 本基金基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

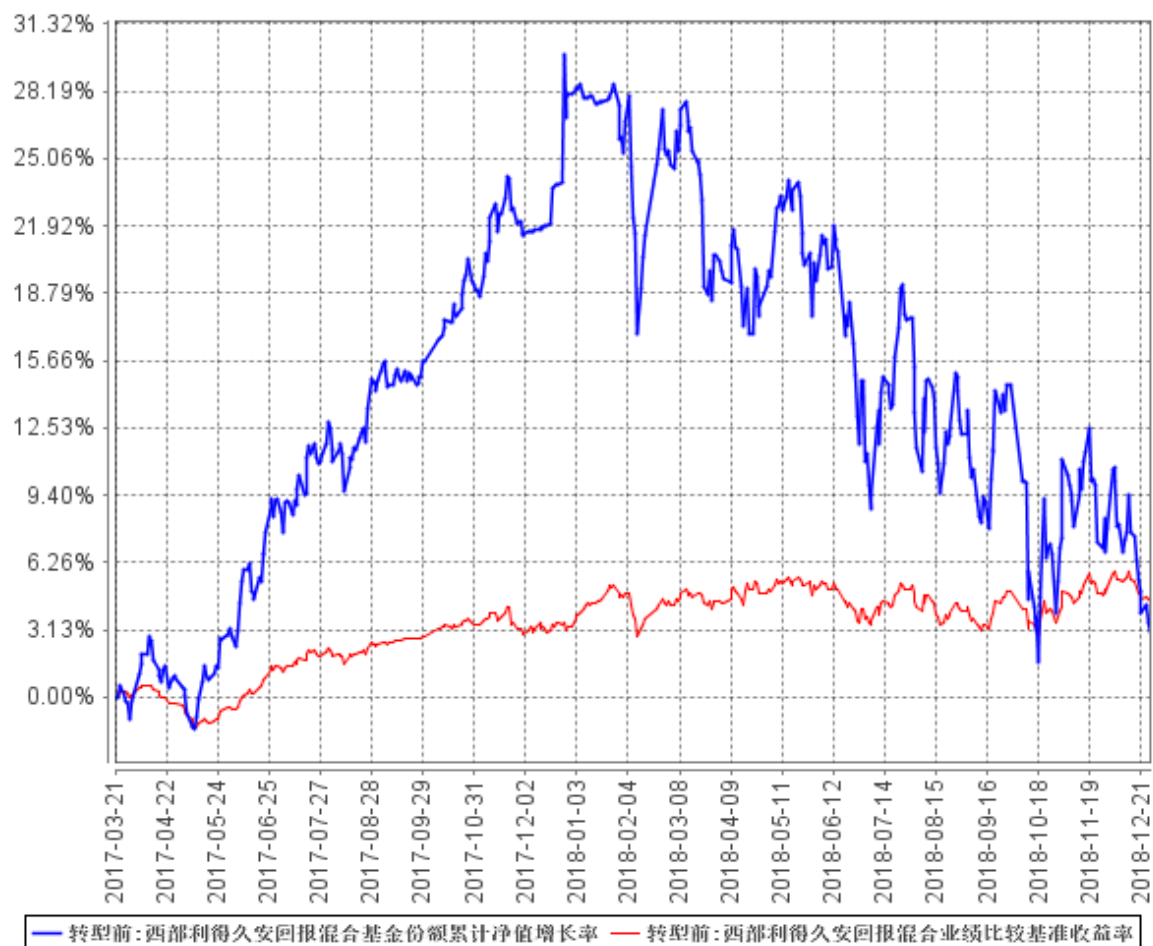
3.2 基金净值表现（转型前）

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	-10.08%	1.62%	-0.44%	0.33%	-9.64%	1.29%
过去六个月	-10.25%	1.46%	0.32%	0.30%	-10.57%	1.16%
过去一年	-19.58%	1.28%	1.10%	0.27%	-20.68%	1.01%
自基金合同生效起至今	2.99%	1.05%	4.46%	0.22%	-1.47%	0.83%

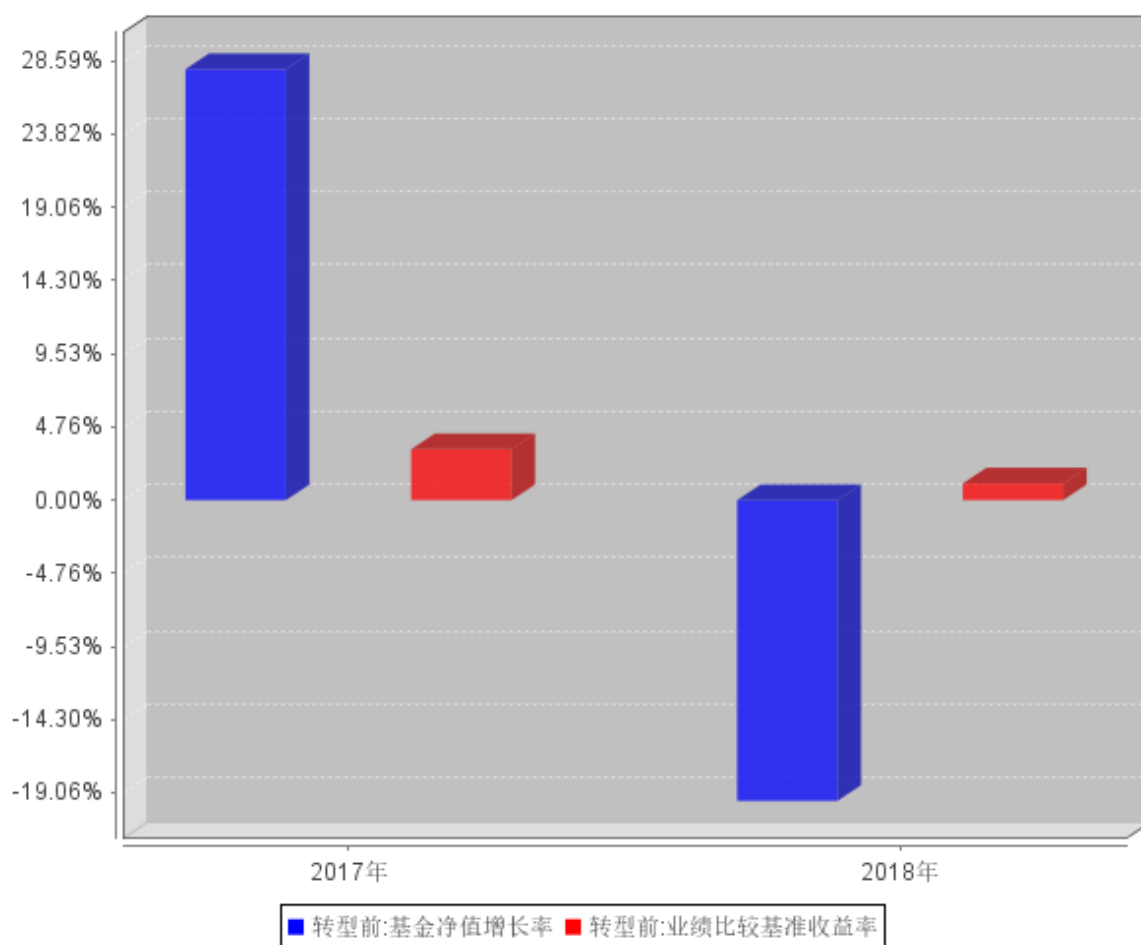
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

西部利得久安回报混合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 过去五年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



注：1. 本基金的基金合同于 2017 年 3 月 21 日生效，截至报告期末，基金运作未满五年。

2. 本基金基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

转型前

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
2018	-	-	-	-	
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	

转型后

单位：人民币元

西部利得沪深 300 指数 A					
年度	每10份基金	现金形式发放总额	再投资形式发放	年度利润分配合	备注

	份额分红数		总额	计	
合计	-	-	-	-	

单位：人民币元

西部利得沪深 300 指数 C					
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
合计	-	-	-	-	

本基金合同生效日为 2018 年 12 月 27 日，截至 2018 年 12 月 31 日未进行过利润分配。

§ 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2018年12月31日，西部利得基金共管理二十九只开放式基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

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		
盛丰衍	本基金基金经理	2018年1月26日	—	5年	复旦大学理学硕士，曾任光大证券股份有限公司权益投资助理、上海光大证券资产管理有限公司研究员、兴证证券资产管理有限公司量化研究员。2016年10月加入本公司，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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
盛丰衍	本基金基金经理	2018年1月26日	—	5年	复旦大学理学硕士，曾任光大证券股份有限公司权益投资助理、上海光大证券资产管理有限公司研究员、兴证证券资产管理有限公司量化研究员。2016年10月加入本公司，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

回顾 2018 年，A 股主要宽基指数均受国内经济下滑和中美摩擦而大幅下跌，估值接近历史底部。市场风格继续延续了 2017 年业绩为王的价值投资理念，部分中小股票的虚高估值进一步挤压。

投资策略上，本基金始终维持较高股票仓位，风格偏蓝筹，行业配置参考沪深 300 指数。选股使用多因子量化模型，通过统计方法寻找高收益股票的特征，以此作为因子优选股票构成组合。因子主要包括低估值、高成长以及技术面因子。选股限制在卖方分析师覆盖的股票范围内，同时规避量价指标上显示出超买的个股以及临近解禁的个股，股票数量约在 110 只~150 只，以此弱化

个股黑天鹅的影响。本基金努力通过选股获得相对于沪深 300 指数的超额收益，在接下去的投资管理中会坚持类似的投资风格。

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，努力为持有人带来优异回报。

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 2019 年，三股正向力量将托底指数，两股不确定力量将扰动指数，预计 A 股指数震荡上行。

正向力量其一是持续流入的外资。宏观上看 A 股与国外资产相关系数并不高，并且国际资本明显低配中国资产，随着政策持续开放，中国资产对于国际投资者越发具有吸引力。A 股逐步入摩和入富，外资投资 A 股的比例将逐年提升。中国是世界上政治最为稳定的国家之一，拥有世界上最多的外汇储备，拥有人类历史上最大规模的制造业，拥有最大体量的消费市场，这都是中国资产价值所在。世界增持中国，正在路上。

