

西部利得新润灵活配置混合型证券投资基金

2020 年中期报告

2020 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：中国银河证券股份有限公司

送出日期：二〇二〇年八月三十一日

§ 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。

基金托管人中国银河证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16

6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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	44
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	44
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	44
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	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	45
§8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
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	47
§9 开放式基金份额变动	48
§10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
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	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8 其他重大事件	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息	51

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	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	51
§12 备查文件目录.....	52
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	西部利得新润灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	西部利得新润混合
场内简称	—
基金主代码	673110
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 8 月 25 日
基金管理人	西部利得基金管理有限公司
基金托管人	中国银河证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	227,481,101.92 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

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。
投资策略	大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、资产支持证券投资策略。（详见《基金合同》）
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	中国银河证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵毅	李淼
	联系电话	021-38572888	010-66568780
	电子邮箱	service@westleadfund.com	yhqz_tggz@chinastock.com.cn
客户服务电话		4007-007-818;021-38572666	95551; 400-888-8888
传真		021-38572750	010-66568532
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	中国北京西城区金融大街 35 号 2-6 层
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴世纪	中国北京西城区金融大街 35 号

	金融广场 3 号楼 11 楼	国际企业大厦 C 座
邮政编码	200127	100033
法定代表人	何方	陈共炎

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020 年 1 月 1 日 - 2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	16,386,035.46
本期利润	31,955,839.90
加权平均基金份额本期利润	0.1463
本期加权平均净值利润率	11.61%
本期基金份额净值增长率	10.69%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	43,849,915.78
期末可供分配基金份额利润	0.1928
期末基金资产净值	315,636,249.22
期末基金份额净值	1.388
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	49.15%

3.2 基金净值表现

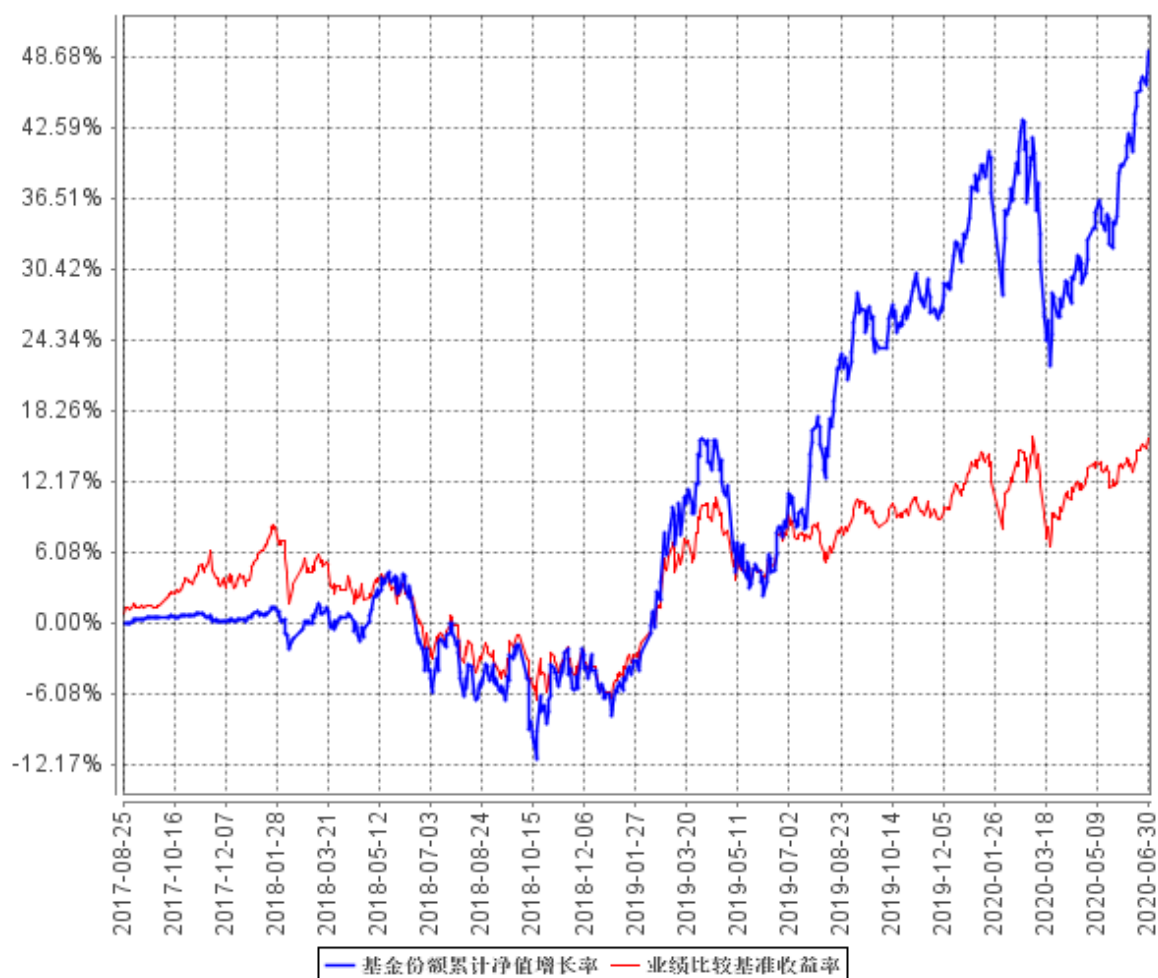
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	10.60%	0.86%	3.34%	0.44%	7.26%	0.42%
过去三个月	17.83%	0.84%	6.14%	0.45%	11.69%	0.39%
过去六个月	10.69%	1.34%	2.46%	0.74%	8.23%	0.60%
过去一年	37.72%	1.13%	7.64%	0.60%	30.08%	0.53%
自基金合同 生效起至今	49.15%	0.99%	15.78%	0.63%	33.37%	0.36%

