

# 西部利得汇逸债券型证券投资基金

## 招募说明书（更新）

（2020年7月）

### （摘要）

#### 重要提示

本基金的募集申请经中国证券监督管理委员会 2016 年 9 月 5 日证监许可【2016】2035 号文准予注册，本基金基金合同于 2017 年 2 月 4 日生效。

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

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

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

本基金为债券型基金，在通常情况下其预期风险和预期收益高于货币市场基金，但低于股票型基金、混合型基金，属于证券投资基金的较低风险水平的投资品种。

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

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

本招募说明书关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

本次招募说明书的更新内容中与托管相关的信息已经本基金托管人复核。所载内容截止日为 2019 年 9 月 30 日，投资组合报告为 2019 年二季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为 2019 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。

## 第一部分 基金管理人

### 一、公司概况

名称：西部利得基金管理有限公司

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

办公地址：上海市浦东新区杨高南路 799 号陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 11 楼

法定代表人：何方

成立时间：2010 年 7 月 20 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监许可[2010]864 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：叁亿伍仟万元

存续期限：持续经营

联系人：陈眉媚

联系电话：（021）38572888

股权结构：

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

## 二、主要人员情况

### 1、董事会成员

何方先生：董事长

何方先生，董事长，硕士研究生，毕业于上海财经大学经济专业。17年证券从业经历。历任汉唐证券资产管理部研究员、西部证券投资管理部投资经理、西部证券投资管理部副总经理、西部证券投资管理部总经理、西部证券总经理助理兼上海第一分公司总经理。2010年起任西部证券副总经理。2017年3月至9月代为履行西部证券总经理职务。2017年9月起任西部证券总经理。自2019年3月起任公司董事长。

贺燕萍女士：董事

贺燕萍女士，董事，硕士研究生，高级经济师。毕业于中国社会科学院研究生院，获经济学硕士学位，21年证券从业经历。曾任北京市永安宾馆业务主管、华夏证券股份有限公司研究所客户部经理、中信建投证券股份有限公司机构销售部总经理助理、光大证券股份有限公司销售交易部副总经理、光大证券股份有限公司销售交易部总经理、光大证券资产管理有限公司总经理。2013年8月起任国泰基金管理有限公司副总经理。自2015年11月起任公司总经理。

李兴春先生：董事

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

陈伟忠先生：独立董事

陈伟忠，教授，独立董事，博士研究生。毕业于西安交通大学，获管理学博士

学位。长期从事金融研究及管理工作。1984年起历任西安交通大学教研室主任、系主任、博导，同济大学经管学院现代金融研究所所长。现担任同济大学经济金融系主任、同济大学上海期货研究院院长、应用经济学学术委员会主任、中国金融学会金融工程分会理事、上海金融学会常务理事。

沈宏山先生：独立董事

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

严荣荣女士：独立董事

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

## 2、监事会成员

陈曦女士：股东监事

陈曦女士，股东监事。毕业于上海国家会计学院会计专业，获硕士学位。曾任西部证券漕东支路营业部综合岗、西部证券西江湾路营业部大堂经理、西部证券上海第一分公司风险控制部经理。现任西部证券合规管理部合规风控经理。（经2020年6月30日公司股东会第二次会议审议同意陈曦担任股东监事职务，目前处于工商变更办理中。）

谢娟女士：监事

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

何晔女士：监事

何晔女士，监事。毕业于复旦大学应用数学专业。曾任友邦保险公司中国区呼叫中心副经理、国泰基金管理有限公司客服部呼叫中心主管、客服部副总监（主持工作）。现任公司电子商务部总经理。

### 3、公司高级管理人员

何方先生：董事长

何方先生，董事长，硕士研究生学历，毕业于上海财经大学经济专业。17 年证券从业经历。历任汉唐证券资产管理部研究员、西部证券投资管理总部投资经理、西部证券投资管理总部副总经理、西部证券投资管理总部总经理、西部证券总经理助理兼上海第一分公司总经理。2010 年起任西部证券副总经理。2017 年 3 月至 9 月代为履行西部证券总经理职务。2017 年 9 月起任西部证券总经理。自 2019 年 3 月起任公司董事长。

贺燕萍女士：总经理

贺燕萍女士，总经理，硕士研究生，高级经济师。毕业于中国社会科学院研究生院，获经济学硕士学位，21 年证券从业经历。曾任北京市永安宾馆业务主管、华夏证券股份有限公司研究所客户部经理、中信建投证券股份有限公司机构销售部总经理助理、光大证券股份有限公司销售交易部副总经理、光大证券股份有限公司销售交易部总经理、光大证券资产管理有限公司总经理。2013 年 8 月起任国泰基金管理有限公司副总经理。自 2015 年 11 月起任公司总经理。

赵毅先生：督察长

赵毅先生，督察长，硕士研究生，毕业于加拿大卡尔加里大学工商管理硕士专业，23 年证券从业经历。曾任北京大学社会科学处职员、北京市波姆红外技术公司总经理助理、华夏证券有限责任公司高级投资经理、华夏基金管理有限公司股票分析师、华夏基金管理有限公司风险管理部总经理助理。2015 年 12 月加入本公司，历任公司风险管理部总经理，自 2016 年 9 月起任公司督察长。

### 4. 基金经理

张维文先生，基金经理，硕士研究生，毕业于上海财经大学金融学专业，获经济学硕士学位。12 年证券从业年限。曾任交银施罗德基金公司信用分析师、国民信托有限公司固定收益研究员。2013 年 11 月加入本公司，曾任固定收益高级研究员，现任基金经理。2016 年 9 月至 2017 年 12 月担任西部利得天添富货币市场基金的基金经理，2016 年 11 月至 2017 年 12 月担任西部利得祥盈债券型证券投资基金的基金经理，自 2016 年 11 月起担任西部利得合赢债券型证券投资基金的基金经