正向力量其二是国内居民大类资产配置将出现拐点，长期增配股票。房地产政策调控还原其居住属性、消弱其金融属性，地产可投资性下降；P2P 等保本保息高收益产品风险凸显，风险事件频发，这将降低居民对此类资产的风险偏好；国内居民大类资产配置将逐步流入股市；

正向力量其三是改革将持续释放红利。中国经济正从高速发展向高质量发展切换，中国制造将逐步升级为中国智造和中国创造。中国特色社会主义市场经济和加入 WTO 拥抱世界的成功改革都曾历经坎坷和波折，如今的改革也是砥砺前行。中国深化改革的成果终将逐步提升市场风险偏好。

扰动因子其一是中美摩擦。2018 年中美摩擦从贸易战开始逐步升温和扩散，市场风险偏好随之大幅下降。预计在 2019 年的上半年中美摩擦将反复扰动指数，而随着美国经济由盛转衰，摩擦对美国的负面影响也将更为明显，中美之间摩擦将随之降温。

扰动因子其二是经济 and 政策的博弈。2019 年中国实体经济将继续下行，而以中央加杠杆为主的政策利好作为对冲项持续发力，两股力量阶段性的强弱会影响股市。

目前 A 股非金融股的市盈率以及金融股市净率均处于历史底部区域。长期看未来 A 股机构化进程加速，价值投资将更为深入人心，无论已成为龙头的价值蓝筹还是成长股均是上市公司内在价值的体现，两者均会有一定表现。

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

截止本报告期末，本基金已触发连续 60 日以上基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

§ 6 审计报告（转型后）

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 1900120 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	西部利得沪深 300 指数增强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 33 页的西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金（以下简称“西部利得沪深 300 基金”）财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表、自 2018 年 12 月 27 日（基金合同生效日）至 2018 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 7.4.2 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沪深 300 基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2018 年 12 月 27 日（基金合同生效日）至 2018 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沪深 300 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	西部利得沪深 300 基金管理人西部利得基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）对其他信息负责。其他信息包括西部利得沪深 300 基金 2018 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	基金管理人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，基金管理人管理层负责评估西部利得沪深 300 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，除非西部利得沪深 300 基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督西部利得沪深 300 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) 评价基金管理人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) 对基金管理人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沪深 300 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沪深 300 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。 我们与基金管理人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	2019 年 3 月 27 日	

§ 6 审计报告（转型前）

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 1900113 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 37 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 2018 年 12 月 26 日（基金合同失效前日）的资产负债表、自 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 26 日（基金合同失效前日）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 7.4.2 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 2018 年 12 月 26 日（基金合同失效前日）的财务状况以及自 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 26 日（基金合同失效前日）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（以下简称“基金管理人”）对其他信息负责。其他信息包括西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金（转型后基金）2018 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	基金管理人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，基金管理人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。 基金管理人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	基金管理人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，基金管理人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。 基金管理人治理层负责监督西部利得久安回报基金的财务报告过程。 我们与基金管理人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	2019 年 3 月 27 日
--------	-----------------

§ 7 年度财务报表（转型后）

7.1 资产负债表（转型后）

会计主体：西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	1,069,512.33
结算备付金		18,878.12
存出保证金		26,779.20
交易性金融资产	7.4.7.2	16,182,630.00
其中：股票投资		16,182,630.00
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		35,166.21
应收利息	7.4.7.5	589.26
应收股利		-
应收申购款		99.52
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		17,333,654.64
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 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		328.09
应付管理人报酬		12,094.71
应付托管费		2,267.74
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	15,493.42
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	92,000.02
负债合计		122,183.98
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	18,506,294.50
未分配利润	7.4.7.10	-1,294,823.84
所有者权益合计		17,211,470.66
负债和所有者权益总计		17,333,654.64

注：1. 报告截止日 2018 年 12 月 31 日，西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金 A 类份额净值 0.9300 元，A 类份额总额 18,506,294.50 份，暂无 C 类份额。

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 2018 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2018 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		27,126.32
1. 利息收入		264.20
其中：存款利息收入	7.4.7.11	264.20
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-7,227.52
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-7,144.00
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
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	-83.52
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	34,087.20
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	2.44
减：二、费用		622.07
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,883.60
2. 托管费	7.4.10.2.2	353.16
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	367.57
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	7.4.7.20	-1,982.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		26,504.25
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		26,504.25

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：西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2018 年 12 月 27 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 12 月 27 日（基金合同生效日）至 2018 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）	18,506,542.92	-1,321,345.48	17,185,197.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	26,504.25	26,504.25
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）	-248.42	17.39	-231.03
其中：1. 基金申购款	107.58	-8.06	99.52
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-356.00	25.45	-330.55
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）	18,506,294.50	-1,294,823.84	17,211,470.66

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

西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金(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”)证监许可[2016]2113 号批复核准,由西部利得基金管理有限公司依照《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》、本基金《基金合同》、《招募说明书》等相关法律文件负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2.00 亿元,业经毕马威华振会计师事务所出具验资报告予以验证。经向中国证监会备案,本基金《基金合同》于 2017 年 3 月 21 日正式生效。本基金的基金管理人为西部利得基金管理有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司。

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 2019 年 3 月 28 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》、《纽银策略优选股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

(1) 主要税项说明

根据财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营基金过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。

(e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	1,069,512.33
定期存款	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
合计：	1,069,512.33

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 2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	估值增值

股票		17,716,363.96	16,182,630.00	-1,533,733.96
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		17,716,363.96	16,182,630.00	-1,533,733.96

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末及上年度期末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末及上年度期末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	564.80
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	9.35
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	1.80
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	13.31
合计	589.26

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末及上年度期末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	15,493.42
银行间市场应付交易费用	-
合计	15,493.42

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 2018 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.02
预提费用	92,000.00
合计	92,000.02

注：本基金在本报告期成立，无上年度可比数据。

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

西部利得沪深 300 指数 A		
项目	本期 2018 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	18,506,542.92	18,506,542.92
基金份额折算调整	-	-
未领取红利份额折算调整	-	-
集中申购募集资金本金及利息	-	-
基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	107.58	107.58
本期赎回(以“-”号填列)	-356.00	-356.00
本期末	18,506,294.50	18,506,294.50

金额单位：人民币元

西部利得沪深 300 指数 C		
项目	本期 2018 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
基金份额折算调整	-	-
未领取红利份额折算调整	-	-
集中申购募集资金本金及利息	-	-
基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	-	-

本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	-	-

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

金额单位：人民币元

西部利得沪深 300 指数 A			
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	158,304.92	-1,479,650.40	-1,321,345.48
本期利润	-7,582.95	34,087.20	26,504.25
本期基金份额交易产生的变动数	-2.13	19.52	17.39
其中：基金申购款	0.92	-8.98	-8.06
基金赎回款	-3.05	28.50	25.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	150,719.84	-1,445,543.68	-1,294,823.84

金额单位：人民币元

西部利得沪深 300 指数 C			
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	-	-	-
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

项目	本期 2018 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	253.90
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	4.25
其他	6.05
合计	264.20

注：其他为结算保证金利息收入。

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 2018 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	121,408.00
减：卖出股票成本总额	128,552.00
买卖股票差价收入	-7,144.00

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

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

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金于本报告期及上年度可比期间均无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金于本报告期内及上年度期内均未持有资产支持证券。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未持有贵金属。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未持有贵金属。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未持有贵金属。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未持有贵金属。

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可比期间均未持有衍生工具。

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可比期间均未持有衍生工具。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	-83.52
基金投资产生的股利收益	-
合计	-83.52

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 2018 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	34,087.20
——股票投资	34,087.20
——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	34,087.20

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 2018 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	2.44
合计	2.44

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。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	367.57
银行间市场交易费用	-
合计	367.57

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 2018 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
审计费用	-2,805.46
信息披露费	823.20
合计	-1,982.26

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 2018 年 12 月 27 日 (基金合同生效日) 至 2018 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
西部证券	473, 419. 00	100. 00%

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。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金于本报告期内未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年12月27日 (基金合同生效日) 至2018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	204.21	100.00%	15,493.42	100.00%

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 2018 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,883.60
其中:支付销售机构的客户维护费	64.70

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 0.8%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×0.8% / 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 2018 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	353.16

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

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	西部利得沪深 300 指数 A	西部利得沪深 300 指数 C	合计
合计	-	-	-

注：

1. 支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.4% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给 西部利得基金，再由西部利得基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.4% / 当年天数。

2. 本基金于本报告期内及上年度可比期间未发生应支付关联方的销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金管理人于本报告期末未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

西部利得沪深 300 指数 A		
关联方名称	本期末 2018 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2018 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
西部利得-汇通 3 号资产管理计划	15,307,207.23	82.7100%

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 2018 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
平安银行股份有限公司	1,069,512.33	253.90

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金于本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2018 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

本基金于本报告期末未因认购新发/增发而持有流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600030	中信证券	2018 年 12 月 25 日	重要事项未公告	16.01	2019 年 1 月 10 日	17.15	18,400	321,387.51	294,584.00	

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。

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

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只股票型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制。本基金预期风险大于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。

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及绩效评估。

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 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	-------	-----	----

2018 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	1,069,512.33	-	-	-	1,069,512.33
结算备付金	18,878.12	-	-	-	18,878.12
存出保证金	26,779.20	-	-	-	26,779.20
交易性金融资产	-	-	-	16,182,630.00	16,182,630.00
应收证券清算款	-	-	-	35,166.21	35,166.21
应收利息	-	-	-	589.26	589.26
应收申购款	99.52	-	-	-	99.52
资产总计	1,115,269.17	-	-	16,218,385.47	17,333,654.64
负债					
应付赎回款	-	-	-	328.09	328.09
应付管理人报酬	-	-	-	12,094.71	12,094.71
应付托管费	-	-	-	2,267.74	2,267.74
应付交易费用	-	-	-	15,493.42	15,493.42
其他负债	-	-	-	92,000.02	92,000.02
负债总计	-	-	-	122,183.98	122,183.98
利率敏感度缺口	1,115,269.17	-	-	16,096,201.49	17,211,470.66

