

西部利得祥运灵活配置混合型证券投资基金 2019 年半年度报告摘要

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：西部利得基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：二〇一九年八月二十四日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	西部利得祥运混合	
基金主代码	673081	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 5 日	
基金管理人	西部利得基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	417,768,624.99 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	西部利得祥运混合 A	西部利得祥运混合 C
下属分级基金的交易代码:	673081	673083
报告期末下属分级基金的份额总额	223,249,011.97 份	194,519,613.02 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过专业化研究分析及投资，在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>1、大类资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金遵循行业间优势配置、各行业优选个股相结合的股票投资策略，综合评判行业所处的状况和未来发展趋势，筛选出经济周期不同阶段的优势行业，这些优势行业具有综合性的比较优势、较高的投资价值、能够取得超越各行业平均收益率的投资收益；行业内优选个股是以若干财务指标、成长性、估值、在所属行业当中的竞争地位、企业的盈利前景及成长空间、是否具有主题型投资机会等定性与定量指标为基础，筛选出经济周期与行业发展的不同阶段下，具有较高投资价值、持续成长性较好的优势个股。</p> <p>（1）行业间优势配置策略</p> <p>本基金管理人在进行行业配置时，将采用自上而下与自下而上相结合的方式，以证监会行业分类为标准，对行业配置定期进行综合评估，遴选出优势行业，并制定以及调整行业资产配置比例。在投资组合管理过程中，基金管理人也将根据宏观经济形势以及各个行业的基本面特征对行业配置进行持续动态地调整，以把握行业景气轮动带来的投资机会。</p> <p>（2）个股筛选策略</p> <p>在行业配置策略的基础上，本基金重点投资于优势行业中获益程度较</p>

	<p>高且具有核心竞争优势的上市公司。基金管理人将综合采用定量和定性相结合的方式；基于公司基本面全面考量、筛选优势企业，分析股票内在价值，结合风险管理，构建股票组合并对其进行动态调整。</p> <p>定量分析： 成长性指标包括未来 3 年公司主营业务收入、毛利率及净利率增长率；累计及新增研发支出；资本支出；人员招聘情况等。 盈利能力指标包括毛利率和净利率的变动趋势；净资产回报率等。 估值水平指标包括 P/E；P/S；P/B 等。</p> <p>定性分析： 在定量分析的基础上，基金管理人还将发挥其在股票研究方面的专业优势，综合利用卖方研究报告、实地调研和财务分析等多种手段，对进入研究范围的上市公司基本面进行深入分析，从定性的角度筛选出基本面良好、成长潜力较大的股票进行投资。</p> <p>3、债券投资策略 本基金可投资于国债、金融债、公司债、企业债、可转换债券（含可交换债券）、央行票据、次级债、地方政府债券等债券品种，基金经理通过对收益率、流动性、信用风险和风险溢价等因素的综合评估，合理分配固定收益类证券组合中投资于国债、金融债、企业债、短期金融工具等产品的比例，构造债券组合。 在选择国债品种中，本产品将重点分析国债品种所蕴含的利率风险和流动性风险，根据利率预测模型构造最佳期限结构的国债组合；在选择金融债、企业债品种时，本基金将重点分析债券的市场风险以及发行人的资信品质。资信品质主要考察发行机构及担保机构的财务结构安全性、历史违约/担保纪录等。本基金还将关注可转债价格与其所对应股票价格的相对变化，综合考虑可转债的市场流动性等因素，决定投资可转债的品种和比例，捕捉其套利机会。</p> <p>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。</p> <p>5、资产支持证券投资策略 本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，在通常情况下其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于证券投资基金中等风险水平的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	西部利得基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	赵毅	龚小武
	联系电话	021-38572888	021-52629999-212056
	电子邮箱	service@westleadfund.com	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话	4007-007-818;021-38572666		95561
传真	021-38572750		021-62159217

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.westleadfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人处——上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 11 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	西部利得祥运混合 A	西部利得祥运混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	1,104,258.21	491,392.40
本期利润	1,191,451.03	670,682.53
加权平均基金份额本期利润	0.0063	0.0220
本期基金份额净值增长率	0.45%	0.84%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0454	-0.0195
期末基金资产净值	233,378,565.81	190,720,228.79
期末基金份额净值	1.0454	0.9805

