

# 西部利得事件驱动股票型证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设银行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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
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.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
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
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
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.....	11
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
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
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
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
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	50
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>51</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
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.....	51
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>52</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 其他重大事件.....	55
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>56</b>

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 .....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	56
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>57</b>
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	西部利得事件驱动股票型证券投资基金
基金简称	西部利得事件驱动股票
场内简称	-
基金主代码	671030
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	2018 年 9 月 26 日
基金管理人	西部利得基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,381,800.52 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	通过提前挖掘和深入分析可能造成股价异常波动的公司事件，并运用高频交易模型进行筛选，力争在有效控制风险的前提下，充分把握交易时机为投资者获取超额投资回报。
投资策略	本基金是以股票为主要投资对象，由于股票资产的波动性较大，所以本产品面临的回撤风险较高，适合风险承受能力较高的投资者。在具体投资中，通过自上而下与自下而上相结合的方法，以权益性资产为主要配置资产，重点通过跟踪宏观经济数据、政策环境的变化趋势，来做前瞻性的战略判断，同时深入分析行业景气度，产业上下游，以及公司运营情况，结合市场短期影响因素，通过适时调整所持仓的资产，从而达到对投资组合进行优化的目标。（详见《基金合同》）
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是一只主动型股票基金，属于具有较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，风险与预期收益均高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金力争在严格控制风险的情况下实现基金资产长期增值。

## 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵毅	李申
	联系电话	021-38572888	021-60637102
	电子邮箱	service@westleadfund.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4007-007-818;021-38572666	021-60637111
传真		021-38572750	021-60635778
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	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 11 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200127	100033
法定代表人		何方	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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	999,249.82
本期利润	-396,224.86
加权平均基金份额本期利润	-0.0291
本期加权平均净值利润率	-2.13%
本期基金份额净值增长率	6.00%
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	1,669,390.93
期末可供分配基金份额利润	0.4936
期末基金资产净值	5,051,191.45
期末基金份额净值	1.4936
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	49.36%

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

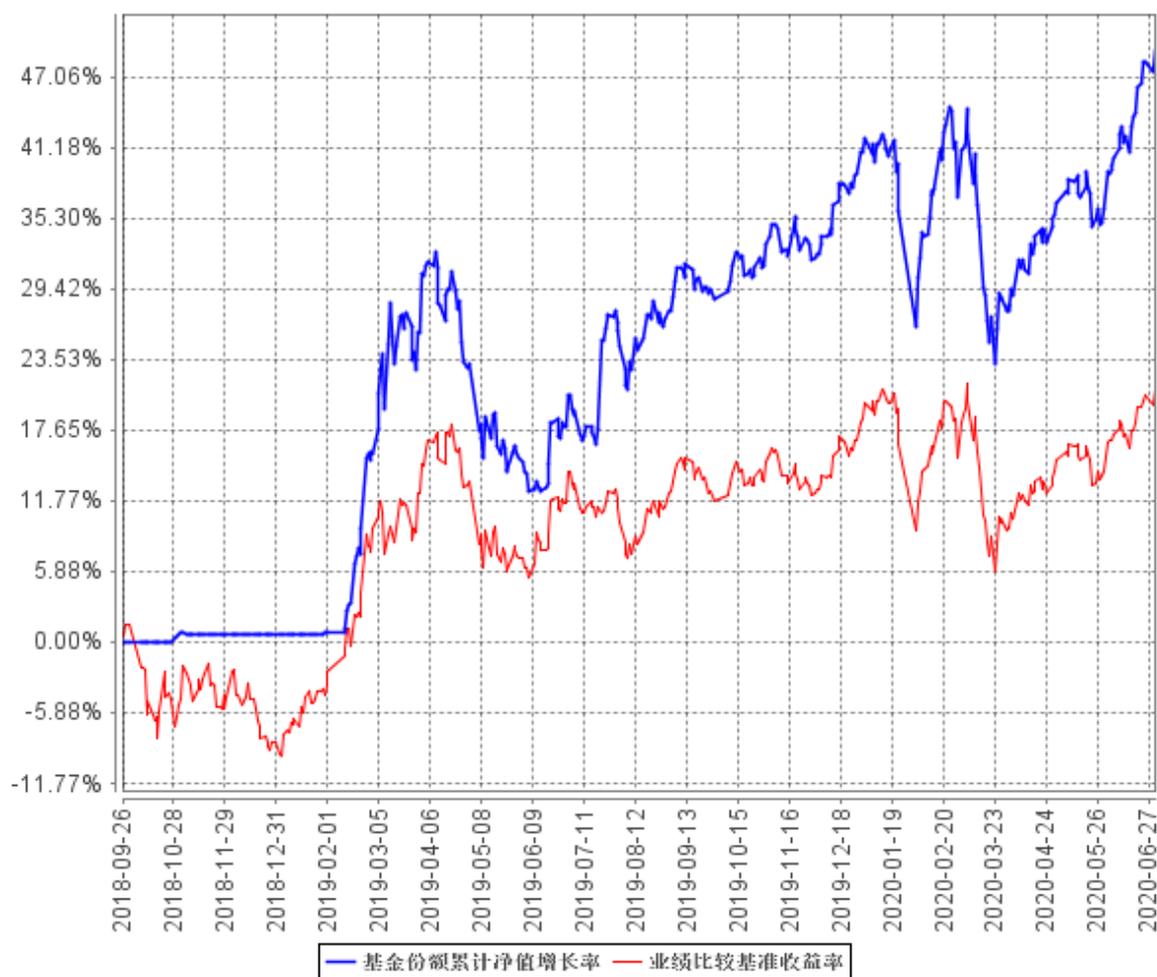
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	9.77%	0.81%	6.08%	0.72%	3.69%	0.09%
过去三个月	16.57%	0.84%	10.42%	0.72%	6.15%	0.12%
过去六个月	6.00%	1.41%	2.13%	1.21%	3.87%	0.20%
过去一年	26.52%	1.17%	8.44%	0.97%	18.08%	0.20%
自基金合同生效起至今	49.36%	1.15%	21.11%	1.11%	28.25%	0.04%