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
----	-----

	2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	16,182,630.00	94.02
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	16,182,630.00	94.02

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（2018 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	354,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-354,000.00

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 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为 15888046.00 元，属于第二层级的余额为 294584.00 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 2018 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。

§ 7 年度财务报表（转型前）

7.1 资产负债表（转型前）

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：2018 年 12 月 26 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018 年 12 月 26 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	1,199,198.67	2,244,922.03
结算备付金		18,878.12	4,278,308.14
存出保证金		26,779.20	106,465.38
交易性金融资产	7.4.7.2	15,925,083.80	2,194,379.25
其中：股票投资		15,925,083.80	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		167,536.72	-
应收利息	7.4.7.5	325.06	4,046.80
应收股利		-	-
应收申购款		496.03	3,932,091.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		17,338,297.60	12,760,212.76
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 12 月 26 日	上年度末 2017 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		3,189.29	-
应付赎回款		28,466.48	3,901,480.45
应付管理人报酬		10,211.11	61,785.64
应付托管费		1,914.58	11,584.81
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	15,289.21	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	94,029.49	151,357.39
负债合计		153,100.16	4,314,808.14
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	18,506,542.92	7,314,005.94
未分配利润	7.4.7.10	-1,321,345.48	1,131,398.68
所有者权益合计		17,185,197.44	8,445,404.62
负债和所有者权益总计		17,338,297.60	12,760,212.76

注：1. 报告截止日 2018 年 12 月 26 日，西部利得久安回报混合基金份额净值 0.9286 元，基金份额总额 18,506,542.92 份。

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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 26 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 26 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		-6,235,384.43	41,544,060.95
1. 利息收入		101,370.65	686,392.24
其中：存款利息收入	7.4.7.11	82,622.57	326,928.93
债券利息收入		11,232.59	1.99
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,515.49	359,461.32
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-6,893,872.89	41,604,583.23
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-7,394,696.81	37,878,509.99
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-1,440.00	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	502,263.92	3,724,310.11
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	295,657.84	-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	261,459.97	1,116,564.48

减：二、费用		777,684.59	2,693,663.40
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	261,251.93	1,179,015.52
2. 托管费	7.4.10.2.2	48,984.79	221,065.50
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	373,465.61	1,188,182.38
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	93,982.26	105,400.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-7,013,069.02	38,850,397.55
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-7,013,069.02	38,850,397.55

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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 26 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 26 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）	7,314,005.94	1,131,398.68	8,445,404.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-7,013,069.02	-7,013,069.02
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）	11,192,536.98	4,560,324.86	15,752,861.84
其中：1. 基金申购款	68,664,538.23	8,715,608.63	77,380,146.86
2. 基金赎回款	-57,472,001.25	-4,155,283.77	-61,627,285.02
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）	18,506,542.92	-1,321,345.48	17,185,197.44
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 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（基金净值）	7,314,005.94	1,131,398.68	8,445,404.62

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”)证监许可[2016]2113 号批复核准,由西部利得基金管理有限公司依照《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》、本基金《基金合同》、《招募说明书》等相关法律文件负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2.00 亿元,业经毕马威华振会计师事务所出具验资报告予以验证。经向中国证监会备案,本基金《基金合同》于 2017 年 3 月 21 日正式生效。本基金的基金管理人为西部利得基金管理有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司。

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 2019 年 3 月 28 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》、《纽银策略优选股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 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 2018 年 12 月 26 日的财务状况以及 2018 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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

（1）主要税项说明

根据财税〔2004〕78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税〔2012〕85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2015〕101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2005〕103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字〔2008〕16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税〔2008〕1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2016〕36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税〔2016〕140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税〔2017〕2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(b) 自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营基金过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股权登记日为自2013年1月1日起至2015年9月7日期间的，暂减按25%计入应纳税所得额，股权登记日在2015年9月8日及以后的，暂免征收个人所得税。

(e) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 26 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	1,199,198.67	2,244,922.03
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	1,199,198.67	2,244,922.03

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 26 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	17,492,904.96	15,925,083.80	-1,567,821.16
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	17,492,904.96	15,925,083.80	-1,567,821.16
项目	上年度末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	估值增值
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

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末及上年度期末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末及上年度期末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 26 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	310.90	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	5.10	2,117.83
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	1.80	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	7.26	52.69
合计	325.06	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及上年度期末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 26 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	15,289.21	188,599.85
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	15,289.21	188,599.85

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 26 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	47.23	46,357.39
预提费用	93,982.26	105,000.00
合计	94,029.49	151,357.39

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 26 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,314,005.94	7,314,005.94
本期申购	68,664,538.23	68,664,538.23
本期赎回（以“-”号填列）	-57,472,001.25	-57,472,001.25
- 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	18,506,542.92	18,506,542.92

金额单位：人民币元

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
上年度末	1,635,957.07	-504,558.39	1,131,398.68
本期利润	-7,308,726.86	295,657.84	-7,013,069.02
本期基金份额交易产生的变动数	5,831,074.71	-1,270,749.85	4,560,324.86
其中：基金申购款	14,070,788.18	-5,355,179.55	8,715,608.63
基金赎回款	-8,239,713.47	4,084,429.70	-4,155,283.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	158,304.92	-1,479,650.40	-1,321,345.48

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 26 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	65,746.45	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	12,848.19	12,152.03
其他	4,027.93	54,134.97
合计	82,622.57	326,928.93

注：其他包括直销申购款利息收入。

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 26 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	152,056,898.47	550,555,128.47
减：卖出股票成本总额	159,451,595.28	512,676,618.48
买卖股票差价收入	-7,394,696.81	37,878,509.99

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 2018年1月1日至2018年12月26日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	-1,440.00	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	-1,440.00	1,763.13

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 2018年1月1日至2018年 12月26日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	743,976.00	12,965.12
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	721,440.00	11,200.00
减：应收利息总额	23,976.00	1.99
买卖债券差价收入	-1,440.00	1,763.13

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金于本报告期及上年度可比期间均无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金于本报告期及上年度可比期间均无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金于本报告期内及上年度期内均未持有资产支持证券。

7.4.7.14 贵金属投资收益**7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未持有贵金属。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未持有贵金属。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未持有贵金属。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未持有贵金属。

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可比期间均未持有衍生工具。

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可比期间均未持有衍生工具。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 26 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	502,263.92	3,724,310.11
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	502,263.92	3,724,310.11

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 26 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	295,657.84	-1,863,479.00
——股票投资	295,657.84	-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	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	295,657.84	-1,863,479.00

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 26 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	261,440.04	1,116,564.48
转换费收入 673100	19.93	-
合计	261,459.97	1,116,564.48

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。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 26 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	373,465.61	1,188,182.38
银行间市场交易费用	-	-
合计	373,465.61	1,188,182.38

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 26 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
审计费用	34,805.46	45,000.00
信息披露费	59,176.80	60,000.00
其他	-	400.00
合计	93,982.26	105,400.00

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 26 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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	150,082,626.94	46.19%	310,687,560.42	29.22%

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金于本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 26 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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	30,000,000.00	100.00%	1,530,000,000.00	60.00%

7.4.10.1.4 权证交易

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

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 2018年1月1日至2018年12月26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	64,730.78	33.61%	15,289.21	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1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%

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 2018年1月1日至2018年12月26日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	261,251.93	1,179,015.52
其中：支付销售机构的客户维护费 ¹	12,053.53	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 0.8% 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 × 0.8% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月26日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
----	-----------------------------	----------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	48,984.79	221,065.50
----------------	-----------	------------

注：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。

7.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金于本报告期内及上年度可比期间未发生应支付关联方的销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金管理人于本报告期末运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018 年 12 月 26 日		上年度末 2017 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 号资产管理计划	15,307,207.23	82.7100%	3,016,165.97	41.2400%

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 26 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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	1,199,198.67	65,746.45	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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金于本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2018 年 12 月 26 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

本基金于本报告期末未因认购新发/增发而持有流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

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
600030	中信证券	2018 年 12 月 25 日	重要事项未公告	16.01	2019 年 1 月 10 日	17.15	18,400	321,387.51	294,584.00	—
603108	润达医疗	2018 年 12 月 26 日	重要事项未公告	7.62	2018 年 12 月 27 日	7.60	4,700	38,446.00	35,814.00	—

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。

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

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，建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由督察长、合规及风险管理委员会、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及绩效评估。

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同责任，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。

7.4.13.3 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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2018 年 12 月 26 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,199,198.67	-	-	-	1,199,198.67
结算备付金	18,878.12	-	-	-	18,878.12
存出保证金	26,779.20	-	-	-	26,779.20
交易性金融资产	-	-	-	15,925,083.80	15,925,083.80
应收证券清算款	-	-	-	167,536.72	167,536.72
应收利息	-	-	-	325.06	325.06
应收申购款	-	-	-	496.03	496.03
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,244,855.99	-	-	16,093,441.61	17,338,297.60
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,189.29	3,189.29
应付赎回款	-	-	-	28,466.48	28,466.48
应付管理人报酬	-	-	-	10,211.11	10,211.11
应付托管费	-	-	-	1,914.58	1,914.58
应付交易费用	-	-	-	15,289.21	15,289.21
其他负债	-	-	-	94,029.49	94,029.49
负债总计	-	-	-	153,100.16	153,100.16
利率敏感度缺口	1,244,855.99	-	-	15,940,341.45	17,185,197.44
上年度末 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

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 2018 年 12 月 26 日		上年度末 2017 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	15,925,083.80	92.67	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	15,925,083.80	92.67	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（2018 年 12 月 26 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	3,695,000.00	1,356,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-3,695,000.00	-1,356,000.00

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 2018 年 12 月 26 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为 15594685.80 元，属于第二层级的余额为 330398 元，无属于第三层级的余额（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 2194379.25 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 2018 年 12 月 26 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（转型后）