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

西部利得祥运混合 A

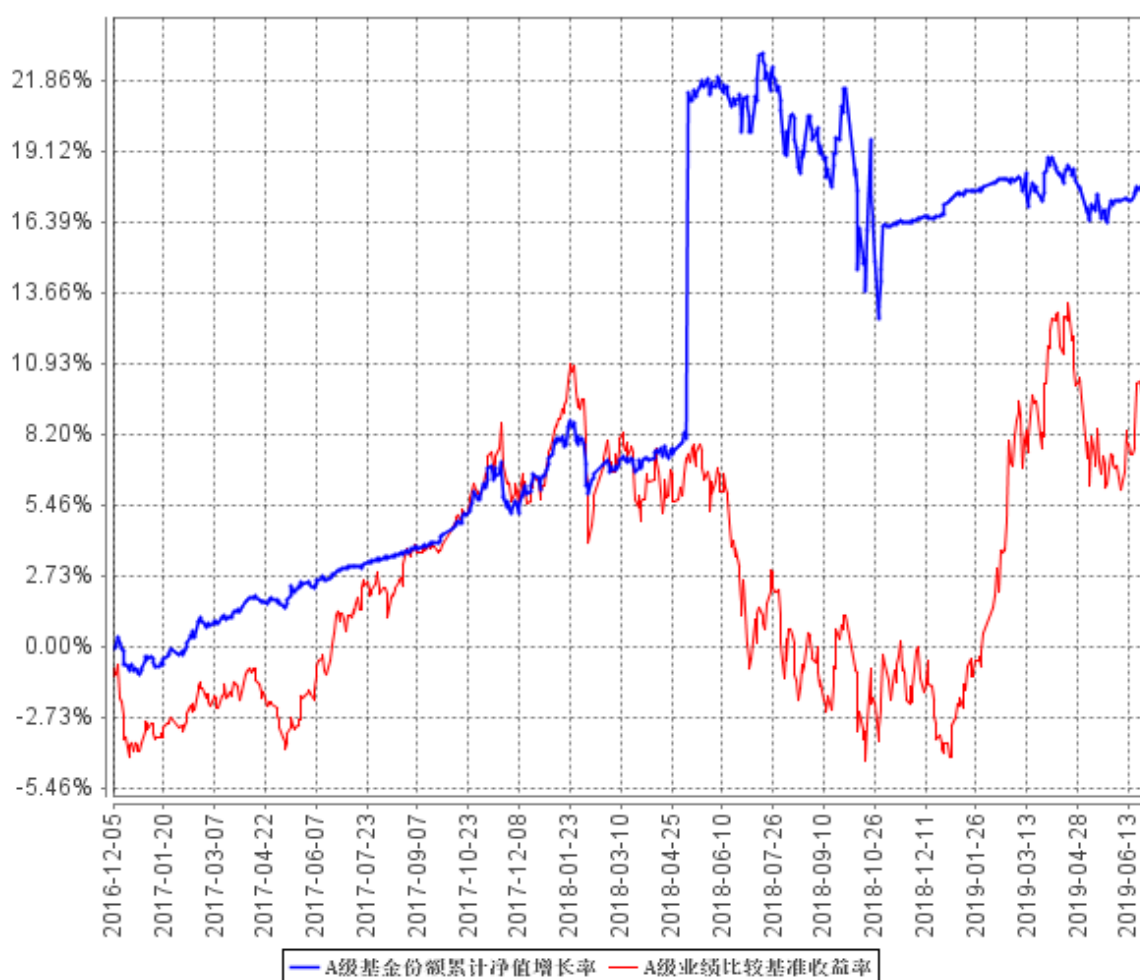
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.40%	0.06%	2.99%	0.57%	-2.59%	-0.51%
过去三个月	-0.56%	0.22%	-0.11%	0.75%	-0.45%	-0.53%
过去六个月	0.45%	0.20%	14.31%	0.77%	-13.86%	-0.57%
过去一年	-2.87%	0.51%	8.50%	0.76%	-11.37%	-0.25%
自基金合同生效起至今	17.67%	0.60%	10.09%	0.58%	7.58%	0.02%