本基金的业绩基准指数=沪深300指数收益率\*80%+上证国债指数收益率\*20%

### 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		
刘荟	公募投资部副总经理、基金经理	2018年9月26日	-	12年	辽宁大学理学硕士，曾任群益证券股份有限公司研究员。2014年1月加入本公司，具有基金从业资格，中国国籍。
童国林	总经理助理、基金经理	2020年2月24日	-	25年	中南财经大学货币银行学硕士。曾任深圳中航企业集团财务部会计，君安证券公司研究所研究员，甘肃证券深圳代表处投资经理，华宝兴业基金公司研究总监、基金经理，富国基金公司首席策略分析师，天弘基金公司总经理助理兼投资总监，上海安苏投资管理有限公司总经理，长江证券股份有限公司投资经理，长江证券（上海）资产管理有限公司权益投资部总经理，凯石基金管理有限公司投资八部总经理。于2018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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

本报告期内，两两组合间单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为 0 的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

### 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

报告期内，本基金执行“以较小的跟踪误差获得超越目标指数的收益”的投资目标，并据此实施相应的投资策略。

报告期内，为减小对目标指数的跟踪误差，本基金扩大了对目标指数成分股的投资数量。同时，本基金在寻找能够带来超额收益的驱动事件时，采用了一定的量化投资模型。本基金管理团队采用了聚类算法，对目标指数的成分股进行分组，据此挑选一定的股票进行分析，并进行增强操作。

报告期内，结合量化投资模型，并从基本面进行分析，本基金对于医药（特别是疫苗）、食品饮料、信息技术等行业的股票进行了超配。

报告期内，本基金业绩表现优于比较基准。管理团队将谨慎评估本基金风险收益特征的持续性，并持续研究投资策略的优化和改进。

#### 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

本基金认为，随着中国改革、开放的继续深入开展，中国经济增长的潜力将会更加持续的得到发挥，中国证券市场的基础将更加稳固。

从经济发展方面看，虽然年初的新冠疫情突然出现，并持续扩散到全球，但中国迅速控制住疫情，随后经济全面重启，进入 2 季度后经济全面复苏。这既反映出中国经济的潜在动力，也证明了中国政府的治理能力；再进一步，中国政府的治理能力再次保证中国经济的发展潜力。特别是，在中国经济步入中等收入国家水平后，向更高层次的经济结构迈进，对外开放的力度更大（负面清单越来越少），对内的市场化程度更高，因此，我们可以期待中国经济的效率越来越高，资产回报率持续提升。