本基金的业绩基准指数=沪深 300 指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.3 其他指标

无

§ 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2020年6月30日，本基金管理人旗下共管理39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		
张翔	机构部联席总经理、基金经理	2017年10月9日	—	13年	荷兰代尔夫特理工大学理学硕士，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，具有基金从业资格，中国国籍。
张英	基金经理	2019年12月26日	—	9年	中国人民大学国际经济与贸易学士，曾任广东南粤银行管理培训生，流动性管理岗，业务经理。2018年9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

本基金从长期的视角，在遵从价值发现规律和群体行为规律的前提下，进行组合构造。

2020 年上半年，本基金通过对股票和债券长期潜在风险收益的比较，认为当前股票相对债券的风险收益比更具吸引力，同时结合市场对经济发展的预期以及资金面的情况，认为市场对经济逐步走出突发事件的影响拥有信心，并且股票的赚钱效应开始逐步显现，在资金面整体宽松的情况下，国内及国际资金进一步流入 A 股市场。所以从资产配置角度看股票有较好的配置价值，上半年基金组合维持较高的股票仓位。

权益部分围绕制造升级与消费升级两条主线进行配置，具体从企业文化、商业模式、产业链地位等方面出发寻找未来具有持续高成长能力且股东回报优异的公司。同时，积极参与新股申购，

增厚组合的收益。

固定收益部分本基金对债券配置采取短久期并严把信用关,保证了组合流动性,同时对组合收益有一定的增厚。

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

展望 2020 年下半年,虽然从宏观上看短期经济发展仍有很多不确定性,面临新冠疫情和国际贸易争端等一些事件的冲击及困难。但从长期看政府坚持改革开放的方向,大力地减税降费,坚定地引领产业升级,所以中国经济的转型升级虽然道路曲折但前途光明。

股票市场从短期看在经历上涨后下半年有整固消化估值的需求,但在资金面整体较为宽松、股票市场赚钱效应逐步显现、债券利率不高、股票市场整体估值仍然合理的情况下,股票市场长期向好的趋势并没有改变。从行业上看,2020 年下半年,医药、食品饮料等估值处于历史高位的行业继续提升估值的空间可能有限,需要通过一段时间的利润增长来消化估值。而基本面处于改善的拐点、估值处于较低位置且市场关注度不高的行业可能会取得更好的相对收益。