理，自 2017 年 2 月起担任西部利得汇逸债券型证券投资基金的基金经理，自 2017 年 3 月至 2018 年 4 月担任西部利得得尊纯债债券型证券投资基金的基金经理，自 2017 年 3 月起担任西部利得祥逸债券型证券投资基金的基金经理，自 2017 年 6 月至 2018 年 8 月担任西部利得新富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自 2017 年 8 月至 2018 年 10 月担任西部利得新润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自 2018 年 3 月至 2019 年 4 月担任西部利得汇盈债券型证券投资基金的基金经理，自 2018 年 6 月起担任西部利得天添金货币市场证券投资基金的基金经理。

周帅先生，公募投资部副总经理、公募混合资产投资部总经理、基金经理。硕士毕业于南开大学金融学专业。11 年证券从业年限。曾任南京银行金融市场部高级交易员，资产管理部投资经理、江苏银行投资管理部负责人、交银康联资产管理有限公司固定收益部副总经理（主持工作）。2020 年 1 月加入本公司，历任公募投资部副总经理、公募混合资产投资部总经理、基金经理助理，现任公募投资部副总经理、公募混合资产投资部总经理、基金经理。自 2020 年 7 月起担任西部利得合赢债券型证券投资基金、西部利得汇逸债券型证券投资基金、西部利得新享混合型证券投资基金的基金经理。

#### 5、基金投资决策委员会成员

本基金采取集体投资决策制度。

投资决策委员会由下述委员组成：

投资决策委员会主任委员，王宇先生，总经理助理、公募投资部总经理。硕士毕业于南开大学金融学专业，13 年证券从业年限。曾任上海银行股份有限公司交易员、光大证券股份有限公司投资经理、交银施罗德基金管理有限公司投资经理。2016 年 9 月起加入西部利得基金管理有限公司，曾任公司专户投资部副总经理、专户投资部总经理、投资经理，现任总经理助理、公募投资部总经理。

投资决策委员会副主任委员，崔惠军先生，公募投资部副总经理、权益量化投资总监、公募权益投资部总经理、公募指数投资部总经理、基金经理。硕士毕业于中国人民大学数量经济专业，获得经济学硕士学位。18 年证券从业年限。曾任世纪证券证券投资部分析师、中企东方资产管理有限公司投资策略部高级经理、东

方证券金融衍生品业务总部总经理助理、鹏华基金量化及衍生品投资部总经理助理。于2017年8月加入本公司，现任公募投资部副总经理、权益量化投资总监、基金经理。自2018年7月起担任西部利得中证国有企业红利指数增强型证券投资基金（LOF）的基金经理，自2018年10月起担任西部利得事件驱动股票型证券投资基金的基金经理。

投资决策委员会委员，吴江先生，总经理助理、投资总监，硕士毕业于复旦大学财政学专业。13年证券从业年限。曾任兴业银行资金营运中心交易员、农银汇理基金管理有限公司基金经理、固定收益部副总经理。2016年8月加入本公司，现任总经理助理、投资总监。

投资决策委员会委员，刘荟女士，公募投资部副总经理、基金经理，毕业于辽宁大学应用数学专业。11年证券从业年限。曾任群益证券股份有限公司研究员。2014年1月加入本公司，曾任研究员，现任公募投资部副总经理、基金经理。自2016年1月起担任西部利得策略优选混合型证券投资基金的基金经理，自2018年6月起担任西部利得景程灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自2018年9月起担任西部利得事件驱动股票型证券投资基金的基金经理，自2019年3月担任西部利得个股精选股票型证券投资基金的基金经理，自2019年4月担任西部利得新动向灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

投资决策委员会委员，韩丽楠女士，基金经理，硕士毕业于英国约克大学经济与金融专业，获理学硕士学位。15年证券从业年限。曾任渣打银行国际管理培训生、诺德基金管理有限公司研究员、上海元普投资管理有限公司固定收益投资总监。2015年5月加入西部利得基金管理有限公司，曾任基金经理助理、机构部副总经理，现任基金经理。自2015年8月起担任西部利得成长精选灵活配置混合型证券投资基金、西部利得多策略优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自2016年2月起担任西部利得新盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自2016年3月起担任西部利得行业主题优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自2016年6月起担任西部利得稳健双利债券型证券投资基金的基金经理，自2016年12月起担任西部利得祥运灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自2017年2月起担任西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自

2017年8月起担任西部利得天添益货币市场基金的基金经理，自2018年5月起担任西部利得汇盈债券型证券投资基金的基金经理，自2018年11月起担任西部利得新富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

投资决策委员会委员，陈保国先生，研究部总经理，硕士毕业于上海理工大学系统理论专业，获理学硕士学位。9年证券从业年限。曾任西藏同信证券有限公司研究员、上海嘉华投资有限公司研究员。2016年1月加入我公司，曾任研究员、研究部副总经理、研究部副总经理（主持工作），现任研究部总经理。

投资决策委员会委员，盛丰衍先生，基金经理，硕士毕业于复旦大学计算机应用技术专业，获得理学硕士学位。6年证券从业年限。曾任光大证券股份有限公司权益投资助理、上海光大证券资产管理有限公司研究员、兴证证券资产管理有限公司量化研究员。2016年10月加入本公司，自2016年11月起担任西部利得中证500等权重指数分级证券投资基金的基金经理，自2018年7月起担任西部利得中证国有企业红利指数增强型证券投资基金（LOF）的基金经理，自2018年12月起担任西部利得沪深300指数增强型证券投资基金的基金经理，自2019年3月起担任西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金的基金经理。