西部利得祥运混合 C

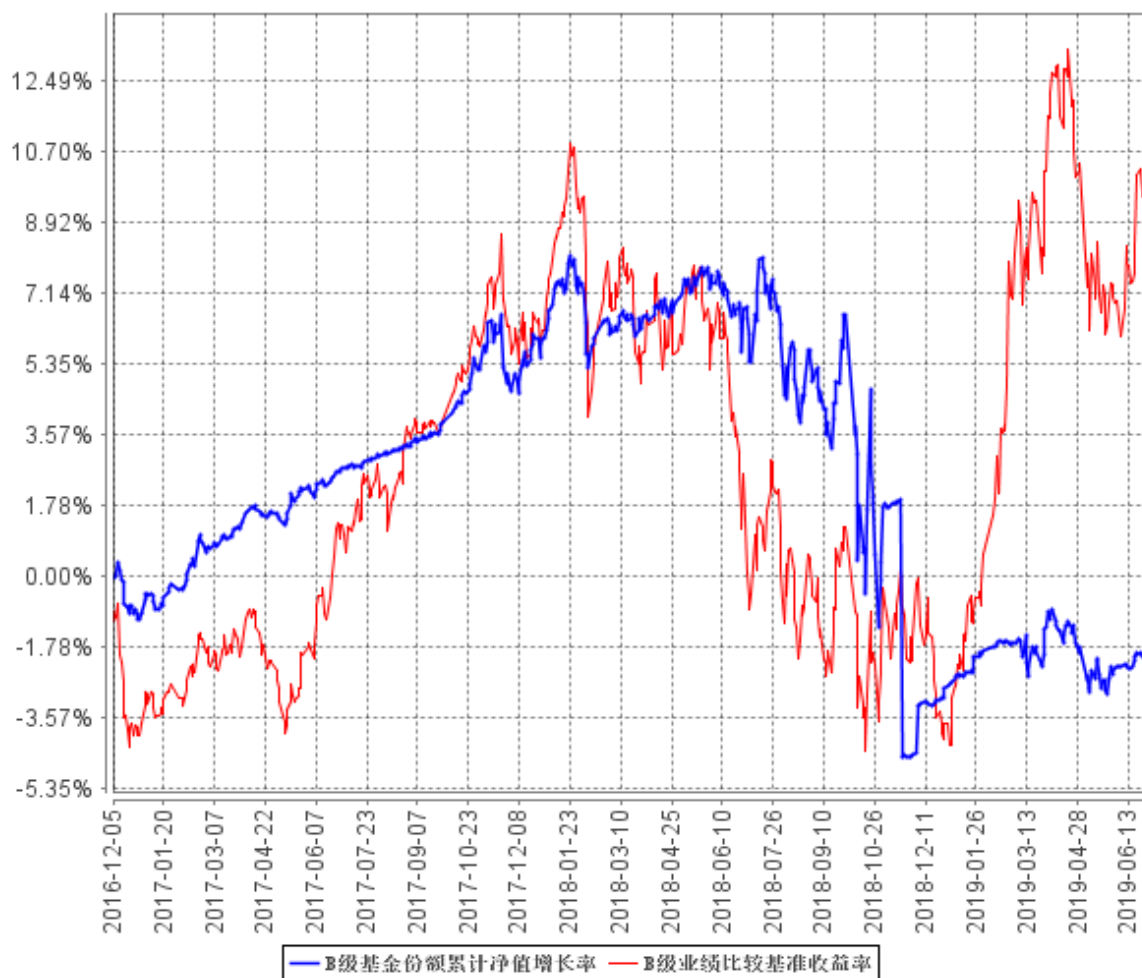
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.36%	0.06%	2.99%	0.57%	-2.63%	-0.51%
过去三个月	-0.67%	0.22%	-0.11%	0.75%	-0.56%	-0.53%
过去六个月	0.84%	0.21%	14.31%	0.77%	-13.47%	-0.56%
过去一年	-8.15%	0.65%	8.50%	0.76%	-16.65%	-0.11%
自基金合同生效起至今	-1.95%	0.43%	10.09%	0.58%	-12.04%	-0.15%

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

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



B级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

西部利得基金管理有限公司（简称“西部利得基金”，下同）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2010]864号）批准成立于2010年7月20日。公司由西部证券股份有限公司和利得科技有限公司合资控股，注册资本3.5亿元人民币，其中西部证券股份有限公司占比51%，利得科技有限公司占比49%，注册地上海。