从证券市场来看，随着时间推进，投资者教育，包括上市公司的教育，逐步深入；资本市场资源优化配置功能得到充分体现，优秀上市公司得到市场的充分认可，而落后公司逐渐被市场淘汰。同时，随着法治的健全，如《证券法》修订，监管力度的加强，上市公司治理结构得到改善，优秀上市公司越来越多。本基金认为，中国证券投资的前景越来越稳定。

从行业来看，更多体现的是资源优化配置的功能。我们整体上认为，证券市场的行业优势具有轮动性特点，同时，部分行业或个股的优势确实有可能持续较长时间。我们将综合各种分析，研判投资组合中的行业配置。

#### 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、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**

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的情形。

本报告期内，本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，管理人已经向中国证券监督管理委员会报告并提出解决方案。

## § 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：西部利得事件驱动股票型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	86,809.07	3,421,265.21
结算备付金		32,619.43	10,200.71
存出保证金		29,671.19	31,664.59
交易性金融资产	6.4.7.2	5,551,298.24	22,244,576.27
其中：股票投资		4,649,948.24	22,244,576.27
基金投资		-	-
债券投资		901,350.00	-
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	-	-
应收证券清算款		137,339.25	-
应收利息	6.4.7.5	28,806.24	750.74
应收股利		-	-
应收申购款		2,984.84	63,808.35
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,869,528.26	25,772,265.87
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
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		600,000.00	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		115,818.98	72,675.53
应付管理人报酬		5,005.01	59,371.21
应付托管费		834.18	9,895.23
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	26,364.98	73,306.63
应交税费		-	-

应付利息		55.84	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	70,257.82	100,169.79
负债合计		818,336.81	315,418.39
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	3,381,800.52	18,067,550.38
未分配利润	6.4.7.10	1,669,390.93	7,389,297.10
所有者权益合计		5,051,191.45	25,456,847.48
负债和所有者权益总计		5,869,528.26	25,772,265.87

报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4936 元，基金份额总额 3,381,800.52 份。

## 6.2 利润表

会计主体：西部利得事件驱动股票型证券投资基金

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
<b>一、收入</b>		-93,620.30	7,268,200.62
1.利息收入		18,683.01	64,069.10
其中：存款利息收入	6.4.7.11	7,151.66	44,807.49
债券利息收入		11,531.35	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	19,261.61
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,261,548.20	3,429,636.24
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,228,640.39	2,761,391.21
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-4,713.15	-
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	37,620.96	668,245.03
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,395,474.68	3,666,390.78
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	21,623.17	108,104.50
<b>减：二、费用</b>		302,604.56	406,176.07
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	111,348.39	142,579.75
2. 托管费	6.4.10.2.2	18,558.03	23,763.35
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	6.4.7.19	147,998.03	173,776.99
5. 利息支出		3,906.69	-
其中：卖出回购金融资产支出		3,906.69	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	20,793.42	66,055.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-396,224.86	6,862,024.55
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-396,224.86	6,862,024.55

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：西部利得事件驱动股票型证券投资基金

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）	18,067,550.38	7,389,297.10	25,456,847.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-396,224.86	-396,224.86
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）	-14,685,749.86	-5,323,681.31	-20,009,431.17
其中：1.基金申购款	1,909,741.24	804,484.37	2,714,225.61
2.基金赎回款	-16,595,491.10	-6,128,165.68	-22,723,656.78
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）	3,381,800.52	1,669,390.93	5,051,191.45
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		



根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《西部利得事件驱动股票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(含创业板、中小板及其他中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货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(但需符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，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：股票资产占基金资产的 80%-95%；权证投资比例不高于基金资产净值的 3%；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，本基金保留的现金或者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。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率\*80%+上证国债指数收益率\*20%。

#### **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 2020 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 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 重要会计政策和会计估计**

本基金本报告期未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	86,809.07
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：	86,809.07

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

### 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	4,169,015.81	4,649,948.24	480,932.43
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	903,960.85	901,350.00
	银行间市场	-	-
	合计	903,960.85	901,350.00
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	5,072,976.66	5,551,298.24	478,321.58

### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 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	36.44
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	14.20
应收债券利息	28,742.30
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	13.30
合计	28,806.24

### 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	26,364.98
银行间市场应付交易费用	-
合计	26,364.98

**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	176.15
预提费用	70,081.67
合计	70,257.82

**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	18,067,550.38	18,067,550.38
本期申购	1,909,741.24	1,909,741.24
本期赎回(以“-”号填列)	-16,595,491.10	-16,595,491.10
- 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	3,381,800.52	3,381,800.52

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

**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	10,063,062.20	-2,673,765.10	7,389,297.10
本期利润	999,249.82	-1,395,474.68	-396,224.86

本期基金份额交易产生的变动数	-8,901,343.92	3,577,662.61	-5,323,681.31
其中：基金申购款	1,174,731.31	-370,246.94	804,484.37
基金赎回款	-10,076,075.23	3,947,909.55	-6,128,165.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,160,968.10	-491,577.17	1,669,390.93

#### 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	6,360.80
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	556.85
其他	234.01
合计	7,151.66

#### 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	58,919,720.25
减：卖出股票成本总额	57,691,079.86
买卖股票差价收入	1,228,640.39

#### 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（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-4,713.15
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	-4,713.15
----	-----------

#### 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	929,956.44
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	908,853.15
减：应收利息总额	25,816.44
买卖债券差价收入	-4,713.15

#### 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	37,620.96
基金投资产生的股利收益	-
合计	37,620.96

**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	-1,395,474.68
——股票投资	-1,392,863.83
——债券投资	-2,610.85
——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	-1,395,474.68

**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	21,110.97
转换费收入	512.20

合计	21,623.17
----	-----------

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额不低于 25% 的部分归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费不低于 25% 的部分归入转出基金的基金资产。

#### 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	147,998.03
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	147,998.03

#### 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	20,081.67
信息披露费	-
银行汇划手续费	711.75
合计	20,793.42

#### 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
中国建设银行股份有限公司	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
西部证券	44,336,084.07	44.16%	12,001,904.98	8.05%

#### 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
西部证券	1,211,804.20	44.60%	-	-

### 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
西部证券	3,000,000.00	56.60%	-	-

### 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
西部证券	41,281.12	51.49%	14,166.13	53.73%
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
西部证券	11,177.36	8.76%	10,480.84	10.97%

### 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	111,348.39	142,579.75
其中：支付销售机构的客 户维护费	15,313.40	28,209.20

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 1.20%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×1.20% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年6月30日		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	18,558.03		23,763.35	

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.2% 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×0.2%/当年天数。

#### 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

本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 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

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。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年6月30日		2019年1月1日至2019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
中国建设银行股份有限公司	86,809.07	6,360.80	6,557,176.78	24,942.30

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

2. 本基金通过“建设银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2020年6月30日的相关余额为人民币32,619.43元。

#### 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

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。

##### 6.4.12.2 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	901,350.00	-
合计	901,350.00	-

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	-	-
未评级	901,350.00	-
合计	901,350.00	-

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	86,809.07	-	-	-	86,809.07
结算备付金	32,619.43	-	-	-	32,619.43
存出保证金	29,671.19	-	-	-	29,671.19
交易性金融资产	901,350.00	-	-	4,649,948.24	5,551,298.24
应收证券清算款	-	-	-	137,339.25	137,339.25
应收利息	-	-	-	28,806.24	28,806.24
应收申购款	-	-	-	2,984.84	2,984.84
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,050,449.69	-	-	4,819,078.57	5,869,528.26
负债					
卖出回购金融资产款	600,000.00	-	-	-	600,000.00
应付赎回款	-	-	-	115,818.98	115,818.98
应付管理人报酬	-	-	-	5,005.01	5,005.01
应付托管费	-	-	-	834.18	834.18
应付交易费用	-	-	-	26,364.98	26,364.98
应付利息	-	-	-	55.84	55.84
其他负债	-	-	-	70,257.82	70,257.82
负债总计	600,000.00	-	-	218,336.81	818,336.81
利率敏感度缺口	450,449.69	-	-	4,600,741.76	5,051,191.45
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	3,421,265.21	-	-	-	3,421,265.21
结算备付金	10,200.71	-	-	-	10,200.71
存出保证金	31,664.59	-	-	-	31,664.59
交易性金融资产	-	-	-	22,244,576.27	22,244,576.27
应收利息	-	-	-	750.74	750.74
应收申购款	-	-	-	63,808.35	63,808.35
资产总计	3,463,130.51	-	-	22,309,135.36	25,772,265.87
负债					
应付赎回款	-	-	-	72,675.53	72,675.53
应付管理人报酬	-	-	-	59,371.21	59,371.21
应付托管费	-	-	-	9,895.23	9,895.23
应付交易费用	-	-	-	73,306.63	73,306.63
其他负债	-	-	-	100,169.79	100,169.79
负债总计	-	-	-	315,418.39	315,418.39