投资决策委员会委员，刘心峰先生，基金经理，英国曼彻斯特大学数量金融专业，获得理学硕士学位。7年证券从业年限。曾任中德安联人寿保险有限公司交易员、华泰柏瑞基金管理有限公司交易员。2016年11月加入本公司，现任基金经理。自2017年2月起担任西部利得天添鑫货币市场基金、西部利得天添富货币市场基金、西部利得合享债券型证券投资基金的基金经理，自2017年8月起担任西部利得天添益货币市场基金的基金经理，自2019年6月起担任西部利得添盈短债债券型证券投资基金，自2019年9月起担任西部利得祥逸债券型证券投资基金的基金经理。

投资决策委员会委员，严志勇先生，公募固定收益部副总经理（主持工作）、基金经理。硕士毕业于复旦大学数量经济学专业，获得经济学硕士学位。8年证券从业年限。曾任上海强生有限公司管理培训生、中国国际金融股份有限公司研究员、中证指数有限公司研究员、兴业证券股份有限公司研究员、鑫元基金管理有限公司债券研究主管。2017年5月加入本公司，现任公募固定收益部副总经理（主



持工作)、基金经理。自 2017 年 8 月起担任西部利得汇享债券型证券投资基金的基金经理,自 2018 年 4 月起担任西部利得合享债券型证券投资基金的基金经理,自 2018 年 6 月西部利得景程灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,自 2018 年 11 月起担任西部利得得尊纯债债券型证券投资基金的基金经理,自 2019 年 6 月起担任西部利得聚享一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理,自 2019 年 7 月起担任西部利得聚利 6 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。

投资决策委员会委员,张翔先生,机构部联席总经理、基金经理。硕士毕业于荷兰代尔夫特理工大学概率、风险及统计专业,获得理学硕士学位。13 年证券从业年限。曾任上海汇富融略投资顾问有限公司助理副总裁、派杰亚洲证券有限公司研究员及产品协调员、华富基金管理有限公司高级经理、德邦基金管理有限公司基金经理。2017 年 3 月加入本公司,现任机构部联席总经理、基金经理。自 2017 年 10 月西部利得新润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责

1. 依法募集基金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;
2. 办理基金备案手续;
3. 对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;
4. 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配收益;
5. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
6. 编制季度报告、中期报告和年度报告;
7. 计算并公告基金净值信息,确定基金份额申购、赎回价格;
8. 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;
9. 召集基金份额持有人大会;
10. 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

11. 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

12. 有关法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他职责。

#### **四、基金管理人的承诺**

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

2. 基金管理人不得从事下列行为：

- (1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

3. 基金经理承诺

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

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

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

(4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

#### **五、基金管理人内部控制制度及风险控制体系**

1. 内部控制制度概述

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

施所形成的风险导向型的内部控制系统。

#### （1）内部控制的原则

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

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

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

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

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

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

#### （2）内部控制的制度系统

公司内部控制制度系统包括四个层次：第一个层次是国家有关法律法规和公司章程；第二个层次是包括内部控制大纲在内的基本管理制度；第三个层次是部门管理制度；第四个层次是各项具体业务规则。

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

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

3) 公司基本管理制度包括了以下内容：内部控制大纲、风险控制制度、投资管理制度、监察稽核制度、基金会计制度、信息披露制度、信息技术管理制度、紧

急应变制度、公司财务管理制度、人力资源管理制度和资料档案管理制度等；

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

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

### (3) 内部控制的要素

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

#### 1) 控制环境

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

公司设立督察长，对董事会负责，负责监督检查基金和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况，行使法律法规及公司章程规定的职权。

#### 2) 风险评估

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

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

公司的风险控制制度和风险管理流程，识别、监控与管理公司整体风险；

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

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

### 3) 控制活动

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

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

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

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

### 4) 信息与沟通

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

### 5) 内部监控

公司内部控制的监督系统由监事会、督察长和监察稽核部等组成，监督系统通过其监督职能的行使确保公司决策系统和执行系统合法、合规、高效地运作。根据市场环境、新的金融工具、新的技术应用和新的法律法规等情况，公司组织专门部

门对原有的内部控制进行全面的自查，审查其合法合规性、合理性和有效性，适时改进。

#### (4) 内部控制的检测

内部控制检测的过程包括如下：

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

#### 2. 风险控制体系

公司风险控制体系包括以下三个层次：

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

4) 为了有效地控制公司内部风险，公司各业务部门建立第一道监控防线。独立的监察稽核部，对各业务部门的各项业务全面实行监督反馈，必要时对有关部门进行不定期突击检查。同时，监察稽核部对于日常操作中发现的或认为具有潜在可能的问题出具监察稽核报告向风险控制委员会和总经理报告，形成第二道监控防线。督察长在工作上向中国证监会和董事会负责，并将检查结果汇报合规审核委员会和董事会，形成第三道监控防线。

#### 3. 基金管理人关于内部控制的声明

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

(2) 上述关于内部控制的披露真实、准确；

(3) 本公司承诺将根据市场环境变化及公司发展不断完善内部控制制度。

## 第二部分 基金托管人

### 一、基本情况

名称：宁波银行股份有限公司

住所：浙江省宁波市宁东路 345 号

办公地址：浙江省宁波市宁东路 345 号

法定代表人：陆华裕

注册日期：1997 年 04 月 10 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会，银监复[2007]64 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：伍拾亿陆仟玖佰柒拾叁万贰仟叁佰零伍人民币元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监许可【2012】1432 号

托管部门联系人：王海燕

电话：0574-89103171

### 二、主要人员情况

截至 2019 年 9 月底，宁波银行资产托管部共有员工 100 人，100%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