从债券市场看,伴随经济基本面复苏和货币政策回归正常化,债券市场预计维持震荡。随着货币政策回归正常化,支撑前期快速下行的流动性宽松环境已结束,货币政策着力点在于扶持实体经济,基础货币减少和货币乘数持续上行的组合下无风险利率不具备大幅下行的基础。

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。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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场债券品种的估值数据及交易所交易的债券品种的估值数据、流通受限股票流动性折扣。

4.7 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“6.4.11 利润分配情况”。

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合规守信情况声明

本报告期内，中国银河证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人按照《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法复核西部利得基金管理有限公司编制和披露的西部利得新润灵活配置混合型证券投资基金 2020 年中期报告中财务指标、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，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：西部利得新润灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	15,555,057.39	5,751,145.46
结算备付金		657,749.70	945,920.72
存出保证金		50,350.61	80,439.83
交易性金融资产	6.4.7.2	269,564,020.09	228,415,109.51
其中：股票投资		258,171,379.59	212,084,879.11
基金投资		-	-
债券投资		11,392,640.50	16,330,230.40
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	31,000,000.00	32,000,000.00
应收证券清算款		-	517.12
应收利息	6.4.7.5	300,748.27	257,113.89
应收股利		-	-
应收申购款		7,426.10	32,770.68
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		317,135,352.16	267,483,017.21
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 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		-	-
应付证券清算款		916,806.77	-
应付赎回款		61,473.72	15,630.36
应付管理人报酬		370,449.08	345,887.94
应付托管费		24,696.61	23,059.19
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	31,998.24	35,214.40
应交税费		3.49	0.22

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	93,675.03	139,023.30
负债合计		1,499,102.94	558,815.41
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	227,481,101.92	212,896,480.11
未分配利润	6.4.7.10	88,155,147.30	54,027,721.69
所有者权益合计		315,636,249.22	266,924,201.80
负债和所有者权益总计		317,135,352.16	267,483,017.21

报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.388 元，基金份额总额 227,481,101.92 份。

6.2 利润表

会计主体：西部利得新润灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		34,401,595.55	14,143,192.97
1.利息收入		588,622.05	409,212.64
其中：存款利息收入	6.4.7.11	57,109.18	26,837.99
债券利息收入		231,949.61	207,690.05
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		299,563.26	174,684.60
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		17,696,413.84	5,301,177.39
其中：股票投资收益	6.4.7.12	14,202,056.31	3,085,364.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-11,955.64	156,059.43
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	3,506,313.17	2,059,753.59
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	15,569,804.44	8,431,589.04
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	546,755.22	1,213.90
减：二、费用		2,445,755.65	1,426,310.91
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,055,162.41	1,172,174.93
2. 托管费	6.4.10.2.2	137,010.89	78,145.09
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	6.4.7.19	150,446.62	84,458.27
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.37	82.25
7. 其他费用	6.4.7.20	103,135.36	91,450.37
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		31,955,839.90	12,716,882.06
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		31,955,839.90	12,716,882.06

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：西部利得新润灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	212,896,480.11	54,027,721.69	266,924,201.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	31,955,839.90	31,955,839.90
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）	14,584,621.81	2,171,585.71	16,756,207.52
其中：1.基金申购款	225,631,677.40	56,074,221.57	281,705,898.97
2.基金赎回款	-211,047,055.59	-53,902,635.86	-264,949,691.45
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）	227,481,101.92	88,155,147.30	315,636,249.22
项目	上年度可比期间 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)	100,132,916.63	-6,137,199.86	93,995,716.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	12,716,882.06	12,716,882.06
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)	90,705,270.98	9,265,433.84	99,970,704.82
其中：1.基金申购款	90,927,580.32	9,268,957.27	100,196,537.59
2.基金赎回款	-222,309.34	-3,523.43	-225,832.77
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)	190,838,187.61	15,845,116.04	206,683,303.65

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

西部利得新润灵活配置混合型证券投资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[2015]1620 号《关于准予西部利得新润灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》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》和《西部利得新润灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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 228,552,413.29 元,业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第 1700238 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《西部利得新润灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 8 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 228,559,918.41 份基金份额,其中认购资金利息折合 7,505.12 份基金份额。本基金的基金管理人为西部利得基金管理有限公司,基金托管人为中国银河证券股份有