利率敏感度缺口	3,463,130.51	-	-	21,993,716.97	25,456,847.48
---------	--------------	---	---	---------------	---------------

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 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	4,649,948.24	92.06	22,244,576.27	87.38
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	901,350.00	17.84	-	-
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	5,551,298.24	109.90	22,244,576.27	87.38

**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%	203,000.00	819,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-203,000.00	-819,000.00

**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 4,649,948.24 元，属于第二层次的余额为 901,350.00 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 19,798,919.15 元，属于第二层级的余额为 2,445,657.12 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	4,649,948.24	79.22
	其中：股票	4,649,948.24	79.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	901,350.00	15.36
	其中：债券	901,350.00	15.36
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	119,428.50	2.03
8	其他各项资产	198,801.52	3.39
9	合计	5,869,528.26	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	56,136.00	1.11
B	采矿业	73,523.00	1.46
C	制造业	2,483,599.40	49.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	138,662.00	2.75
E	建筑业	63,102.00	1.25
F	批发和零售业	32,509.00	0.64
G	交通运输、仓储和邮政业	172,117.50	3.41
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	323,874.00	6.41
J	金融业	863,610.44	17.10
K	房地产业	115,997.00	2.30
L	租赁和商务服务业	43,562.00	0.86
M	科学研究和技术服务业	21,638.40	0.43
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	2,775.00	0.05
Q	卫生和社会工作	154,260.50	3.05
R	文化、体育和娱乐业	104,582.00	2.07
S	综合	-	-
	合计	4,649,948.24	92.06

### 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	600519	贵州茅台	200	292,576.00	5.79
2	300142	沃森生物	4,000	209,440.00	4.15
3	000661	长春高新	400	174,120.00	3.45
4	601318	中国平安	2,300	164,220.00	3.25
5	002410	广联达	2,300	160,310.00	3.17
6	300122	智飞生物	1,600	160,240.00	3.17
7	002475	立讯精密	2,960	151,996.00	3.01
8	300015	爱尔眼科	3,150	136,867.50	2.71
9	600900	长江电力	5,800	109,852.00	2.17
10	002352	顺丰控股	1,900	103,930.00	2.06
11	300124	汇川技术	2,600	98,774.00	1.96
12	002271	东方雨虹	2,400	97,512.00	1.93
13	002007	华兰生物	1,920	96,211.20	1.90
14	300144	宋城演艺	5,340	92,382.00	1.83
15	002555	三七互娱	1,700	79,560.00	1.58
16	600036	招商银行	2,202	74,251.44	1.47
17	000858	五粮液	400	68,448.00	1.36
18	600276	恒瑞医药	700	64,610.00	1.28
19	000333	美的集团	1,000	59,790.00	1.18
20	000651	格力电器	1,000	56,570.00	1.12
21	601166	兴业银行	2,600	41,028.00	0.81
22	600030	中信证券	1,700	40,987.00	0.81
23	600031	三一重工	2,000	37,520.00	0.74
24	600887	伊利股份	1,200	37,356.00	0.74
25	000002	万科 A	1,400	36,596.00	0.72