### 三、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，宁波银行自 2012 年获得证券投资基金资产托管的资格以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中丰富和成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、基金公司特定客户资产管理等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。

截至 2019 年 9 月底，宁波银行共托管 56 只证券投资基金，证券投资基金托管规模 678.12 亿元。

#### **四、基金托管人的职责**

基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。

基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。

基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。

#### **五、基金托管人的内部控制制度**

##### **1、内部风险控制目标**

强化内部管理，保障国家的金融方针政策及相关法律法规贯彻执行，保证自觉合规依法经营，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系，保障业务正常运行，维护基金持有人及基金托管人的合法权益。

##### **2、内部风险控制组织结构**



由宁波银行总行审计部和资产托管部内设的审计内控部门构成。资产托管部内部设置专门审计内控部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。

### 3、内部风险控制原则

(1) 合法性原则：必须符合国家及监管部门的法律法规和各项制度并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

(2) 完整性原则：一切业务、管理活动的发生都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约必须渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖到基金托管部所有的部门、岗位和人员。

(3) 及时性原则：托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

(4) 审慎性原则：必须实现防范风险、审慎经营，保证基金财产的安全与完整。

(5) 有效性原则：必须根据国家政策、法律及宁波银行经营管理的发展变化进行适时修订；必须保证制度的全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

(6) 独立性原则：设立专门履行基金托管人职责的管理部门；直接的操作人员和控制人员必须相对独立、适当分开；基金托管部内部设置独立的负责审计内控部门专责内控制度的检查。

## 六、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### 1、监督方法

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

## 2、监督流程

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

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

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

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

## 第三部分 相关服务机构

### 一、基金份额销售机构

#### 1. 直销机构：

名称：西部利得基金管理有限公司及电子交易平台。

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

办公地址：上海市浦东新区杨高南路 799 号陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 11 楼

法定代表人：何方

联系人：陈眉媚

客服热线：400-700-7818

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

#### 2. 代销机构：

##### (1) 西部证券股份有限公司

公司地址：西安市新城东大街 319 号 8 幢 10000 室

法定代表人： 徐朝晖

联系人： 梁承华

客服热线： 95582

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

(2) 上海利得基金销售有限公司

公司地址： 上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 14 楼

法定代表人： 李兴春

联系人： 曹怡晨

客服热线： 400-921-7755

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

(3) 中国银河证券股份有限公司

地址： 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人： 陈共炎

联系人： 邓颜

客服热线： 4008-888-888 或 95551

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

(4) 平安证券股份有限公司

公司地址： 深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人： 詹露阳

联系人： 周一涵

客服热线： 95511-8

网址： [stock.pingan.com](http://stock.pingan.com)