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	16,182,630.00	93.36
	其中：股票	16,182,630.00	93.36
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	1,088,390.45	6.28
8	其他各项资产	62,634.19	0.36
9	合计	17,333,654.64	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	265,983.00	1.55
C	制造业	4,306,836.00	25.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	456,968.00	2.66
E	建筑业	564,955.00	3.28
F	批发和零售业	361,051.00	2.10
G	交通运输、仓储和邮政业	81,624.00	0.47
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,670.00	0.19

J	金融业	5,950,189.00	34.57
K	房地产业	835,578.00	4.85
L	租赁和商务服务业	174,432.00	1.01
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	192,304.00	1.12
S	综合	-	-
	合计	13,222,590.00	76.82

8.2.2 期末积极投资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	231,064.00	1.34
C	制造业	2,111,365.00	12.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	43,524.00	0.25
E	建筑业	48,828.00	0.28
F	批发和零售业	75,698.00	0.44
G	交通运输、仓储和邮政业	91,714.00	0.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	138,907.00	0.81
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	45,850.00	0.27
N	水利、环境和公共设施管理业	126,657.00	0.74
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	46,433.00	0.27
S	综合	-	-
	合计	2,960,040.00	17.20

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金于本报告期末未持有港股通股票。

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

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	17,100	959,310.00	5.57
2	601166	兴业银行	50,400	752,976.00	4.37
3	601939	建设银行	100,300	638,911.00	3.71
4	601997	贵阳银行	56,900	607,692.00	3.53
5	600919	江苏银行	82,700	493,719.00	2.87
6	000333	美的集团	11,500	423,890.00	2.46
7	600016	民生银行	71,600	410,268.00	2.38
8	000651	格力电器	10,600	378,314.00	2.20
9	601211	国泰君安	23,000	352,360.00	2.05
10	601818	光大银行	89,700	331,890.00	1.93
11	600109	国金证券	45,700	327,212.00	1.90
12	600048	保利地产	26,300	310,077.00	1.80
13	600030	中信证券	18,400	294,584.00	1.71
14	600031	三一重工	31,400	261,876.00	1.52
15	601186	中国铁建	22,700	246,749.00	1.43
16	000157	中联重科	67,800	241,368.00	1.40
17	000568	泸州老窖	5,900	239,894.00	1.39
18	600900	长江电力	14,100	223,908.00	1.30
19	002304	洋河股份	2,200	208,384.00	1.21
20	600887	伊利股份	8,800	201,344.00	1.17
21	002475	立讯精密	14,300	201,058.00	1.17
22	601607	上海医药	11,600	197,200.00	1.15
23	000961	中南建设	33,300	186,813.00	1.09
24	600104	上汽集团	7,000	186,690.00	1.08
25	600660	福耀玻璃	7,900	179,962.00	1.05
26	601828	美凯龙	15,800	174,432.00	1.01
27	601668	中国建筑	30,060	171,342.00	1.00
28	600535	天士力	8,900	170,880.00	0.99
29	600585	海螺水泥	5,800	169,824.00	0.99

30	000898	鞍钢股份	32,900	168,777.00	0.98
31	600837	海通证券	19,000	167,200.00	0.97
32	600977	中国电影	11,200	160,384.00	0.93
33	000002	万科 A	6,700	159,594.00	0.93
34	601898	中煤能源	33,300	154,845.00	0.90
35	600999	招商证券	11,200	150,080.00	0.87
36	601117	中国化学	27,400	146,864.00	0.85
37	601601	中国太保	4,900	139,307.00	0.81
38	600886	国投电力	17,200	138,460.00	0.80
39	002415	海康威视	5,000	128,800.00	0.75
40	600809	山西汾酒	3,500	122,675.00	0.71
41	600519	贵州茅台	200	118,002.00	0.69
42	300408	三环集团	6,900	116,748.00	0.68
43	601198	东兴证券	11,500	109,940.00	0.64
44	600019	宝钢股份	16,200	105,300.00	0.61
45	600522	中天科技	11,800	96,170.00	0.56
46	002146	荣盛发展	12,000	95,400.00	0.55
47	600436	片仔癀	1,100	95,315.00	0.55
48	600023	浙能电力	20,000	94,600.00	0.55
49	600352	浙江龙盛	8,700	83,955.00	0.49
50	600383	金地集团	8,700	83,694.00	0.49
51	601688	华泰证券	4,900	79,380.00	0.46
52	600297	广汇汽车	16,100	65,366.00	0.38
53	600566	济川药业	1,900	63,707.00	0.37
54	601628	中国人寿	3,000	61,170.00	0.36
55	002422	科伦药业	2,900	59,885.00	0.35
56	600028	中国石化	11,400	57,570.00	0.33
57	600998	九州通	3,800	55,480.00	0.32
58	601225	陕西煤业	7,200	53,568.00	0.31
59	600518	康美药业	5,300	48,813.00	0.28
60	600036	招商银行	1,900	47,880.00	0.28
61	002008	大族激光	1,500	45,540.00	0.26
62	600153	建发股份	6,100	43,005.00	0.25
63	600196	复星医药	1,800	41,886.00	0.24
64	601111	中国国航	5,300	40,492.00	0.24
65	600893	航发动力	1,600	34,752.00	0.20
66	600219	南山铝业	15,500	32,705.00	0.19
67	300059	东方财富	2,700	32,670.00	0.19
68	300251	光线传媒	4,200	31,920.00	0.19

69	603260	合盛硅业	700	30,660.00	0.18
70	600018	上港集团	5,400	27,972.00	0.16
71	601788	光大证券	3,000	26,310.00	0.15
72	600760	中航沈飞	700	19,397.00	0.11
73	600038	中直股份	500	18,680.00	0.11
74	002468	申通快递	800	13,160.00	0.08
75	002311	海大集团	500	11,585.00	0.07

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000596	古井贡酒	2,700	145,692.00	0.85
2	601717	郑煤机	19,000	105,070.00	0.61
3	000039	中集集团	9,000	95,220.00	0.55
4	600782	新钢股份	16,800	85,512.00	0.50
5	600779	水井坊	2,600	82,342.00	0.48
6	600808	马钢股份	23,700	82,002.00	0.48
7	000552	靖远煤电	31,900	81,664.00	0.47
8	600348	阳泉煤业	16,200	81,648.00	0.47
9	600426	华鲁恒升	6,700	80,869.00	0.47
10	600143	金发科技	16,300	80,685.00	0.47
11	600600	青岛啤酒	2,300	80,178.00	0.47
12	600017	日照港	29,000	80,040.00	0.47
13	600260	凯乐科技	4,100	69,577.00	0.40
14	002583	海能达	8,700	68,643.00	0.40
15	603886	元祖股份	3,900	68,250.00	0.40
16	002195	二三四五	17,900	66,051.00	0.38
17	603225	新凤鸣	3,400	63,750.00	0.37
18	600596	新安股份	5,800	62,002.00	0.36
19	002396	星网锐捷	3,600	61,992.00	0.36
20	600801	华新水泥	3,700	61,864.00	0.36
21	002078	太阳纸业	9,500	54,150.00	0.31
22	603496	恒为科技	2,200	53,570.00	0.31
23	300166	东方国信	5,100	52,836.00	0.31
24	603113	金能科技	4,800	52,656.00	0.31
25	002507	涪陵榨菜	2,400	51,840.00	0.30
26	600123	兰花科创	7,800	50,856.00	0.30
27	300657	弘信电子	1,700	49,470.00	0.29

28	603589	口子窖	1,400	49,098.00	0.29
29	600820	隧道股份	7,800	48,828.00	0.28
30	603043	广州酒家	1,800	48,744.00	0.28
31	000719	中原传媒	5,900	46,433.00	0.27
32	300012	华测检测	7,000	45,850.00	0.27
33	600486	扬农化工	1,200	45,192.00	0.26
34	000598	兴蓉环境	10,800	43,524.00	0.25
35	002087	新野纺织	12,300	43,419.00	0.25
36	600054	黄山旅游	4,600	43,148.00	0.25
37	000049	德赛电池	1,500	43,020.00	0.25
38	002391	长青股份	4,000	42,200.00	0.25
39	002159	三特索道	2,400	42,192.00	0.25
40	002462	嘉事堂	2,900	41,905.00	0.24
41	000978	桂林旅游	7,900	41,317.00	0.24
42	603367	辰欣药业	2,700	40,986.00	0.24
43	600308	华泰股份	9,400	40,890.00	0.24
44	600420	现代制药	4,400	40,216.00	0.23
45	300219	鸿利智汇	5,000	38,300.00	0.22
46	600479	千金药业	4,900	38,024.00	0.22
47	000650	仁和药业	6,200	33,976.00	0.20
48	603108	润达医疗	4,700	33,793.00	0.20
49	600062	华润双鹤	2,400	29,016.00	0.17
50	002705	新宝股份	2,500	22,950.00	0.13
51	300687	赛意信息	1,000	20,020.00	0.12
52	601666	平煤股份	4,800	16,896.00	0.10
53	600548	深高速	1,300	11,674.00	0.07

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	115,340.00	0.67
2	601818	光大银行	66,795.00	0.39
3	600104	上汽集团	52,540.00	0.31
4	601111	中国国航	40,598.00	0.24

5	600297	广汇汽车	32,320.00	0.19
6	603260	合盛硅业	31,234.00	0.18
7	002468	申通快递	13,184.00	0.08

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	600808	马钢股份	79,344.00	0.46
2	600600	青岛啤酒	28,240.00	0.16
3	000021	深科技	13,824.00	0.08

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	352,011.00
卖出股票收入（成交）总额	121,408.00

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

注：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**

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					-
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-

本基金于本报告期末未持有股指期货。

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。

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

本基金于本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金于本报告期末未持有国债期货。

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受到调查以及处罚的情况的说明****8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明****8.12.3 其他资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	26,779.20
2	应收证券清算款	35,166.21
3	应收股利	-
4	应收利息	589.26
5	应收申购款	99.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	62,634.19