26	002714	牧原股份	440	36,080.00	0.71
27	601398	工商银行	7,200	35,856.00	0.71
28	601888	中国中免	200	30,806.00	0.61
29	601328	交通银行	5,700	29,241.00	0.58
30	600585	海螺水泥	500	26,455.00	0.52
31	002142	宁波银行	1,000	26,270.00	0.52
32	000725	京东方 A	5,600	26,152.00	0.52
33	000001	平安银行	2,000	25,600.00	0.51
34	000100	TCL 科技	4,100	25,420.00	0.50
35	600000	浦发银行	2,400	25,392.00	0.50
36	600016	民生银行	4,400	24,948.00	0.49
37	002415	海康威视	800	24,280.00	0.48
38	600048	保利地产	1,600	23,648.00	0.47
39	603986	兆易创新	100	23,591.00	0.47
40	300059	东方财富	1,140	23,028.00	0.46
41	601688	华泰证券	1,200	22,560.00	0.45
42	601668	中国建筑	4,600	21,942.00	0.43
43	603259	药明康德	224	21,638.40	0.43
44	002594	比亚迪	300	21,540.00	0.43
45	601012	隆基股份	500	20,365.00	0.40
46	601288	农业银行	6,000	20,280.00	0.40
47	600837	海通证券	1,600	20,128.00	0.40
48	000063	中兴通讯	500	20,065.00	0.40
49	300498	温氏股份	920	20,056.00	0.40
50	601601	中国太保	700	19,075.00	0.38
51	000568	泸州老窖	200	18,224.00	0.36
52	601899	紫金矿业	4,000	17,600.00	0.35
53	601229	上海银行	2,100	17,430.00	0.35
54	603288	海天味业	140	17,416.00	0.34
55	600436	片仔癀	100	17,025.00	0.34
56	300601	康泰生物	100	16,216.00	0.32
57	601211	国泰君安	900	15,534.00	0.31
58	601988	中国银行	4,400	15,312.00	0.30
59	601169	北京银行	3,100	15,190.00	0.30
60	600309	万华化学	300	14,997.00	0.30
61	600547	山东黄金	400	14,648.00	0.29
62	600809	山西汾酒	100	14,500.00	0.29
63	601766	中国中车	2,600	14,482.00	0.29
64	600009	上海机场	200	14,414.00	0.29

65	600570	恒生电子	130	14,001.00	0.28
66	000338	潍柴动力	1,000	13,720.00	0.27
67	600104	上汽集团	800	13,592.00	0.27
68	600196	复星医药	400	13,540.00	0.27
69	600745	闻泰科技	100	12,595.00	0.25
70	601818	光大银行	3,500	12,530.00	0.25
71	600703	三安光电	500	12,500.00	0.25
72	600690	海尔智家	700	12,390.00	0.25
73	000876	新希望	400	11,920.00	0.24
74	002241	歌尔股份	400	11,744.00	0.23
75	002027	分众传媒	2,100	11,697.00	0.23
76	002001	新和成	400	11,640.00	0.23
77	001979	招商蛇口	700	11,508.00	0.23
78	600919	江苏银行	2,000	11,340.00	0.22
79	002230	科大讯飞	300	11,229.00	0.22
80	600999	招商证券	500	10,975.00	0.22
81	300003	乐普医疗	300	10,956.00	0.22
82	601628	中国人寿	400	10,884.00	0.22
83	300136	信维通信	200	10,604.00	0.21
84	600588	用友网络	240	10,584.00	0.21
85	002304	洋河股份	100	10,514.00	0.21
86	300347	泰格医药	100	10,188.00	0.20
87	600406	国电南瑞	500	10,125.00	0.20
88	601088	中国神华	700	10,052.00	0.20
89	002841	视源股份	100	9,952.00	0.20
90	600050	中国联通	2,000	9,680.00	0.19
91	601009	南京银行	1,300	9,529.00	0.19
92	002311	海大集团	200	9,518.00	0.19
93	000538	云南白药	100	9,381.00	0.19
94	000895	双汇发展	200	9,218.00	0.18
95	300014	亿纬锂能	190	9,091.50	0.18
96	002129	中环股份	400	8,984.00	0.18
97	601336	新华保险	200	8,856.00	0.18
98	600183	生益科技	300	8,781.00	0.17
99	600438	通威股份	500	8,690.00	0.17
100	600019	宝钢股份	1,900	8,664.00	0.17
101	000938	紫光股份	200	8,596.00	0.17
102	000166	申万宏源	1,700	8,585.00	0.17
103	601390	中国中铁	1,700	8,534.00	0.17