(5) 东海证券股份有限公司

公司地址： 上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人： 赵俊

联系人： 王一彦

客服电话： 95531； 400-8888-588

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

(6) 上海华信证券有限责任公司

公司地址：上海市黄浦区南京西路 399 号明天广场 18-23 层

法定代表人：郭林

联系人：李颖

客服热线：4008205999

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

(7) 中泰证券股份有限公司

公司地址：济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系人：许曼华

客服热线：95538

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

(8) 长城证券股份有限公司

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

法定代表人：何伟

联系人：金夏

客服热线：400-6666-888

网址：<http://www.cgws.com>

(9) 联储证券有限责任公司

地址：广东省深圳市福田区华强北路圣廷苑酒店 B 座 26 楼

法定代表人：沙常明

联系人：丁倩云

客服热线：4006206868

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

(10) 光大证券股份有限公司

地址：上海市新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

联系人：刘晨

客服热线： 95525、400-8888-788

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

(11) 中信证券股份有限公司

地址： 北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人： 张佑君

联系人： 侯艳红

客服热线： 95548

网址： <http://www.cs.ecitic.com/>

(12) 中信建投证券股份有限公司

地址： 北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人： 王常青

联系人： 魏明

客服热线： 400-8888-108

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

(13) 世纪证券股份有限责任公司

地址： 深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层

法定代表人： 姜昧军

联系人： 王雯

客服热线： 4008-323-000

网址： <http://www.csco.com.cn/>

(14) 中信证券（山东）有限责任公司

地址： 青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人： 杨宝林

联系人： 孙秋月

客服热线： 95548

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

(15) 招商证券股份有限公司

地址： 深圳市福田区益田路江苏大厦 38—45 层

法定代表人：官少林

联系人：黄婵君

客服热线：95565、4008888111

网址：www.newone.com.cn

(16) 申万宏源证券有限公司

地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系人：黄莹

客服热线：95523 或 4008895523

网址：www.swhysc.com

(17) 申万宏源西部证券有限公司

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

法定代表人：韩志谦

联系人：王怀春

客服热线：0991-2307105

网址：www.hysec.com

(18) 中银国际证券有限责任公司

地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39F

法定代表人：钱卫

联系人：王炜哲

客服热线：400-620-8888

网址：www.bocichina.com

(19) 信达证券股份有限公司

地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

联系人：尹旭航

客服热线：95321

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

(20) 安信证券股份有限公司

地址: 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人: 王连志

联系人: 陈剑虹

客服电话: 95517

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

(21) 西部期货有限公司

地址: 陕西省西安市新城区东大街 319 号 8 幢 10000 室 9 层

法定代表人: 陈杰

联系人: 闫海

客服热线: 400-688-6896

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

(22) 上海陆金所资产管理有限公司

公司地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

法定代表人: 鲍东华

联系人: 宁博宇

客服热线: 4008219031

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

(23) 和讯信息科技有限公司

地址: 北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人: 王莉

联系人: 于杨

客服热线: 400-920-0022

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

(24) 浙江同花顺基金销售有限公司

公司地址: 杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼

法定代表人: 凌顺平

联系人：费超超

客服热线：4008-773-772

网址：www.5ifund.com

(25) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

公司地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

联系人：何昞

客服热线：400-820-2899

网址：www.erichfund.com

(26) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

法定代表人：陈柏青

联系人：韩爱彬

客服热线：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

(27) 上海联泰基金销售有限公司

地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：燕斌

联系人：兰敏

客服热线：400-166-6788

网址：www.66zichan.com

(28) 上海天天基金销售有限公司

公司地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座

法定代表人：其实

联系人：朱钰

客服热线：95021、4001818188

网址：<http://www.1234567.com.cn>

(29) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司



地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

法定代表人：张彦

联系人：文雯

客服热线：4001661188

网址：<http://www.new-rand.cn/>

(30) 上海万得基金销售有限公司

地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：王廷富

联系人：徐亚丹

客服热线：400-821-0203

网址：[www.520fund.com.cn](http://www.520fund.com.cn)

(31) 奕丰基金销售有限公司

地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人：TAN YIK KUAN

联系人：叶健

客服热线：400-684-0500

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

(32) 上海好买基金销售有限公司

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

法定代表人：杨文斌

联系人：王诗琦

客服热线：400-700-9665

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

(33) 万家财富基金销售（天津）有限公司

地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 5 层

法定代表人：李修辞

联系人：邵玉磊

客服热线：010-59013825

网址: <http://www.wanjiawealth.com/>

(34) 泰诚财富基金销售(大连)有限公司

地址: 辽宁省大连市沙河口区星海中路3号

法定代表人: 林卓

联系人: 姜焕洋

客服热线: 0411-88891212

网址: <http://www.taichengcaifu.com>

(35) 武汉市伯嘉基金销售有限公司

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

法定代表人: 陶捷

联系人: 徐博

客服热线: 400-027-9899

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

(36) 北京晟视天下投资管理有限公司

地址: 北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室

法定代表人: 蒋煜

联系人: 殷雯

客服热线: 400-818-8866

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

(37) 海银基金销售有限公司

地址: 上海市浦东新区银城中路8号4楼

法定代表人: 刘惠

联系人: 毛林

客服热线: 400-808-1016

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

(38) 成都华弈恒信财富投资管理有限公司

地址: 中国(四川)自由贸易试验区成都高新区蜀锦路88号1号楼32楼2号

法定代表人：赵壁

联系人：徐莉

客服热线：400-8010-009

网址：<http://www.huayihengxin.com>

(39) 喜鹊财富基金销售有限公司

地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦 1513 室

法定代表人：陈皓

联系人：曹砚财、张萌

客服热线：0891-6177483

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

(40) 上海挖财基金销售有限公司

地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

法定代表人：胡燕亮

联系人：李娟

客服热线：021-50810673

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

(41) 上海华夏财富投资管理有限公司

地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：毛淮平

联系人：仲秋玥

客服热线：400-817-5666

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

(42) 北京汇成基金销售有限公司

地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号

法定代表人：王伟刚

客服电话：400-619-9059

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

(43) 上海基煜基金销售有限公司

地址：上海市昆明路 518 号北美广场 A1002-A1003 室

法定代表人：王翔

联系人：吴鸿飞

客服热线：400-820-5369

网址：www.jiyufund.com.cn

(44) 中信期货有限公司

地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

联系人：罗文燕

客服热线：400-990-8826

网址：www.citicsf.com

(45) 大河财富基金销售有限公司

地址：贵州省贵阳市南明区新华路 110-134 号富中国际广场 1 栋 20 层 1.2 号

法定代表人：王荻

联系人：方凯鑫

客服热线：0851-8823-5678

网址：www.urainf.com

(46) 北京恒天明泽基金销售有限公司

地址：北京市朝阳区东三环北路甲 19 号 SOHO 嘉盛中心 30 层 3001 室

法定代表人：周斌

联系人：陈霞

客服热线：400-8980-618

网址：www.chtwm.com

(47) 北京蛋卷基金销售有限公司

地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人：钟斐斐

联系人：戚晓强

客服热线:4000-618-518

网址: <https://danjuanapp.com>

(48) 北京肯特瑞基金销售有限公司

地址: 北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部

法定代表人: 陈超

联系人: 赵德赛

客服热线: 95118

网址: <http://fund.jd.com/>

(49) 沈阳麟龙投资顾问有限公司

地址: 辽宁省沈阳市东陵区白塔二南街 18-2 号 b 座 601

法定代表人: 朱荣晖

联系人: 庞园

客服热线: 400—003—5811

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

(50) 南京苏宁基金销售有限公司

地址: 南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人: 钱燕飞

联系人: 喻明明

客服热线: 95177

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

(51) 阳光人寿保险股份有限公司

地址: 北京市朝阳区朝外大街 20 号联合大厦 701A 室

法定代表人: 李科

联系人: 王超

客服热线: 95510

网址: <http://fund.sinosig.com/>

(52) 中证金牛(北京)投资咨询有限公司

地址: 北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层

法定代表人：钱昊旻

联系人：孙雯

客服热线：4008-909-998

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

(53) 深圳众禄基金销售有限公司

地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

客服热线：400-6788-887

网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)、[www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