限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《西部利得新润灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券、中期票据、短期融资券、货币市场工具、权证、股指期货、债券回购、银行存款、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票市值占基金资产净值的 0%-95%。其中，基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%。

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〈年度和中期报告〉》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 2020 年度中期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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年度中期的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期末发生会计政策和会计估计变更。

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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(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）运营资管产品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。对资管产品在 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、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(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) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入个人所得税应纳税所得额。

(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) 对投资者从证券投资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，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	15,555,057.39
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：	15,555,057.39

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	220,334,912.30	258,171,379.59	37,836,467.29
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	11,440,383.71	11,392,640.50
	银行间市场	—	—
	合计	11,440,383.71	11,392,640.50
资产支持证券	—	—	—

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	231,775,296.01	269,564,020.09	37,788,724.08

6.4.7.3 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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	31,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	31,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,304.82
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	296.00
应收债券利息	296,027.49
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	3,097.26
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	22.70
合计	300,748.27

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	31,998.24
银行间市场应付交易费用	-
合计	31,998.24

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	139.67
预提费用	93,535.36
合计	93,675.03

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	212,896,480.11	212,896,480.11
本期申购	225,631,677.40	225,631,677.40
本期赎回(以“-”号填列)	-211,047,055.59	-211,047,055.59
- 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	227,481,101.92	227,481,101.92

6.4.7.10 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	25,194,632.77	28,833,088.92	54,027,721.69
本期利润	16,386,035.46	15,569,804.44	31,955,839.90
本期基金份额交易产生的变动数	2,269,247.55	-97,661.84	2,171,585.71
其中：基金申购款	37,729,487.82	18,344,733.75	56,074,221.57
基金赎回款	-35,460,240.27	-18,442,395.59	-53,902,635.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	43,849,915.78	44,305,231.52	88,155,147.30

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	50,823.22
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	5,727.68
其他	558.28
合计	57,109.18

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	44,949,923.09
减：卖出股票成本总额	30,747,866.78
买卖股票差价收入	14,202,056.31

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债	-11,955.64

券到期兑付) 差价收入	
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	-11,955.64

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	7,682,572.84
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	7,488,976.84
减：应收利息总额	205,551.64
买卖债券差价收入	-11,955.64

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末未有债券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末未有债券申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金于本报告期内未持有资产支持证券。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金在本报告期内未持有贵金属。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金在本报告期内未持有贵金属。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内未持有贵金属。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内未持有贵金属。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内未持有衍生工具。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内未持有衍生工具。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,506,313.17
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,506,313.17

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	15,569,804.44
——股票投资	15,611,677.50
——债券投资	-41,873.06
——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	15,569,804.44

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	546,755.19
转换费	0.03

合计	546,755.22
----	------------

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	150,446.62
银行间市场交易费用	—
交易基金产生的费用	—
其中：申购费	—
赎回费	—
合计	150,446.62

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
其他	600.00
债券账户维护费	18,000.00
合计	103,135.36

6.4.7.21 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。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
西部证券股份有限公司	基金管理人的股东
利得科技有限公司	基金管理人的股东
中国银河证券股份有限公司	基金托管人

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30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
银河证券	70,055,630.68	70.88%	85,204,179.24	90.18%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	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 成交总额的比例
银河证券	7,676,881.20	100.00%	17,626,463.38	57.83%

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30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
银河证券	720,500,000.00	100.00%	418,500,000.00	100.00%

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30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
银河证券	49,831.45	76.52%	25,303.97	79.08%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30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
银河证券	60,604.28	92.48%	7,882.95	70.12%

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,055,162.41	1,172,174.93
其中：支付销售机构的客户维护费	5,088.45	-

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 1.50%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×1.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	137,010.89	78,145.09

6.4.10.2.3 销售服务费

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。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
基金合同生效日（2017年8月25日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	3,936,220.47	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	3,936,220.47	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.7304%	-