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

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 投资组合报告（转型前）

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	15,925,083.80	91.85
	其中：股票	15,925,083.80	91.85
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	1,218,076.79	7.03
8	其他资产	195,137.01	1.13
9	合计	17,338,297.60	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	504,463.00	2.94
C	制造业	6,468,176.00	37.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	490,240.00	2.85
E	建筑业	604,451.80	3.52
F	批发和零售业	405,257.00	2.36
G	交通运输、仓储和邮政业	120,215.00	0.70
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	177,966.00	1.04
J	金融业	5,727,444.00	33.33

K	房地产业	839,297.00	4.88
L	租赁和商务服务业	173,642.00	1.01
M	科学研究和技术服务业	44,590.00	0.26
N	水利、环境和公共设施管理业	129,045.00	0.75
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	240,297.00	1.40
S	综合	—	—
	合计	15,925,083.80	92.67

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金于本报告期末未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	15,100	865,230.00	5.03
2	601166	兴业银行	50,400	744,912.00	4.33
3	601939	建设银行	100,300	630,887.00	3.67
4	601997	贵阳银行	56,900	606,554.00	3.53
5	600919	江苏银行	82,700	487,930.00	2.84
6	000333	美的集团	11,500	426,995.00	2.48
7	600016	民生银行	71,600	404,540.00	2.35
8	000651	格力电器	10,600	380,328.00	2.21
9	601211	国泰君安	23,000	345,690.00	2.01
10	600109	国金证券	45,700	321,728.00	1.87
11	600048	保利地产	26,300	310,603.00	1.81
12	600030	中信证券	18,400	294,584.00	1.71
13	600031	三一重工	31,400	263,760.00	1.53
14	601818	光大银行	71,400	259,896.00	1.51
15	000157	中联重科	67,800	242,724.00	1.41
16	601186	中国铁建	22,700	242,663.00	1.41
17	000568	泸州老窖	5,900	234,171.00	1.36
18	600900	长江电力	14,100	218,832.00	1.27
19	002304	洋河股份	2,200	204,468.00	1.19

20	002475	立讯精密	14,300	200,343.00	1.17
21	600887	伊利股份	8,800	197,296.00	1.15
22	601607	上海医药	11,600	196,040.00	1.14
23	000961	中南建设	33,300	191,475.00	1.11
24	600660	福耀玻璃	7,900	183,359.00	1.07
25	601828	美凯龙	15,800	173,642.00	1.01
26	600535	天士力	8,900	172,749.00	1.01
27	600585	海螺水泥	5,800	169,534.00	0.99
28	601668	中国建筑	30,060	167,734.80	0.98
29	000898	鞍钢股份	32,900	165,487.00	0.96
30	600837	海通证券	19,000	164,730.00	0.96
31	600977	中国电影	11,200	161,392.00	0.94
32	600808	马钢股份	46,900	159,929.00	0.93
33	000002	万科 A	6,700	159,460.00	0.93
34	601898	中煤能源	33,300	152,514.00	0.89
35	601117	中国化学	27,400	146,864.00	0.85
36	000596	古井贡酒	2,700	146,448.00	0.85
37	600999	招商证券	11,200	143,024.00	0.83
38	601601	中国太保	4,900	138,425.00	0.81
39	600886	国投电力	17,200	135,192.00	0.79
40	600104	上汽集团	5,000	133,750.00	0.78
41	002415	海康威视	5,000	129,550.00	0.75
42	600809	山西汾酒	3,500	124,810.00	0.73
43	300408	三环集团	6,900	117,024.00	0.68
44	600519	贵州茅台	200	112,016.00	0.65
45	600600	青岛啤酒	3,100	108,841.00	0.63
46	601198	东兴证券	11,500	108,330.00	0.63
47	601717	郑煤机	19,000	104,880.00	0.61
48	600019	宝钢股份	16,200	102,546.00	0.60
49	600522	中天科技	11,800	96,288.00	0.56
50	002146	荣盛发展	12,000	96,240.00	0.56
51	600436	片仔癀	1,100	95,062.00	0.55
52	000039	中集集团	9,000	94,500.00	0.55
53	600023	浙能电力	20,000	92,800.00	0.54
54	600782	新钢股份	16,800	87,864.00	0.51
55	600352	浙江龙盛	8,700	83,868.00	0.49
56	600348	阳泉煤业	16,200	82,944.00	0.48
57	000552	靖远煤电	31,900	82,621.00	0.48
58	600426	华鲁恒升	6,700	82,544.00	0.48

59	600779	水井坊	2,600	82,004.00	0.48
60	600383	金地集团	8,700	81,519.00	0.47
61	600017	日照港	29,000	80,910.00	0.47
62	600143	金发科技	16,300	77,588.00	0.45
63	601688	华泰证券	4,900	76,979.00	0.45
64	600260	凯乐科技	4,100	72,652.00	0.42
65	002583	海能达	8,700	71,601.00	0.42
66	603886	元祖股份	3,900	68,211.00	0.40
67	002195	二三四五	17,900	67,662.00	0.39
68	600566	济川药业	1,900	64,714.00	0.38
69	600028	中国石化	11,400	64,182.00	0.37
70	603225	新凤鸣	3,400	63,682.00	0.37
71	002396	星网锐捷	3,600	63,360.00	0.37
72	600596	新安股份	5,800	63,336.00	0.37
73	600801	华新水泥	3,700	62,715.00	0.36
74	601628	中国人寿	3,000	60,990.00	0.35
75	002422	科伦药业	2,900	60,291.00	0.35
76	600998	九州通	3,800	55,556.00	0.32
77	603496	恒为科技	2,200	54,912.00	0.32
78	300166	东方国信	5,100	54,570.00	0.32
79	002078	太阳纸业	9,500	53,865.00	0.31
80	601225	陕西煤业	7,200	53,856.00	0.31
81	603113	金能科技	4,800	53,328.00	0.31
82	002507	涪陵榨菜	2,400	52,080.00	0.30
83	600123	兰花科创	7,800	51,402.00	0.30
84	600518	康美药业	5,300	50,297.00	0.29
85	300657	弘信电子	1,700	49,317.00	0.29
86	603589	口子窖	1,400	48,020.00	0.28
87	600486	扬农化工	1,200	47,292.00	0.28
88	600036	招商银行	1,900	47,215.00	0.27
89	600820	隧道股份	7,800	47,190.00	0.27
90	603043	广州酒家	1,800	46,440.00	0.27
91	000719	中原传媒	5,900	45,725.00	0.27
92	000049	德赛电池	1,500	44,925.00	0.26
93	600054	黄山旅游	4,600	44,850.00	0.26
94	002008	大族激光	1,500	44,775.00	0.26
95	300012	华测检测	7,000	44,590.00	0.26
96	600153	建发股份	6,100	43,554.00	0.25
97	002087	新野纺织	12,300	43,542.00	0.25

98	000598	兴蓉环境	10,800	43,416.00	0.25
99	002391	长青股份	4,000	43,360.00	0.25
100	002159	三特索道	2,400	42,720.00	0.25
101	600196	复星医药	1,800	42,678.00	0.25
102	002462	嘉事堂	2,900	41,731.00	0.24
103	000978	桂林旅游	7,900	41,475.00	0.24
104	603367	辰欣药业	2,700	41,364.00	0.24
105	600308	华泰股份	9,400	40,890.00	0.24
106	300219	鸿利智汇	5,000	39,700.00	0.23
107	600420	现代制药	4,400	39,512.00	0.23
108	600479	千金药业	4,900	39,494.00	0.23
109	000650	仁和药业	6,200	36,518.00	0.21
110	603108	润达医疗	4,700	35,814.00	0.21
111	600893	航发动力	1,600	34,544.00	0.20
112	300251	光线传媒	4,200	33,180.00	0.19
113	600219	南山铝业	15,500	32,860.00	0.19
114	300059	东方财富	2,700	32,724.00	0.19
115	600297	广汇汽车	8,100	32,562.00	0.19
116	600062	华润双鹤	2,400	29,424.00	0.17
117	600018	上港集团	5,400	27,540.00	0.16
118	601788	光大证券	3,000	25,800.00	0.15
119	002705	新宝股份	2,500	23,200.00	0.13
120	300687	赛意信息	1,000	23,010.00	0.13
121	600760	中航沈飞	700	20,384.00	0.12
122	600038	中直股份	500	19,075.00	0.11
123	601666	平煤股份	4,800	16,944.00	0.10
124	000021	深科技	2,400	13,872.00	0.08
125	600548	深高速	1,300	11,765.00	0.07
126	002311	海大集团	500	11,220.00	0.07

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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600383	金地集团	2,340,809.00	27.72

2	601166	兴业银行	2,050,803.00	24.28
3	600340	华夏幸福	1,997,035.00	23.65
4	600585	海螺水泥	1,928,106.24	22.83
5	600048	保利地产	1,805,860.00	21.38
6	601328	交通银行	1,804,261.00	21.36
7	601318	中国平安	1,799,989.00	21.31
8	601939	建设银行	1,797,953.00	21.29
9	600741	华域汽车	1,741,384.00	20.62
10	002146	荣盛发展	1,735,379.00	20.55
11	600104	上汽集团	1,693,115.00	20.05
12	000651	格力电器	1,674,278.00	19.82
13	601155	新城控股	1,587,226.00	18.79
14	000895	双汇发展	1,558,383.00	18.45
15	601088	中国神华	1,545,186.00	18.30
16	600926	杭州银行	1,516,813.00	17.96
17	601006	大秦铁路	1,408,788.00	16.68
18	600019	宝钢股份	1,363,194.00	16.14
19	002142	宁波银行	1,330,923.74	15.76
20	600900	长江电力	1,327,325.00	15.72
21	600015	华夏银行	1,316,398.00	15.59
22	601012	隆基股份	1,309,682.00	15.51
23	601997	贵阳银行	1,300,203.00	15.40
24	000568	泸州老窖	1,293,253.00	15.31
25	000830	鲁西化工	1,280,059.00	15.16
26	000858	五粮液	1,275,544.00	15.10
27	601229	上海银行	1,256,555.00	14.88
28	000333	美的集团	1,243,373.00	14.72
29	600282	南钢股份	1,241,879.00	14.70
30	300316	晶盛机电	1,241,323.00	14.70
31	002008	大族激光	1,223,939.00	14.49
32	600782	新钢股份	1,197,361.00	14.18
33	600016	民生银行	1,157,722.00	13.71
34	002202	金风科技	1,145,229.00	13.56
35	601398	工商银行	1,124,864.00	13.32
36	600028	中国石化	1,082,295.00	12.82
37	601688	华泰证券	1,079,406.00	12.78