(54) 上海凯石财富基金销售有限公司

地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人：陈继武

联系人：冯强

客服热线：400-643-3389

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

(55) 民商基金销售(上海)有限公司

地址：上海市浦东新区张杨路 707 号生命人寿大厦 32 楼

法定代表人：贲惠琴

联系人：杨一新

客服热线：021-50206002

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

(56) 浦领基金销售有限公司

地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室

法定代表人：聂婉君

联系人：徐微

客服热线：400-012-5899

网址：<http://www.zscffund.com/>

(57) 江苏汇林保大基金销售有限公司

地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号

法定代表人：吴言林

联系人：孙平

客服热线：025-66046166

网址：www.huilinbd.com

(58) 诺亚正行基金销售有限公司

地址：上海市杨浦区长阳路 1687 号 2 号楼

法定代表人：汪静波

联系人：李娟

客服热线：400-821-5399

网址：www.noah-fund.com

(59) 华瑞保险销售有限公司

地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路 399 号运通星财富广场 1 号楼 B 座 13、14 层

法定代表人：路昊

联系人：张爽爽

客服热线：952303

网址：<https://www.huaruisales.com/>

(60) 和耕传承基金销售有限公司

地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼 503

法定代表人：王旋

联系人：董亚芳

客服热线：400-0555-671

网址：www.hgccpb.com

(61) 中国中金财富证券有限公司

地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 4、18 层至 21 层

法定代表人：高涛

联系人：张丹桥

客服热线：95532/4006008008

网址：<http://www.china-invs.cn/>

(62) 泛华普益基金销售有限公司

地址：四川省成都市锦江区东大街 99 号平安金融中心 1501 室

法定代表人：于海锋

联系人：陈金红

客服热线：4008588588

网址：<https://www.puyifund.com/>

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

## 二、登记机构

名称：西部利得基金管理有限公司

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

办公地址：上海市浦东新区杨高南路 799 号陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 11 楼

法定代表人：何方

电话：（021）38572888

传真：（021）38572750

联系人：张皞骏

客户服务电话：4007-007-818；（021）38572666

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

住所：上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室

办公地址：上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室

负责人：廖海

联系电话：（021）51150298

传真：（021）51150398

联系人：刘佳



经办律师：廖海、刘佳

#### 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东长安街1号东方广场毕马威大楼8层

办公地址：上海市南京西路1266号恒隆广场50楼

法定代表人：邹俊

联系电话：（021）2212 2888

传真：（021）6288 1889

联系人：黄小熠

经办注册会计师：黄小熠、张楠

### 第四部分 基金的名称

西部利得汇逸债券型证券投资基金

### 第五部分 基金的类型

契约型开放式

### 第六部分 基金的投资目标

本基金通过构建有效的投资组合，在严格控制风险的前提下，力求获得长期稳定的收益。

### 第七部分 基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、次级债券、可转债（含分离交易可转债）、可交换公司债等）、资产支持证券、债

券回购、权证、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金债券资产的投资比例不低于基金资产的80%，现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

## 第八部分 基金的投资策略

### 1、大类资产配置策略

本基金采取积极的大类资产配置策略，通过对宏观经济、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、债券投资策略

债券投资组合的回报主要来自于组合的久期管理，识别收益率曲线中价值低估的部分以及各类债券中价值低估的种类。本基金在充分研究债券市场宏观环境和仔细分析利率走势基础上，通过久期管理、期限结构配置、个券选择等策略依次完成组合构建。在投资过程中，以中长期利率趋势分析为主，结合经济周期、宏观经济运行中的价格指数、资金供求分析、货币政策、财政政策研判及收益率曲线分析，在保证流动性和风险可控的前提下，实施积极的债券投资组合管理。

#### （1）久期策略

久期管理是债券投资的重要考量因素，本基金将分析中长期利率趋势，结合经济周期、宏观经济运行中的价格指数、资金供求分析、货币政策、财政政策研判密切跟踪CPI、PPI、M2、M1、汇率等利率敏感指标，对未来中国债券市场利率走势进行分析与判断，并由此确定合理的债券组合久期。

#### （2）期限结构配置

本基金在确定组合目标久期后，分析债券市场收益率期限结构，基于收益率曲线变化对各期限段债券风险收益特征进行评估，将预期收益率与波动率匹配度最高的期限段进行配比，构建风险收益特征最优的债券组合。

### （3）类属资产配置策略

不同类型的债券在收益率、流动性和信用风险上存在差异，本基金将债券资产配置于不同类型的债券品种以及在不同市场间进行配置，以寻求收益性、流动性和信用风险补偿间的最佳平衡点。

在综合信用分析、流动性分析、税收及市场结构等因素分析的基础上，本基金根据对金融债、企业债等债券品种与同期限国债之间收益率利差的扩大和收窄的预期，主动地增加预期利差将收窄的债券类属品种的投资比例，降低预期利差将扩大的债券类属品种的投资比例，获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

### （4）个券选择策略

在以上债券资产久期、期限和类属配置的基础上，本基金根据债券市场收益率数据，运用利率模型对单个债券进行估值分析，并结合债券的信用评级、流动性、息票率、税赋、提前偿还和赎回等因素，选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。为控制基金债券投资的信用风险，本基金投资的企业债券需经国内评估机构进行信用评估，要求其信用评级为投资级以上。如果债券获得主管机构的豁免评级，本基金根据对债券发行人的内部信用风险分析，决定是否将该债券纳入基金的投资范围。

### （5）信用债投资策略

信用债属于无担保债券，本基金通过研判宏观经济走势，债券发行主体所处行业周期及其财务状况，对其信用风险进行审慎度量 and 定价，分析其收益率相对于信用风险的投资价值，结合流动性状况综合考虑，选择信用利差溢价较高且不失流动性的品种，谨慎选择债券发行人基本面良好、债券条款优惠的信用类债券进行投资。