截至2019年6月30日，本基金管理人旗下共管理32只开放式基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
韩丽楠	本基金基金经理	2016年12月5日	-	十三年	英国约克大学经济与金融硕士；曾任渣打银行国际管理培训生、诺德基金管理有限公司研究员、上海元普投资管理有限公司固定收益投资总监。2015年5月加入本公司，具有基金从业资格，中国国籍。
林静	本基金基金经理	2017年3月30日	-	十年	上海财经大学经济学硕士，曾任东方证券研究所研究员、国联安基金管理有限公司高级研究员。2016年11月加入本公司，具有基金从业资格，中国国籍。

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

和基金合同的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

各权益指数年初以来均以反弹为主基调。MSCI 和富时指数的持续流入，进一步推升了绩优蓝筹的估值。但同时也应看到，工业利润和民间投资仍未有起色。在此背景下，我们认为权益市场下半年仍将以震荡为主。

本基金在报告期内固定收益投资主要配置了流动性较好的国有股份制银行存单、短久期高等级信用债和利率债，投资上采用稳健的票息策略，配置上兼顾流动性和收益性，在严控信用风险的前提下，力争收益的最大化，并适度使用杠杆套利操作提高收益。本基金权益投资重点放在控

制回撤，获取绝对收益上，主要配置波动率低、持续有境外资金流入的绩优蓝筹股。

衷心感谢持有人的支持，我们将继续以诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金，努力为持有人带来优异回报。

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

上半年社融放量，消费和地产投资起稳，中美贸易摩擦暂时出现缓和态势，但完全解决仍需时间，国内经济下行压力仍大，稳增长、稳就业相关逆周期政策陆续出台，专项债融资规模扩容，基建投资未来将出现一定程度修复。虽然猪肉和水果价格相对去年同期有所上行，但整体来看通胀压力不大。

央行对市场呵护有加，银行间资金面宽松充裕，但受包商事件影响，流动性分层现象仍十分严重，信用风险偏好回落导致金融机构主动去杠杆，中小银行出现缩表趋势，低等级信用债表现趋弱，继续看好利率债和高等级信用债中长期配置价值。

权益方面，下半年预计指数维持震荡走势，仍然以大盘蓝筹作为配置方向。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据相关法律法规的规定，本基金管理人制订了证券投资基金估值政策和程序，并经本基金管理人总经理办公会议审议通过成立了估值委员会。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。具体职责包括对本基金管理人估值政策和程序的制订和解释；在发生影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况，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部、研究部、风险管理部、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、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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金相关法律法规和基金合同的要求，结合本基金实际运作情况，本报告期内，本基金暂未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：西部利得祥运灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	28,576,350.16	44,786,046.76
结算备付金		324,862.32	957,150.25
存出保证金		31,577.21	31,295.29
交易性金融资产	6.4.7.2	368,295,928.28	176,335,680.22
其中：股票投资		60,482,299.48	2,148,066.72
基金投资		-	-
债券投资		307,813,628.80	174,187,613.50
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	26,000,159.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	2,013,953.95	2,542,733.36
应收股利		-	-
应收申购款		3,107.51	1,248.36
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	0.01
资产总计		425,245,938.43	224,654,154.25
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	2,000,000.00
应付证券清算款		590,852.38	8,013,673.53
应付赎回款		-	30,630.82
应付管理人报酬		259,893.55	223,210.70
应付托管费		48,730.03	41,852.03
应付销售服务费		69,720.94	84.65
应付交易费用	6.4.7.7	86,491.76	23,343.18

应交税费		-	7.79
应付利息		-	-2,734.69
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	91,455.17	260,451.02
负债合计		1,147,143.83	10,590,519.03
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	417,768,624.99	205,698,189.50
未分配利润	6.4.7.10	6,330,169.61	8,365,445.72
所有者权益合计		424,098,794.60	214,063,635.22
负债和所有者权益总计		425,245,938.43	224,654,154.25

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，西部利得祥运混合 A 基金份额净值 1.0454 元，基金份额总额 223,249,011.97 份；西部利得祥运混合 C 基金份额净值 0.9805 元，基金份额总额 194,519,613.02 份。西部利得祥运混合份额总额合计为 417,768,624.99 份。