6.4.10.4.2 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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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
西部证券股份 有限公司	4,024,959.74	1.7694%	-	-

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

截止至报告期末，本基金报告期在基金托管人银河证券无存款余额，同时也无相应存款利息收入。

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单位:股)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
688568	中科 星图	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股流 通受限	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	-
688377	迪威 尔	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 8 日	新股流 通受限	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688027	国盾 量子	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 9 日	新股流 通受限	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688600	皖仪 科技	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月	新股流 通受限	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-

		日	3 日							
300847	中船汉光	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 9 日	新股流通受限	6.94	6.94	1,420	9,854.80	9,854.80	-
300845	捷安高科	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 3 日	新股流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 2 日	新股流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股流通受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300846	首都在线	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 1 日	新股流通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
688178	万德斯	2020 年 1 月 6 日	2020 年 7 月 14 日	网下配售摇号锁定	25.20	39.90	3,704	93,340.80	147,789.60	-
688159	有方科技	2020 年 1 月 16 日	2020 年 7 月 23 日	网下配售摇号锁定	20.35	52.73	3,341	67,989.35	176,170.93	-

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括信用风险、流动性风险、市场风险等。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人实行全员参与的全面风险管理，董事会及其下设合规审核委员会、监事会、经营管理层及其下设合规及风险管理委员会、督察长、风险管理部、监察稽核部、各业务部门和分支机构均根据公司制度规定履行各自的风险管理职责。

6.4.13.2 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。

本基金均投资于具有良好信用等级的证券；银行存款均存放于信用良好的银行；在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	—	—
A-1 以下	—	—
未评级	2,201,060.00	1,000,300.00
合计	2,201,060.00	1,000,300.00

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债、超短期融资券等无信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	—	—
AAA 以下	1,392,900.00	—
未评级	7,798,680.50	15,329,930.40
合计	9,191,580.50	15,329,930.40

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债等无信用评级的债券。

6.4.13.3 流动性风险

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感

性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、存出保证金和结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	15,555,057.39	-	-	-	15,555,057.39
结算备付金	657,749.70	-	-	-	657,749.70
存出保证金	50,350.61	-	-	-	50,350.61
交易性金融资产	11,392,640.50	-	-	258,171,379.59	269,564,020.09
买入返售金融资产	31,000,000.00	-	-	-	31,000,000.00
应收利息	-	-	-	300,748.27	300,748.27
应收申购款	-	-	-	7,426.10	7,426.10
资产总计	58,655,798.20	-	-	258,479,553.96	317,135,352.16
负债					
应付证券清算款	-	-	-	916,806.77	916,806.77
应付赎回款	-	-	-	61,473.72	61,473.72
应付管理人报酬	-	-	-	370,449.08	370,449.08
应付托管费	-	-	-	24,696.61	24,696.61
应付交易费用	-	-	-	31,998.24	31,998.24
应交税费	-	-	-	3.49	3.49
其他负债	-	-	-	93,675.03	93,675.03
负债总计	-	-	-	1,499,102.94	1,499,102.94
利率敏感度缺口	58,655,798.20	-	-	256,980,451.02	315,636,249.22
上年度末 2019 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	5,751,145.46	-	-	-	5,751,145.46
结算备付金	945,920.72	-	-	-	945,920.72
存出保证金	80,439.83	-	-	-	80,439.83
交易性金融资产	16,330,230.40	-	-	212,084,879.11	228,415,109.51

买入返售金融资产	32,000,000.00	-	-	-	32,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	517.12	517.12
应收利息	-	-	-	257,113.89	257,113.89
应收申购款	-	-	-	32,770.68	32,770.68
资产总计	55,107,736.41	-	-	212,375,280.80	267,483,017.21
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	15,630.36	15,630.36
应付管理人报酬	-	-	-	345,887.94	345,887.94
应付托管费	-	-	-	23,059.19	23,059.19
应付交易费用	-	-	-	35,214.40	35,214.40
应交税费	-	-	-	0.22	0.22
其他负债	-	-	-	139,023.30	139,023.30
负债总计	-	-	-	558,815.41	558,815.41
利率敏感度缺口	55,107,736.41	-	-	-211,816,465.39	266,924,201.80