38	600036	招商银行	1,055,167.27	12.49
39	002035	华帝股份	1,033,713.00	12.24
40	601100	恒立液压	1,027,285.00	12.16
41	600740	山西焦化	1,026,600.00	12.16
42	600623	华谊集团	1,018,231.00	12.06
43	601988	中国银行	1,016,462.00	12.04
44	603799	华友钴业	995,959.00	11.79
45	000338	潍柴动力	986,273.00	11.68
46	000069	华侨城 A	948,248.00	11.23
47	600887	伊利股份	927,331.00	10.98
48	600153	建发股份	919,255.00	10.88
49	000898	鞍钢股份	917,159.00	10.86
50	601288	农业银行	906,186.00	10.73
51	601668	中国建筑	883,043.00	10.46
52	300122	智飞生物	880,440.00	10.43
53	600350	山东高速	878,598.00	10.40
54	601211	国泰君安	856,484.00	10.14
55	600566	济川药业	854,706.00	10.12
56	000581	威孚高科	845,211.00	10.01
57	600919	江苏银行	838,046.00	9.92
58	000488	晨鸣纸业	804,290.00	9.52
59	600426	华鲁恒升	797,966.80	9.45
60	600197	伊力特	788,507.00	9.34
61	601998	中信银行	788,330.00	9.33
62	002304	洋河股份	776,021.48	9.19
63	000528	柳工	738,117.00	8.74
64	600066	宇通客车	733,192.58	8.68
65	000001	平安银行	729,120.00	8.63
66	300072	三聚环保	721,603.00	8.54
67	002027	分众传媒	719,069.00	8.51
68	600352	浙江龙盛	703,682.00	8.33
69	603638	艾迪精密	697,350.00	8.26
70	002440	闰土股份	687,134.40	8.14
71	601788	光大证券	660,802.00	7.82
72	002013	中航机电	643,072.00	7.61
73	600660	福耀玻璃	628,570.00	7.44

74	000776	广发证券	624,385.00	7.39
75	601828	美凯龙	620,929.00	7.35
76	600177	雅戈尔	617,612.00	7.31
77	601966	玲珑轮胎	616,753.00	7.30
78	001979	招商蛇口	609,867.00	7.22
79	601818	光大银行	607,346.00	7.19
80	601991	大唐发电	598,662.00	7.09
81	300036	超图软件	595,615.00	7.05
82	600004	白云机场	588,647.00	6.97
83	000513	丽珠集团	583,406.00	6.91
84	603589	口子窖	581,937.00	6.89
85	600884	杉杉股份	575,798.06	6.82
86	002001	新和成	563,831.00	6.68
87	000402	金融街	561,713.00	6.65
88	000825	太钢不锈	557,883.00	6.61
89	603369	今世缘	552,717.00	6.54
90	300166	东方国信	549,702.00	6.51
91	601601	中国太保	546,201.00	6.47
92	600068	葛洲坝	537,394.00	6.36
93	600525	长园集团	534,150.00	6.32
94	002430	杭氧股份	524,697.00	6.21
95	601158	重庆水务	515,084.00	6.10
96	600030	中信证券	510,028.00	6.04
97	300178	腾邦国际	509,529.00	6.03
98	603707	健友股份	498,887.00	5.91
99	600760	中航沈飞	492,971.00	5.84
100	600170	上海建工	492,554.00	5.83
101	600567	山鹰纸业	489,182.00	5.79
102	300296	利亚德	485,776.00	5.75
103	002470	金正大	484,290.00	5.73
104	601003	柳钢股份	479,247.00	5.67
105	600642	申能股份	470,457.00	5.57
106	000027	深圳能源	469,732.00	5.56
107	600000	浦发银行	464,073.23	5.49
108	600519	贵州茅台	457,750.00	5.42
109	600535	天士力	456,198.00	5.40

110	000625	长安汽车	444,135.00	5.26
111	603179	新泉股份	436,987.00	5.17
112	000717	韶钢松山	431,039.00	5.10
113	603885	吉祥航空	420,365.20	4.98
114	000596	古井贡酒	419,568.00	4.97
115	000921	海信家电	418,528.00	4.96
116	002039	黔源电力	415,384.46	4.92
117	002217	合力泰	413,572.00	4.90
118	601186	中国铁建	412,158.00	4.88
119	002258	利尔化学	409,351.00	4.85
120	002372	伟星新材	407,847.00	4.83
121	600031	三一重工	405,183.00	4.80
122	000157	中联重科	405,078.00	4.80
123	000768	中航飞机	403,042.00	4.77
124	300458	全志科技	401,130.00	4.75
125	300137	先河环保	397,627.00	4.71
126	600487	亨通光电	396,244.00	4.69
127	300571	平治信息	396,000.00	4.69
128	300422	博世科	394,141.00	4.67
129	000789	万年青	390,684.00	4.63
130	600674	川投能源	386,027.00	4.57
131	600056	中国医药	385,308.00	4.56
132	002419	天虹股份	379,212.00	4.49
133	600596	新安股份	376,142.00	4.45
134	000543	皖能电力	374,222.00	4.43
135	002024	苏宁易购	373,891.00	4.43
136	300323	华灿光电	373,546.00	4.42
137	000063	中兴通讯	373,324.00	4.42
138	002475	立讯精密	368,804.00	4.37
139	600183	生益科技	365,471.00	4.33
140	600845	宝信软件	358,662.00	4.25
141	601117	中国化学	358,552.00	4.25
142	300251	光线传媒	358,323.00	4.24
143	600837	海通证券	353,126.00	4.18
144	600109	国金证券	346,446.00	4.10
145	000709	河钢股份	345,450.00	4.09

146	600606	绿地控股	339,898.00	4.02
147	600999	招商证券	335,798.00	3.98
148	600704	物产中大	335,579.00	3.97
149	600743	华远地产	333,412.00	3.95
150	600027	华电国际	332,932.00	3.94
151	300059	东方财富	332,292.00	3.93
152	002174	游族网络	329,562.00	3.90
153	601888	中国国旅	327,044.00	3.87
154	300616	尚品宅配	325,695.00	3.86
155	000636	风华高科	324,085.00	3.84
156	002680	*ST 长生	320,320.00	3.79
157	300121	阳谷华泰	319,832.00	3.79
158	600029	南方航空	314,622.00	3.73
159	600590	泰豪科技	311,573.00	3.69
160	300408	三环集团	309,163.00	3.66
161	600132	重庆啤酒	309,063.00	3.66
162	601877	正泰电器	308,098.00	3.65
163	600703	三安光电	307,225.00	3.64
164	000961	中南建设	306,432.00	3.63
165	002247	聚力文化	304,494.00	3.61
166	600017	日照港	302,850.00	3.59
167	000425	徐工机械	302,640.00	3.58
168	601618	中国中冶	299,288.00	3.54
169	300237	美晨生态	299,109.00	3.54
170	600491	龙元建设	297,641.00	3.52
171	002128	露天煤业	297,450.00	3.52
172	603357	设计总院	297,224.00	3.52
173	600779	水井坊	296,710.00	3.51
174	600970	中材国际	296,117.00	3.51
175	002482	广田集团	294,612.50	3.49
176	300673	佩蒂股份	294,059.00	3.48
177	300182	捷成股份	293,924.00	3.48
178	002343	慈文传媒	292,779.00	3.47
179	603939	益丰药房	291,958.00	3.46
180	600308	华泰股份	289,742.00	3.43
181	600089	特变电工	289,212.00	3.42

182	603007	花王股份	288,580.00	3.42
183	000726	鲁泰 A	287,914.00	3.41
184	002685	华东重机	287,641.00	3.41
185	300073	当升科技	286,882.00	3.40
186	300498	温氏股份	284,135.00	3.36
187	002815	崇达技术	283,270.00	3.35
188	601198	东兴证券	282,420.00	3.34
189	002717	岭南股份	279,684.00	3.31
190	002597	金禾实业	279,403.00	3.31
191	601636	旗滨集团	278,842.00	3.30
192	000039	中集集团	278,082.00	3.29
193	000598	兴蓉环境	276,791.00	3.28
194	600997	开滦股份	274,924.00	3.26
195	600702	舍得酒业	274,686.00	3.25
196	600522	中天科技	273,517.00	3.24
197	600826	兰生股份	272,831.00	3.23
198	600011	华能国际	269,089.00	3.19
199	600062	华润双鹤	257,021.00	3.04
200	601021	春秋航空	254,856.00	3.02
201	600236	桂冠电力	254,475.00	3.01
202	601233	桐昆股份	252,000.00	2.98
203	603368	柳药股份	251,976.00	2.98
204	600708	光明地产	251,382.00	2.98
205	300188	美亚柏科	249,146.00	2.95
206	603660	苏州科达	244,928.00	2.90
207	000892	欢瑞世纪	244,703.00	2.90
208	002479	富春环保	242,724.00	2.87
209	601898	中煤能源	241,011.00	2.85
210	000951	中国重汽	237,242.00	2.81
211	002373	千方科技	231,318.00	2.74
212	601225	陕西煤业	231,264.00	2.74
213	002444	巨星科技	229,668.00	2.72
214	600559	老白干酒	229,522.00	2.72
215	600681	百川能源	228,972.00	2.71
216	603365	水星家纺	226,978.00	2.69
217	000983	西山煤电	226,858.00	2.69