6.2 利润表

会计主体：西部利得祥运灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		3,342,125.02	6,524,149.48
1.利息收入		3,669,661.91	6,836,975.90
其中：存款利息收入	6.4.7.11	397,302.73	904,308.40
债券利息收入		3,079,553.21	4,706,931.21
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		192,805.97	1,225,736.29
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-691,507.63	4,171,699.80
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,771,970.09	5,576,897.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-179,088.29	-1,597,060.51
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,259,550.75	191,862.80
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	266,482.95	-4,489,406.19
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	97,487.79	4,879.97
减：二、费用		1,479,991.46	2,730,633.47
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	892,777.28	1,351,761.17
2. 托管费	6.4.10.2.2	167,395.71	253,455.23
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	69,951.82	540,627.57
4. 交易费用	6.4.7.19	174,160.63	364,106.67
5. 利息支出		61,207.31	97,113.32
其中：卖出回购金融资产支出		61,207.31	97,113.32
6. 税金及附加		258.52	6,538.67
7. 其他费用	6.4.7.20	114,240.19	117,030.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,862,133.56	3,793,516.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,862,133.56	3,793,516.01

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：西部利得祥运灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	205,698,189.50	8,365,445.72	214,063,635.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,862,133.56	1,862,133.56
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）	212,070,435.49	-3,897,409.67	208,173,025.82
其中：1.基金申购款	246,026,456.69	-2,347,259.51	243,679,197.18
2.基金赎回款	-33,956,021.20	-1,550,150.16	-35,506,171.36

五、期末所有者权益 (基金净值)	417,768,624.99	6,330,169.61	424,098,794.60
	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
项目	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)	416,986,601.57	26,232,036.86	443,218,638.43
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	3,793,516.01	3,793,516.01
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)	-320,836,010.81	-23,395,229.41	-344,231,240.22
其中：1.基金申购款	1,579,345.04	333,458.16	1,912,803.20
2.基金赎回款	-322,415,355.85	-23,728,687.57	-346,144,043.42
五、期末所有者权益 (基金净值)	96,150,590.76	6,630,323.46	102,780,914.22

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 - 至 - 财务报表由下列负责人签署：

<u>贺燕萍</u>	<u>贺燕萍</u>	<u>张峰骏</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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

西部利得祥运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]1476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 2016 年 12 月 5 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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

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 8 月 24 日报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 半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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 主要税项说明

根据财税[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 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

(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。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，按照证券投资基金管理人所在地适用的城市维护建设税税率，计算缴纳城市维护建设税。

(h) 对基金在 2018 年 1 月 1 日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的费率计算缴纳教育费附加、地方教育费附加。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
西部利得基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
西部证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
利得科技有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
兴业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

本基金于本报告期内及上年度期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	892,777.28	1,351,761.17
其中：支付销售机构的客户维护费	1,184.45	543.93

注：支付基金管理人西部利得基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.80% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	167,395.71	253,455.23

注：支付基金托管人兴业银行股份有限公司的基金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：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

6.4.8.2.3 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
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	西部利得祥运混合 A	西部利得祥运混合 C	合计
西部利得基金	0.00	69,706.61	69,706.61
西部证券	0.00	0.00	0.00
兴业银行	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	69,706.61	69,706.61
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	西部利得祥运混合 A	西部利得祥运混合 C	合计
	西部利得基金	0.00	540,592.30
西部证券	0.00	0.00	0.00
兴业银行	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	540,592.30	540,592.30

支付基金销售机构的销售服务费：

1. 按前一日 C 类基金资产净值 0.50% 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 × 0.50% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金的情况。

6.4.8.5 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有	12,576,350.16	68,531.73	4,933,681.94	62,437.84

限公司				
-----	--	--	--	--

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人兴业银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持暂时停牌股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10 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 2019 年 6 月 30 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 60442695.72，属于第二层级的余额为 307853232.56 元，无属于第三层级的余额（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无属于第一层级的余额，属于第二层级的余额为 176335680.22 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 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具 不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	60,482,299.48	14.22
	其中：股票	60,482,299.48	14.22
3	固定收益投资	307,813,628.80	72.38
	其中：债券	307,813,628.80	72.38
6	买入返售金融资产	26,000,159.00	6.11
7	银行存款和结算备付金合计	28,901,212.48	6.80
8	其他各项资产	2,048,638.67	0.48
9	合计	425,245,938.43	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
B	采矿业	275,650.40	0.06
C	制造业	139,702.32	0.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,367,600.00	1.03
G	交通运输、仓储和邮政业	5,657,337.00	1.33
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,603.76	0.01
J	金融业	50,002,406.00	11.79
	合计	60,482,299.48	14.26