## 3、股票、权证投资策略

在严格控制风险、保持资产流动性的前提下，本基金将适度参与股票、权证等权益类资产的投资，以增加基金收益。

本基金将依据自上而下的动态研究，发挥时机选择能力，通过流动性较高的分散化组合投资，控制流动性风险和非系统性风险。

本基金运用公司研究平台，配置行业和个股，优化组合，精选流动性高、安全边际高、具有上涨潜力的个股，力求增强组合收益。

本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。

#### 4、可转换债/可交换债券申购投资策略

可转换债/可交换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金将选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的可转换/可交换债券进行申购投资，并采用期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值，制定相应的申购和择时卖出策略。

#### 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。

## 第九部分 基金的业绩比较标准

本基金业绩比较基准： $\text{中债总全价指数收益率} \times 90\% + \text{沪深 300 指数收益率} \times 10\%$

## 第十部分 基金的风险收益特征

本基金为债券型证券投资基金，风险与收益高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。

## 第十一部分 基金的投资组合报告

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

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

本投资组合报告所载数据截止2019年6月30日，本报告所列财务数据未经审计。

#### 1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,916,743,963.30	92.92
	其中：债券	1,725,109,963.30	83.63
	资产支持证券	191,634,000.00	9.29
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	105,790,598.69	5.13
	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	3,105,930.81	0.15
8	其他资产	37,183,854.11	1.80
9	合计	2,062,824,346.91	100.00

#### 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末持有股票。

#### 3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末持有股票。

#### 4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	460,247,000.00	22.35
	其中：政策性金融债	460,247,000.00	22.35
4	企业债券	452,191,473.30	21.96
5	企业短期融资券	140,882,000.00	6.84
6	中期票据	560,155,000.00	27.20
7	可转债（可交换债）	111,634,490.00	5.42
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,725,109,963.30	83.77

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	180209	18 国开 09	3,000,000	300,090,000.00	14.57
2	101653011	16 大同煤矿 MTN001	1,500,000	154,875,000.00	7.52
3	132004	15 国盛 EB	1,133,000	111,634,490.00	5.42
4	180410	18 农发 10	1,100,000	110,077,000.00	5.35
5	101754037	17 晋能 MTN001	1,000,000	102,040,000.00	4.96

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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	149484	正荣优	1,900,000	191,634,000.00	9.31

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细  
贵金属不在本基金投资范围内。

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细  
本基金本报告期末未持有权证。

9. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本期国债期货投资政策

国债期货不在本基金投资范围内。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

国债期货不在本基金投资范围内。

(3) 本期国债期货投资评价

国债期货不在本基金投资范围内。

10. 投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(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

本基金本报告期末持有股票，不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	36,551,929.51
5	应收申购款	631,924.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,183,854.11

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	132004	15 国盛 EB	111,634,490.00	5.42

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 第十二部分 基金的业绩

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

西部利得汇逸债券型基金A:

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



		准差②	收益率 ③	率标准差 ④		
2017年2月4日 -2017年12月 31日	-1.69%	0.10%	-0.87%	0.10%	-0.82%	0.00%
2018年1月1日 -2018年12月 31日	5.55%	0.03%	2.72%	0.15%	2.83%	-0.12%
2019年1月1日 -2019年6月30 日	2.22%	0.02%	2.22%	0.14%	0.00%	-0.12%
2017年2月4日 -2019年6月30 日	6.07%	0.07%	4.08%	0.13%	1.99%	-0.06%

西部利得汇逸债券型基金C:

阶段	净值增长 率①	净值增长 率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
2017年2 月4日- 2017年12 月31日	3.68%	0.20%	-0.87%	0.10%	4.55%	0.10%

2018年1月1日-2018年12月31日	5.52%	0.03%	2.72%	0.15%	2.80%	-0.12%
2019年1月1日-2019年6月30日	2.40%	0.02%	2.22%	0.14%	0.18%	-0.12%
2017年2月4日-2019年6月30日	12.03%	0.13%	4.08%	0.13%	7.95%	0.00%

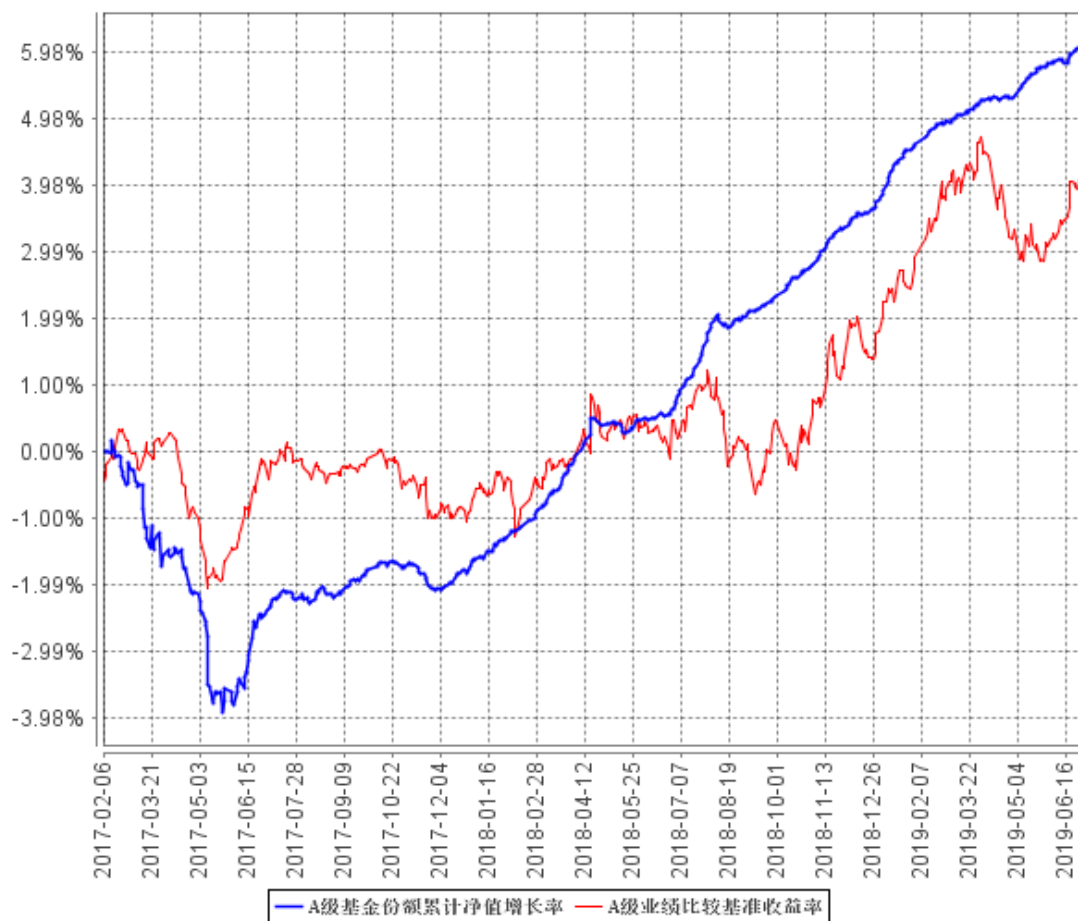
2. 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