218	600963	岳阳林纸	226,502.00	2.68
219	300219	鸿利智汇	225,488.90	2.67
220	601607	上海医药	223,764.00	2.65
221	600315	上海家化	223,261.00	2.64
222	600976	健民集团	221,708.00	2.63
223	603518	维格娜丝	217,802.00	2.58
224	002110	三钢闽光	217,282.00	2.57
225	002327	富安娜	216,962.00	2.57
226	000883	湖北能源	215,177.00	2.55
227	600123	兰花科创	213,318.00	2.53
228	600323	瀚蓝环境	211,516.00	2.50
229	601168	西部矿业	211,393.00	2.50
230	002311	海大集团	209,212.00	2.48
231	002585	双星新材	208,419.00	2.47
232	000799	酒鬼酒	207,929.00	2.46
233	603337	杰克股份	206,268.00	2.44
234	300601	康泰生物	204,605.01	2.42
235	300740	御家汇	204,069.00	2.42
236	000818	航锦科技	203,896.00	2.41
237	002019	亿帆医药	203,390.00	2.41
238	600563	法拉电子	203,220.00	2.41
239	300068	南都电源	202,974.00	2.40
240	300271	华宇软件	201,880.00	2.39
241	002454	松芝股份	201,864.00	2.39
242	000426	兴业矿业	201,289.00	2.38
243	603103	横店影视	201,240.00	2.38
244	601369	陕鼓动力	199,582.00	2.36
245	002159	三特索道	198,058.00	2.35
246	000552	靖远煤电	197,076.00	2.33
247	000028	国药一致	195,570.00	2.32
248	600977	中国电影	192,089.00	2.27
249	600757	长江传媒	192,000.00	2.27
250	002080	中材科技	191,179.00	2.26
251	601231	环旭电子	190,319.00	2.25
252	603868	飞科电器	189,389.00	2.24
253	600809	山西汾酒	188,300.00	2.23

254	300070	碧水源	187,821.00	2.22
255	600346	恒力股份	187,575.00	2.22
256	300349	金卡智能	187,361.00	2.22
257	600651	飞乐音响	186,952.00	2.21
258	300207	欣旺达	185,931.00	2.20
259	600373	中文传媒	185,480.00	2.20
260	002583	海能达	184,730.00	2.19
261	600787	中储股份	184,285.00	2.18
262	600160	巨化股份	184,014.00	2.18
263	600808	马钢股份	183,379.00	2.17
264	000401	冀东水泥	183,340.00	2.17
265	002152	广电运通	182,858.00	2.17
266	600511	国药股份	182,068.00	2.16
267	300413	芒果超媒	181,460.00	2.15
268	600611	大众交通	181,130.00	2.14
269	000686	东北证券	180,886.00	2.14
270	000541	佛山照明	180,760.12	2.14
271	000685	中山公用	180,164.00	2.13
272	002078	太阳纸业	179,460.00	2.12
273	603466	风语筑	179,300.00	2.12
274	002463	沪电股份	178,242.00	2.11
275	300332	天壕环境	177,893.00	2.11
276	601390	中国中铁	177,568.00	2.10
277	603605	珀莱雅	177,550.00	2.10
278	002087	新野纺织	176,828.00	2.09
279	000860	顺鑫农业	176,795.00	2.09
280	603260	合盛硅业	176,471.00	2.09
281	600810	神马股份	176,330.00	2.09
282	002798	帝欧家居	174,720.00	2.07
283	600260	凯乐科技	172,844.00	2.05
284	000783	长江证券	170,982.00	2.02

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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600383	金地集团	1,891,702.01	22.40
2	600340	华夏幸福	1,869,885.30	22.14
3	600585	海螺水泥	1,751,747.00	20.74
4	601328	交通银行	1,748,747.00	20.71
5	600741	华域汽车	1,678,714.98	19.88
6	600926	杭州银行	1,565,535.00	18.54
7	600104	上汽集团	1,517,969.00	17.97
8	000895	双汇发展	1,460,477.00	17.29
9	601155	新城控股	1,398,097.00	16.55
10	600048	保利地产	1,387,223.00	16.43
11	601229	上海银行	1,347,862.00	15.96
12	002146	荣盛发展	1,337,067.00	15.83
13	600282	南钢股份	1,322,318.00	15.66
14	601088	中国神华	1,314,650.00	15.57
15	600019	宝钢股份	1,293,429.00	15.32
16	000830	鲁西化工	1,276,825.00	15.12
17	002008	大族激光	1,270,125.00	15.04
18	600015	华夏银行	1,269,103.00	15.03
19	601006	大秦铁路	1,263,003.00	14.95
20	002142	宁波银行	1,256,223.00	14.87
21	601166	兴业银行	1,220,038.00	14.45
22	600740	山西焦化	1,191,466.00	14.11
23	000858	五粮液	1,178,053.00	13.95
24	601012	隆基股份	1,160,701.60	13.74
25	600900	长江电力	1,137,675.30	13.47
26	600623	华谊集团	1,125,025.00	13.32
27	300316	晶盛机电	1,112,713.00	13.18
28	002202	金风科技	1,086,626.20	12.87
29	603799	华友钴业	1,034,984.00	12.25
30	601939	建设银行	1,028,408.00	12.18
31	601100	恒立液压	1,020,379.00	12.08
32	601398	工商银行	1,014,739.00	12.02
33	600782	新钢股份	1,008,389.00	11.94
34	600036	招商银行	961,320.00	11.38
35	000338	潍柴动力	958,528.00	11.35
36	000651	格力电器	952,028.00	11.27

37	000568	泸州老窖	951,328.00	11.26
38	601688	华泰证券	922,885.00	10.93
39	300122	智飞生物	910,671.00	10.78
40	601318	中国平安	908,679.00	10.76
41	601988	中国银行	902,520.00	10.69
42	002035	华帝股份	895,363.00	10.60
43	600028	中国石化	885,554.00	10.49
44	600566	济川药业	862,852.00	10.22
45	600350	山东高速	852,336.00	10.09
46	600153	建发股份	807,766.00	9.56
47	000581	威孚高科	792,795.00	9.39
48	000528	柳工	781,388.00	9.25
49	603638	艾迪精密	779,504.00	9.23
50	000069	华侨城 A	767,166.00	9.08
51	601288	农业银行	765,952.00	9.07
52	300104	乐视网	765,416.00	9.06
53	601998	中信银行	742,126.00	8.79
54	600066	宇通客车	740,135.00	8.76
55	002440	闰土股份	740,113.00	8.76
56	600884	杉杉股份	688,061.00	8.15
57	600426	华鲁恒升	687,053.00	8.14
58	601966	玲珑轮胎	675,011.00	7.99
59	300072	三聚环保	666,388.00	7.89
60	600197	伊力特	666,175.00	7.89
61	002027	分众传媒	665,942.40	7.89
62	000898	鞍钢股份	664,215.00	7.86
63	002013	中航机电	661,809.00	7.84
64	000001	平安银行	650,662.00	7.70
65	603369	今世缘	649,879.00	7.70
66	600016	民生银行	646,747.00	7.66
67	600887	伊利股份	630,258.98	7.46
68	600352	浙江龙盛	625,571.61	7.41
69	300166	东方国信	623,227.00	7.38
70	601668	中国建筑	618,816.00	7.33
71	000488	晨鸣纸业	618,494.00	7.32
72	600004	白云机场	616,956.00	7.31
73	000513	丽珠集团	612,926.00	7.26
74	000333	美的集团	602,355.00	7.13

75	000825	太钢不锈	579,933.00	6.87
76	300036	超图软件	576,856.00	6.83
77	601003	柳钢股份	568,046.00	6.73
78	600177	雅戈尔	562,442.00	6.66
79	002430	杭氧股份	558,033.00	6.61
80	601991	大唐发电	557,290.00	6.60
81	600332	白云山	556,184.00	6.59
82	600068	葛洲坝	534,667.00	6.33
83	000776	广发证券	525,180.00	6.22
84	000402	金融街	520,947.00	6.17
85	601158	重庆水务	515,221.00	6.10
86	002001	新和成	511,611.20	6.06
87	603589	口子窖	505,813.00	5.99
88	601997	贵阳银行	505,246.00	5.98
89	001979	招商蛇口	501,411.00	5.94
90	600525	长园集团	495,828.00	5.87
91	601211	国泰君安	493,529.00	5.84
92	601788	光大证券	493,320.00	5.84
93	300296	利亚德	484,881.00	5.74
94	600170	上海建工	482,496.00	5.71
95	300178	腾邦国际	482,255.00	5.71
96	600760	中航沈飞	480,238.00	5.69
97	002258	利尔化学	466,177.00	5.52
98	600642	申能股份	463,982.00	5.49
99	002304	洋河股份	463,275.00	5.49
100	603707	健友股份	459,180.00	5.44
101	000717	韶钢松山	457,556.00	5.42
102	000027	深圳能源	449,345.00	5.32
103	002217	合力泰	448,926.00	5.32
104	600567	山鹰纸业	439,934.00	5.21
105	002470	金正大	431,885.00	5.11
106	002739	万达电影	431,863.50	5.11
107	000625	长安汽车	428,682.00	5.08
108	601828	美凯龙	417,724.00	4.95
109	603179	新泉股份	416,621.40	4.93
110	300458	全志科技	415,204.00	4.92
111	600660	福耀玻璃	414,304.00	4.91
112	603885	吉祥航空	412,235.00	4.88

113	000768	中航飞机	411,296.00	4.87
114	300137	先河环保	410,669.00	4.86
115	000789	万年青	406,448.00	4.81
116	600487	亨通光电	405,489.60	4.80
117	002372	伟星新材	400,020.00	4.74
118	002039	黔源电力	400,019.33	4.74
119	601601	中国太保	398,249.00	4.72
120	300571	平治信息	397,960.00	4.71
121	002419	天虹股份	396,989.00	4.70
122	600845	宝信软件	393,636.00	4.66
123	600000	浦发银行	389,712.00	4.61
124	600183	生益科技	381,449.00	4.52
125	600674	川投能源	380,006.00	4.50
126	000921	海信家电	374,181.00	4.43
127	002024	苏宁易购	366,890.00	4.34
128	300422	博世科	366,002.00	4.33
129	600056	中国医药	361,083.00	4.28
130	000709	河钢股份	360,725.00	4.27
131	300323	华灿光电	356,963.00	4.23
132	600590	泰豪科技	354,960.00	4.20
133	000543	皖能电力	346,492.00	4.10
134	600027	华电国际	344,112.00	4.07
135	000636	风华高科	343,071.00	4.06
136	600132	重庆啤酒	339,713.00	4.02
137	300616	尚品宅配	327,980.00	3.88
138	002680	*ST 长生	327,510.00	3.88
139	600519	贵州茅台	324,582.00	3.84
140	300182	捷成股份	322,349.00	3.82
141	600997	开滦股份	320,560.00	3.80
142	600919	江苏银行	319,029.00	3.78
143	300673	佩蒂股份	318,635.00	3.77
144	002174	游族网络	318,105.00	3.77
145	000726	鲁泰 A	315,037.00	3.73
146	601888	中国国旅	312,704.00	3.70
147	600743	华远地产	312,042.00	3.69
148	600606	绿地控股	310,726.00	3.68
149	600596	新安股份	308,926.00	3.66
150	300188	美亚柏科	305,099.00	3.61