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	601288	农业银行	5,242,500	18,873,000.00	4.45
2	601988	中国银行	4,229,000	15,816,460.00	3.73
3	601398	工商银行	1,945,000	11,456,050.00	2.70
4	601006	大秦铁路	699,300	5,657,337.00	1.33
5	600900	长江电力	244,000	4,367,600.00	1.03
6	601939	建设银行	518,400	3,856,896.00	0.91
7	600968	海油发展	77,648	275,650.40	0.06
8	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.02
9	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.01
10	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.01

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601288	农业银行	19,856,433.00	9.28
2	601988	中国银行	15,778,590.00	7.37
3	601398	工商银行	11,151,900.00	5.21
4	600030	中信证券	8,873,178.00	4.15
5	601229	上海银行	8,180,865.60	3.82
6	601006	大秦铁路	5,914,306.00	2.76
7	000063	中兴通讯	4,430,850.95	2.07
8	600900	长江电力	4,350,355.00	2.03
9	002714	牧原股份	4,135,741.00	1.93
10	601939	建设银行	3,903,390.00	1.82
11	600438	通威股份	3,478,643.00	1.63
12	000001	平安银行	3,352,107.00	1.57
13	601012	隆基股份	3,205,893.60	1.50
14	300498	温氏股份	3,106,284.92	1.45
15	601155	新城控股	2,992,815.00	1.40
16	601328	交通银行	1,817,200.00	0.85
17	002508	老板电器	1,461,966.20	0.68
18	601857	中国石油	1,444,000.00	0.67

19	603899	晨光文具	844,116.00	0.39
20	600548	深高速	829,600.00	0.39

注：本表“本期累计买入金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	601229	上海银行	8,182,357.05	3.82
2	600030	中信证券	7,299,974.00	3.41
3	002714	牧原股份	4,731,837.18	2.21
4	000063	中兴通讯	4,020,458.00	1.88
5	600438	通威股份	3,582,215.00	1.67
6	601012	隆基股份	3,270,401.00	1.53
7	300498	温氏股份	3,219,261.80	1.50
8	000001	平安银行	3,170,274.17	1.48
9	601155	新城控股	2,981,746.00	1.39
10	603156	养元饮品	2,428,332.15	1.13
11	601328	交通银行	1,800,850.00	0.84
12	601857	中国石油	1,428,000.00	0.67
13	002508	老板电器	1,334,410.00	0.62
14	600548	深高速	830,839.00	0.39
15	603899	晨光文具	825,205.00	0.39
16	002234	民和股份	792,771.00	0.37
17	002709	天赐材料	784,997.00	0.37
18	002311	海大集团	668,362.00	0.31
19	000100	TCL 集团	662,000.00	0.31
20	600104	上汽集团	642,141.00	0.30

注：本表“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	113,405,802.98
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	53,604,821.28
--------------	---------------

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	16,700,628.80	3.94
8	同业存单	291,113,000.00	68.64
10	合计	307,813,628.80	72.58

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	111903047	19 农业银行 CD047	500,000	48,510,000.00	11.44
2	111907083	19 招商银行 CD083	500,000	48,490,000.00	11.43
2	111911065	19 平安银行 CD065	500,000	48,490,000.00	11.43
2	111915181	19 民生银行 CD181	500,000	48,490,000.00	11.43
2	111917028	19 光大银行 CD028	500,000	48,490,000.00	11.43
3	111809344	18 浦发银行 CD344	300,000	29,247,000.00	6.90
4	111909142	19 浦发银行 CD142	200,000	19,396,000.00	4.57
5	019611	19 国债 01	167,140	16,700,628.80	3.94