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	258,171,379.59	81.79	212,084,879.11	79.46
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	11,392,640.50	3.61	16,330,230.40	6.12
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	269,564,020.09	85.40	228,415,109.51	85.57

6.4.13.4.3.2 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（2020年6月 30日）	上年度末（2019年12月 31日）
	业绩比较基准上升 5%	21,901,000.00	17,258,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-21,901,000.00	-17,258,000.00

6.4.14 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述的层次，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 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为 257,639,473.73 元，属于第二层次的余额为 11,924,546.36 元，无属于第三层次的余额(2019 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 210,805,439.11 元，属于第二层级的余额为 17,609,670.40 元，无属于第三层级的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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不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或第三层次。

(iii) 第三层次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 2020 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（2019 年 12 月 31 日：同）。

(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	258,171,379.59	81.41
	其中：股票	258,171,379.59	81.41
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	11,392,640.50	3.59
	其中：债券	11,392,640.50	3.59
	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	31,000,000.00	9.78
	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	16,212,807.09	5.11
8	其他各项资产	358,524.98	0.11
9	合计	317,135,352.16	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 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,585,252.00	0.50
B	采矿业	696,460.00	0.22
C	制造业	178,351,522.54	56.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,604,202.32	2.73
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	2,155,825.00	0.68
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,273,994.13	7.37
J	金融业	37,107,156.00	11.76
K	房地产业	4,234,122.00	1.34
L	租赁和商务服务业	185,556.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	220,869.60	0.07
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	1,756,420.00	0.56
S	综合	-	-
	合计	258,171,379.59	81.79

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	002241	歌尔股份	742,000	21,785,120.00	6.90
2	002624	完美世界	307,624	17,731,447.36	5.62
3	603566	普莱柯	510,000	14,121,900.00	4.47
4	600566	济川药业	456,436	11,620,860.56	3.68
5	603298	杭叉集团	1,010,800	11,139,016.00	3.53
6	601166	兴业银行	702,000	11,077,560.00	3.51
7	601601	中国太保	367,000	10,000,750.00	3.17
8	600332	白云山	282,000	9,117,060.00	2.89
9	600674	川投能源	926,800	8,591,436.00	2.72
10	002271	东方雨虹	187,200	7,605,936.00	2.41
11	600201	生物股份	265,000	7,377,600.00	2.34
12	002664	长鹰信质	536,800	7,096,496.00	2.25
13	601318	中国平安	98,000	6,997,200.00	2.22
14	603788	宁波高发	379,000	6,795,470.00	2.15
15	002815	崇达技术	324,000	6,554,520.00	2.08
16	002508	老板电器	201,900	6,281,109.00	1.99
17	600835	上海机电	361,000	6,111,730.00	1.94
18	002444	巨星科技	500,000	5,940,000.00	1.88
19	000333	美的集团	95,100	5,686,029.00	1.80
20	600285	羚锐制药	548,000	5,123,800.00	1.62
21	600176	中国巨石	552,800	5,058,120.00	1.60
22	600637	东方明珠	517,100	4,990,015.00	1.58
23	000069	华侨城 A	698,700	4,234,122.00	1.34
24	601398	工商银行	847,700	4,221,546.00	1.34
25	600597	光明乳业	262,000	3,893,320.00	1.23