151	603939	益丰药房	304,629.00	3.61
152	300251	光线传媒	301,730.00	3.57
153	600029	南方航空	299,650.00	3.55
154	002128	露天煤业	298,480.00	3.53
155	000425	徐工机械	295,252.00	3.50
156	300237	美晨生态	294,008.00	3.48
157	002815	崇达技术	292,883.00	3.47
158	600089	特变电工	292,193.00	3.46
159	300059	东方财富	290,457.00	3.44
160	601618	中国中冶	290,436.00	3.44
161	603357	设计总院	287,920.00	3.41
162	600704	物产中大	284,746.00	3.37
163	000892	欢瑞世纪	283,042.00	3.35
164	601818	光大银行	280,754.00	3.32
165	002685	华东重机	280,540.60	3.32
166	002463	沪电股份	279,025.00	3.30
167	600703	三安光电	275,034.00	3.26
168	600970	中材国际	274,059.00	3.25
169	002247	聚力文化	273,686.00	3.24
170	002482	广田集团	272,984.00	3.23
171	002110	三钢闽光	272,454.00	3.23
172	300498	温氏股份	270,896.00	3.21
173	002717	岭南股份	270,798.00	3.21
174	000063	中兴通讯	267,581.00	3.17
175	300073	当升科技	265,942.00	3.15
176	300121	阳谷华泰	265,677.00	3.15
177	601877	正泰电器	265,144.00	3.14
178	603007	花王股份	265,117.00	3.14
179	603660	苏州科达	264,122.00	3.13
180	600491	龙元建设	264,108.00	3.13
181	600826	兰生股份	261,408.00	3.10
182	600150	*ST 船舶	253,746.00	3.00
183	601636	旗滨集团	252,520.00	2.99
184	601233	桐昆股份	247,460.00	2.93
185	600236	桂冠电力	245,448.00	2.91
186	600315	上海家化	244,441.00	2.89
187	600011	华能国际	243,389.00	2.88
188	601021	春秋航空	240,024.00	2.84

189	002479	富春环保	238,356.00	2.82
190	603466	风语筑	238,095.00	2.82
191	600702	舍得酒业	235,632.00	2.79
192	002597	金禾实业	235,266.00	2.79
193	603365	水星家纺	235,020.00	2.78
194	002373	千方科技	234,955.00	2.78
195	600681	百川能源	233,957.00	2.77
196	600779	水井坊	230,956.00	2.73
197	600308	华泰股份	228,320.00	2.70
198	002327	富安娜	228,201.00	2.70
199	600535	天士力	228,144.00	2.70
200	000951	中国重汽	227,761.00	2.70
201	002444	巨星科技	225,137.00	2.67
202	603337	杰克股份	224,775.00	2.66
203	300349	金卡智能	224,415.00	2.66
204	601369	陕鼓动力	222,793.00	2.64
205	002019	亿帆医药	222,718.00	2.64
206	002585	双星新材	220,986.00	2.62
207	000983	西山煤电	219,100.00	2.59
208	600323	瀚蓝环境	217,730.00	2.58
209	300601	康泰生物	215,760.00	2.55
210	600963	岳阳林纸	215,454.00	2.55
211	000401	冀东水泥	215,270.00	2.55
212	000799	酒鬼酒	215,198.00	2.55
213	600757	长江传媒	212,160.00	2.51
214	000598	兴蓉环境	211,684.56	2.51
215	300068	南都电源	209,733.00	2.48
216	300450	先导智能	207,525.00	2.46
217	600062	华润双鹤	207,081.60	2.45
218	300207	欣旺达	206,633.00	2.45
219	000860	顺鑫农业	205,066.00	2.43
220	600810	神马股份	201,654.00	2.39
221	000818	航锦科技	201,605.00	2.39
222	600708	光明地产	199,421.80	2.36
223	600559	老白干酒	197,887.40	2.34
224	601231	环旭电子	197,431.00	2.34
225	600017	日照港	196,794.00	2.33
226	002152	广电运通	196,534.00	2.33

227	601168	西部矿业	195,697.00	2.32
228	600837	海通证券	195,024.00	2.31
229	601186	中国铁建	194,186.00	2.30
230	600030	中信证券	193,212.00	2.29
231	603605	珀莱雅	192,523.00	2.28
232	603103	横店影视	191,123.00	2.26
233	002798	帝欧家居	188,608.00	2.23
234	002454	松芝股份	187,834.00	2.22
235	000883	湖北能源	187,502.00	2.22
236	300070	碧水源	185,100.00	2.19
237	600373	中文传媒	184,742.00	2.19
238	603868	飞科电器	184,065.00	2.18
239	000596	古井贡酒	182,068.00	2.16
240	603368	柳药股份	181,925.96	2.15
241	300164	通源石油	181,817.00	2.15
242	603518	维格娜丝	179,889.00	2.13
243	300740	御家汇	179,244.00	2.12
244	300413	芒果超媒	178,817.00	2.12
245	601390	中国中铁	178,064.00	2.11
246	600563	法拉电子	177,936.00	2.11
247	300271	华宇软件	177,794.00	2.11
248	601225	陕西煤业	176,288.00	2.09
249	300332	天壕环境	176,063.00	2.08
250	600160	巨化股份	174,411.00	2.07
251	000426	兴业矿业	173,729.00	2.06
252	002343	慈文传媒	173,485.00	2.05
253	603260	合盛硅业	172,917.00	2.05
254	600346	恒力股份	172,703.00	2.04
255	600511	国药股份	172,126.00	2.04
256	000028	国药一致	172,037.00	2.04
257	000783	长江证券	171,948.00	2.04
258	600999	招商证券	171,889.00	2.04
259	000952	广济药业	169,820.00	2.01
260	000685	中山公用	169,643.00	2.01
261	600976	健民集团	169,506.00	2.01

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	172,886,641.99
卖出股票收入（成交）总额	152,056,898.47

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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					-
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-

本基金于本报告期末未持有股指期货。

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。

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

本基金于本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金于本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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	26,779.20
2	应收证券清算款	167,536.72
3	应收股利	—
4	应收利息	325.06
5	应收申购款	496.03
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	195,137.01

8.12.2 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。

8.12.3 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.4 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（转型后）

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	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
西部利得沪深 300 指数 A	339	54,590.84	15,307,207.23	82.71%	3,199,087.27	17.29%
西部利得沪深 300 指数 C	—	—	—	—	—	—
合计	339	54,590.84	15,307,207.23	82.71%	3,199,087.27	17.29%

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	份额级别	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	西部利得沪深 300 指数 A	976,147.42	5.2747%
	西部利得沪深 300 指数 C	—	—
	合计	976,147.42	5.2747%

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	份额级别	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	西部利得沪深 300 指数 A	50~100
	西部利得沪深 300 指数 C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	西部利得沪深 300 指数 A	0~10
	西部利得沪深 300 指数 C	0
	合计	0~10

§ 9 基金份额持有人信息（转型前）

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
339	54,591.57	15,307,207.23	82.71%	3,199,335.69	17.29%

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%

报告期末基金管理人从业人员持有本基金情况参见转型后章节。

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
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(转型后)

单位：份

项目	西部利得沪深 300 指数 A	西部利得沪深 300 指数 C
基金合同生效日基金份额总额	18,506,542.92	—
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	107.58	—
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	356.00	—
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	18,506,294.50	—

注：其中“总申购份额”含红利再投、转换入份额；“总赎回份额”含转换出份额。

§ 10 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	200,520,789.91
本报告期期初基金份额总额	7,314,005.94
本报告期期间基金总申购份额	68,664,538.23
减:本报告期期间基金总赎回份额	57,472,001.25
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	18,506,542.92

注：其中“总申购份额”含红利再投、转换入份额；“总赎回份额”含转换出份额。

§ 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高级管理人员变动如下：

根据基金管理人一届四十七次董事会会议决议，自 2018 年 10 月 22 日起，聘任刘建武先生为公司董事长兼法定代表人，徐剑钧先生转任公司监事会主席。

本报告期内本基金托管人未发生重大人事变动。

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。

本报告期，无涉及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 32,000 元。截至报告期末连续服务期为 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。

本报告期内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（转型后）

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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	
西部证券	2	473,419.00	100.00%	204.21	100.00%	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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
西部证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

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	
信达证券	2	174,829,208.52	53.81%	127,852.57	66.39%	-
西部证券	2	150,082,626.94	46.19%	64,730.78	33.61%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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
信达证券	734,183.41	100.00%	-	-	-	-
西部证券	-	-	30,000,000.00	100.00%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

11.9 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

报告期内无其他重大事件。

11.9 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

报告期内无其他重大事件。

§ 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	-	21,307,207.23	6,000,000.00	15,307,207.23	82.71%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金为指数型基金，其主要风险包括但不限于：沪深 300 指数波动风险、流动性风险等。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准设立的相关文件;
- (2) 本基金《基金合同》;
- (3) 本基金更新的《招募说明书》;
- (4) 本基金《托管协议》;
- (5) 基金管理人《基金管理资格证书》及《企业法人营业执照》;
- (6) 报告期内本基金公告的各项原稿。

13.2 存放地点

本基金管理人处——上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 11 楼

13.3 查阅方式

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

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

西部利得基金管理有限公司

2019 年 3 月 28 日