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金于本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金于本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金于本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金于本报告期内未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，除了中国农业银行股份有限公司因被处罚当事人在开展流动资金贷款业务过程中存在信贷资金未按约定用途使用等严重违反审慎经营规则行为，于 2018 年 9 月 30 日被中国银行业监督管理委员会喀什监管分局处以罚款人民币 23 万元；中国农业银行济南分行因违反《征信业管理条例》有关规定，于 2018 年 7 月 24 日被中国人民银行济南分行处以罚款 5 万元；上海浦东发展银行股份有限公司因未按照规定履行客户身份识别义务、未按

照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易，于 2018 年 7 月 26 日被中国人民银行处以 170 万元罚款；上海浦东发展银行股份有限公司因违规转让信贷资产，于 2018 年 9 月 14 日被中国银行业监督管理委员会盐城监管分局处以罚款人民币 25 万元；中国光大银行股份有限公司因（一）内控管理严重违反审慎经营规则，（二）以误导方式违规销售理财产品，（三）以修改理财合同文本或误导方式违规销售理财产品，（四）违规以类信贷业务收费或提供质价不符的服务，（五）同业投资违规接受担保，（六）通过同业投资或贷款虚增存款规模，于 2018 年 11 月 9 日被中国银行保险监督管理委员会处以没收违法所得 100 万元，罚款 1020 万元，合计 1120 万元；其余证券发行主体本期没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	31,577.21
4	应收利息	2,013,953.95
5	应收申购款	3,107.51
9	合计	2,048,638.67

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 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 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
西部利得祥运混合 A	343	650,871.76	222,902,436.16	99.84%	346,575.81	0.16%
西部利得祥运混合 C	138	1,409,562.41	194,467,639.04	99.97%	51,973.98	0.03%
合计	465	898,427.15	417,370,075.20	99.90%	398,549.79	0.10%

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）。

8.2 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	西部利得祥运混合 A	4,981.31	0.0022%
	西部利得祥运混合 C	68.75	0.0000%
	合计	5,050.06	0.0012%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	西部利得祥运混合 A	0

投资和研究部门负责人持有本开放式基金	西部利得祥运混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	西部利得祥运混合 A	0~10
	西部利得祥运混合 C	0~10
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	西部利得祥运混 合 A	西部利得祥运混 合 C
基金合同生效日（2016 年 12 月 5 日）基金份 额总额	200,022,779.29	30,510.00
本报告期期初基金份额总额	205,552,792.07	145,397.43
本报告期期间基金总申购份额	51,236,919.74	194,789,536.95
减：本报告期期间基金总赎回份额	33,540,699.84	415,321.36
本报告期期末基金份额总额	223,249,011.97	194,519,613.02

注：其中“总申购份额”含红利再投、转换入份额；“总赎回份额”含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开本基金份额持有人大会，无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人董事长兼法定代表人于 2019 年 3 月 8 日起正式变更为何方先生。
本报告期内基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金进行审计。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
招商证券	1	66,923,821.90	40.18%	48,941.45	48.03%	-
太平洋证券	2	32,684,050.00	19.62%	20,633.83	20.25%	-
华金证券	2	18,870,046.60	11.33%	8,138.82	7.99%	-
东吴证券	2	16,693,641.87	10.02%	8,869.40	8.70%	-
东兴证券	3	13,001,873.62	7.81%	4,307.47	4.23%	-
方正证券	2	9,514,012.90	5.71%	5,054.94	4.96%	-
海通证券	1	4,604,619.37	2.76%	2,446.38	2.40%	-
中泰证券	2	4,211,650.00	2.53%	3,501.17	3.44%	-
银河证券	2	65,371.29	0.04%	10.54	0.01%	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	147,161.60	0.19%	20,000,000.00	5.75%	-	-

太平洋证券	57,511,414.84	73.27%	45,000,000.00	12.94%	-	-
华金证券	12,215,596.34	15.56%	205,700,000.00	59.16%	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	621,888.53	0.79%	-	-	-	-
方正证券	2,972,314.52	3.79%	77,000,000.00	22.15%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	5,019,500.00	6.40%	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	1-3 个月	-	194,467,639.04	-	194,467,639.04	46.55%
	2	>6 个月	85,968,019.26	-	-	85,968,019.26	20.58%
	3	>6 个月	85,954,100.05	-	-	85,954,100.05	20.57%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金为混合型基金，其主要风险包括但不限于：股票价格波动风险、信用风险、流动性风险等。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

西部利得基金管理有限公司

2019 年 8 月 24 日