26	600741	华域汽车	162,500	3,378,375.00	1.07
27	603228	景旺电子	95,280	3,352,903.20	1.06
28	002236	大华股份	163,400	3,138,914.00	0.99
29	300395	菲利华	89,100	2,928,717.00	0.93
30	600750	江中药业	230,000	2,907,200.00	0.92
31	002273	水晶光电	157,900	2,706,406.00	0.86
32	300136	信维通信	44,200	2,343,484.00	0.74
33	600993	马应龙	88,900	2,155,825.00	0.68
34	600612	老凤祥	42,500	2,048,075.00	0.65
35	601211	国泰君安	110,800	1,912,408.00	0.61
36	600519	贵州茅台	1,200	1,755,456.00	0.56
37	000423	东阿阿胶	49,000	1,754,690.00	0.56
38	601098	中南传媒	159,000	1,682,220.00	0.53
39	300476	胜宏科技	69,000	1,659,450.00	0.53
40	002372	伟星新材	138,000	1,604,940.00	0.51
41	300498	温氏股份	66,000	1,438,800.00	0.46
42	600486	扬农化工	14,600	1,204,500.00	0.38
43	600104	上汽集团	66,900	1,136,631.00	0.36
44	601138	工业富联	63,400	960,510.00	0.30
45	601288	农业银行	247,300	835,874.00	0.26
46	600066	宇通客车	64,700	789,340.00	0.25
47	002179	中航光电	18,400	754,584.00	0.24
48	600705	中航资本	186,800	739,728.00	0.23
49	601088	中国神华	48,500	696,460.00	0.22
50	600030	中信证券	25,000	602,750.00	0.19
51	002182	云海金属	53,179	507,327.66	0.16
52	300003	乐普医疗	13,200	482,064.00	0.15
53	601688	华泰证券	24,000	451,200.00	0.14
54	002191	劲嘉股份	36,800	327,888.00	0.10
55	002555	三七互娱	6,000	280,800.00	0.09
56	601198	东兴证券	24,600	268,140.00	0.08
57	600138	中青旅	18,800	185,556.00	0.06
58	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.06
59	688159	有方科技	3,341	176,170.93	0.06
60	600309	万华化学	3,000	149,970.00	0.05
61	688178	万德斯	3,704	147,789.60	0.05
62	300761	立华股份	3,800	146,452.00	0.05
63	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.04
64	000977	浪潮信息	2,800	109,704.00	0.03

65	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.03
66	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.03
67	002985	北摩高科	782	97,335.54	0.03
68	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.03
69	600406	国电南瑞	4,000	81,000.00	0.03
70	000887	中鼎股份	10,000	78,500.00	0.02
71	688169	石头科技	200	75,380.00	0.02
72	600229	城市传媒	10,000	74,200.00	0.02
73	300070	碧水源	9,000	73,080.00	0.02
74	002475	立讯精密	1,300	66,755.00	0.02
75	002422	科伦药业	2,000	42,000.00	0.01
76	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.01
77	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
78	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
79	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
80	300847	中船汉光	1,420	9,854.80	0.00
81	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
82	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
83	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
84	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

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	002664	长鹰信质	6,817,957.00	2.55
2	600285	羚锐制药	4,488,041.00	1.68
3	603228	景旺电子	2,848,004.00	1.07
4	601166	兴业银行	2,696,103.00	1.01
5	601601	中国太保	2,451,825.00	0.92
6	600332	白云山	2,372,660.00	0.89
7	600566	济川药业	2,283,072.40	0.86
8	601318	中国平安	2,108,932.00	0.79
9	603566	普莱柯	1,833,900.00	0.69
10	300136	信维通信	1,710,821.00	0.64
11	000069	华侨城 A	1,607,365.00	0.60

12	002624	完美世界	1,477,349.00	0.55
13	300476	胜宏科技	1,379,360.00	0.52
14	000333	美的集团	1,303,445.00	0.49
15	600176	中国巨石	1,200,106.00	0.45
16	601138	工业富联	1,158,244.00	0.43
17	603298	杭叉集团	1,090,977.00	0.41
18	601211	国泰君安	1,053,216.00	0.39
19	600674	川投能源	1,051,986.00	0.39
20	002241	歌尔股份	1,020,752.00	0.38

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	002624	完美世界	4,872,483.88	1.83
2	603328	依顿电子	4,613,136.00	1.73
3	600750	江中药业	3,097,297.00	1.16
4	600201	生物股份	1,625,903.00	0.61
5	600029	南方航空	1,121,841.00	0.42
6	688126	沪硅产业	1,100,983.52	0.41
7	600305	恒顺醋业	904,905.00	0.34
8	688363	华熙生物	904,026.00	0.34
9	688396	华润微	899,977.26	0.34
10	688233	神工股份	767,020.14	0.29
11	688169	石头科技	760,487.47	0.28
12	002241	歌尔股份	757,260.00	0.28
13	688200	华峰测控	705,559.28	0.26
14	600598	北大荒	676,974.00	0.25
15	688177	百奥泰	656,388.03	0.25
16	688158	优刻得	625,986.87	0.23
17	603566	普莱柯	625,416.00	0.23
18	688208	道通科技	574,111.95	0.22
19	688086	紫晶存储	567,290.75	0.21
20	002444	巨星科技	564,799.00	0.21