西部利得汇逸债券型证券投资基金

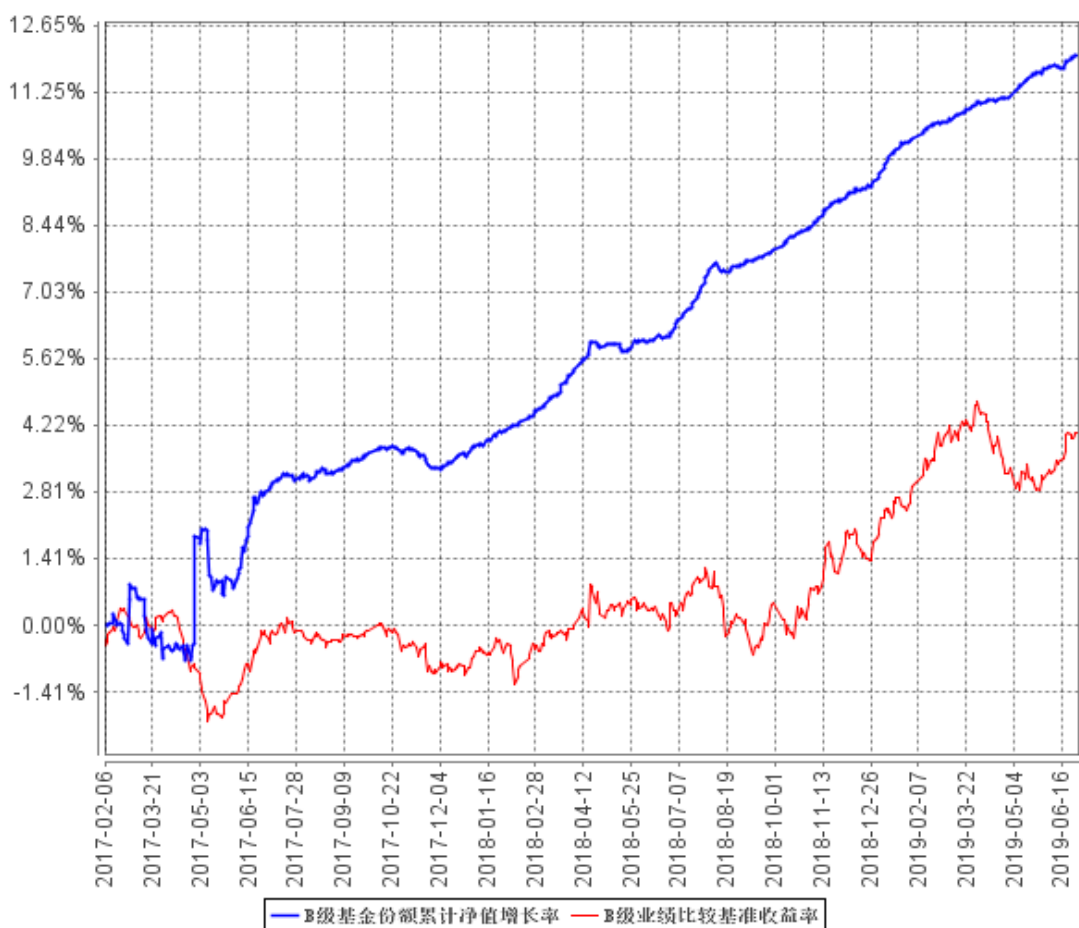
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017年2月4日至2019年6月30日)

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## 第十三部分 基金费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金销售服务费
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用，但法律法规、中国证监会另有规定的除外；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；

- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的开户费用、账户维护费用；
- 10、货币经纪服务费用（若有）；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

## 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

### 3、销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.10%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给注册登记机构，由注册登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

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

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

### 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

五、在法律法规规定的范围内，基金管理人和基金托管人协商一致，待履行相关程序后可调整基金管理费、基金托管费和基金销售服务费。基金管理人必须依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介和基金管理人网站上刊登公告。

## 第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，对2019年12月25日公布的《西部利得汇逸债券型证券投资基金基金招募说明书（更新）（2019年12月）》进行了更新，并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要更新的内容如下：

1. 根据最新资料，更新了“标题”部分。
2. 根据最新资料，更新了“第三部分 基金管理人”。

西部利得基金管理有限公司

2020年7月