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	61,222,689.76
卖出股票收入（成交）总额	44,949,923.09

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,999,740.50	3.17
	其中：政策性金融债	9,999,740.50	3.17
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,392,900.00	0.44
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,392,640.50	3.61

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	018007	国开 1801	77,870	7,798,680.50	2.47
2	018061	进出 1911	12,000	1,200,960.00	0.38
3	108801	进出 1901	10,000	1,000,100.00	0.32
4	128112	歌尔转 2	9,361	936,100.00	0.30
5	128115	巨星转债	4,568	456,800.00	0.14

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金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	50,350.61
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	300,748.27
5	应收申购款	7,426.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	358,524.98

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。

§ 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

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
473	480,932.56	226,074,102.10	99.38%	1,406,999.82	0.62%

8.2 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	112,585.86	0.0495%

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	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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2017 年 8 月 25 日 ）基金份额总额	228,559,918.41
本报告期期初基金份额总额	212,896,480.11
本报告期基金总申购份额	225,631,677.40
减：本报告期基金总赎回份额	211,047,055.59
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	227,481,101.92

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。

§ 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无重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、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，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况如下：2020 年 4 月 22 日，北京证监局向公司下发《行政监管措施决定书（中国银河证券股份有限公司）》（〔2020〕64 号），针对公司持有一种非权益类证券超规模；作为私募股权投资基金托管人，根据基金管理人提供的单方说明变更收款账户，将基金财产划至管理人账户等行为出具行政监管处罚措施，责令公司限期改正，要求公司完善内部控制，加强风险控制指标监控，及时发现并报告相关情况；作为私募股权投资基金托管人，尽职履责，切实履行义务，并于收到决定书之日起 30 日内向北京证监局提交书面整改报告。对于上述事项，公司高度重视并责成相关部门全面、深入查找分析问题根源，采取了有效、有针对性的整改措施，进一步加强风险控制指标监控工作，做好金仕达系统和风险独立监控系统的升级完善工作，加强对风险控制指标的跨部门协同管理工作，并采取有效措施建立长效机制；进一步加强托管业务管理流程，完成对非标产品划款审批流程和合同范本的修订工作，完善对管理人和产品的引入尽调及评审的相关流程，从源头上杜绝私募股权基金托管的风险。公司于 2020 年 5 月 22 日向北京证监局报送了《公司就〈关于对中国银河证券股份有限公司采取责令改正措施的决定〉整改情况的报告》。

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			
银河证券	2	70,055,630.68	70.88%	49,831.45	76.52%	—
国金证券	1	28,785,369.46	29.12%	15,293.69	23.48%	—
东吴证券	2	—	—	—	—	—

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
银河证券	7,676,881.20	100.00%	720,500,000.00	100.00%	—	—
国金证券	—	—	—	—	—	—
东吴证券	—	—	—	—	—	—

10.8 其他重大事件

本报告期内本基金未发生其他重大事件。

§ 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	2020/1/1-2020/4/2	90,743,194.19	53,969,930.61	90,743,194.19	53,969,930.61	23.73%
	2	2020/1/1-2020/6/30	107,022,656.20	0.00	0.00	107,022,656.20	47.05%
	3	2020/4/3-2020/6/9	0.00	109,242,857.10	109,242,857.10	0.00	0.00%
	4	2020/6/8-2020/6/30	90,743,194.19	53,969,930.61	90,743,194.19	53,969,930.61	23.73%
	5	2020/6/10-2020/6/30	0.00	57,120,335.11	0.00	57,120,335.11	25.11%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准本基金设立的相关文件；
- (2) 本基金《基金合同》；
- (3) 本基金《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。

12.2 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

12.3 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

2020 年 8 月 31 日