104	000776	广发证券	600	8,472.00	0.17
105	601006	大秦铁路	1,200	8,448.00	0.17
106	601857	中国石油	2,000	8,380.00	0.17
106	601186	中国铁建	1,000	8,380.00	0.17
107	600741	华域汽车	400	8,316.00	0.16
108	600089	特变电工	1,200	8,124.00	0.16
109	002120	韵达股份	330	8,068.50	0.16
110	601100	恒立液压	100	8,020.00	0.16
111	600015	华夏银行	1,300	7,956.00	0.16
112	000977	浪潮信息	200	7,836.00	0.16
113	002236	大华股份	400	7,684.00	0.15
114	603019	中科曙光	200	7,680.00	0.15
115	600352	浙江龙盛	600	7,674.00	0.15
116	002602	世纪华通	500	7,655.00	0.15
117	601989	中国重工	1,900	7,600.00	0.15
118	601933	永辉超市	800	7,504.00	0.15
119	002456	欧菲光	400	7,356.00	0.15
120	002044	美年健康	500	7,205.00	0.14
121	002008	大族激光	200	7,190.00	0.14
122	000157	中联重科	1,100	7,073.00	0.14
123	002024	苏宁易购	800	7,016.00	0.14
124	600346	恒力石化	500	7,000.00	0.14
125	600383	金地集团	500	6,850.00	0.14
126	300628	亿联网络	100	6,826.00	0.14
127	600958	东方证券	700	6,643.00	0.13
128	300413	芒果超媒	100	6,520.00	0.13
129	002050	三花智控	290	6,351.00	0.13
130	600660	福耀玻璃	300	6,261.00	0.12
131	600028	中国石化	1,600	6,256.00	0.12
132	601155	新城控股	200	6,248.00	0.12
133	601377	兴业证券	900	6,165.00	0.12
134	601138	工业富联	400	6,060.00	0.12
135	002202	金风科技	600	5,982.00	0.12
136	000425	徐工机械	1,000	5,910.00	0.12
137	601800	中国交建	800	5,872.00	0.12
138	002624	完美世界	100	5,764.00	0.11
139	600522	中天科技	500	5,725.00	0.11
140	600109	国金证券	500	5,705.00	0.11
141	000860	顺鑫农业	100	5,698.00	0.11

142	002736	国信证券	500	5,650.00	0.11
143	300433	蓝思科技	200	5,608.00	0.11
144	300408	三环集团	200	5,540.00	0.11
145	601669	中国电建	1,600	5,536.00	0.11
146	603899	晨光文具	100	5,460.00	0.11
147	000069	华侨城 A	900	5,454.00	0.11
148	000783	长江证券	800	5,392.00	0.11
149	002460	赣锋锂业	100	5,357.00	0.11
150	000768	中航飞机	300	5,322.00	0.11
151	601985	中国核电	1,300	5,317.00	0.11
152	000066	中国长城	400	5,280.00	0.10
153	601877	正泰电器	200	5,270.00	0.10
154	600867	通化东宝	300	5,229.00	0.10
155	600010	宝钢股份	4,800	5,184.00	0.10
156	603993	洛阳钼业	1,400	5,138.00	0.10
157	601108	财通证券	500	5,125.00	0.10
158	000963	华东医药	200	5,060.00	0.10
159	002938	鹏鼎控股	100	5,006.00	0.10
160	002463	沪电股份	200	4,996.00	0.10
161	002773	康弘药业	100	4,960.00	0.10
162	601901	方正证券	700	4,956.00	0.10
163	600487	亨通光电	300	4,923.00	0.10
164	002493	荣盛石化	400	4,920.00	0.10
165	601555	东吴证券	600	4,896.00	0.10
166	601788	光大证券	300	4,818.00	0.10
167	600886	国投电力	600	4,716.00	0.09
168	600893	航发动力	200	4,696.00	0.09
169	600111	北方稀土	500	4,660.00	0.09
170	600029	南方航空	900	4,653.00	0.09
171	002466	天齐锂业	200	4,590.00	0.09
172	600340	华夏幸福	200	4,572.00	0.09
173	600926	杭州银行	500	4,460.00	0.09
174	600795	国电电力	2,400	4,440.00	0.09
175	000625	长安汽车	400	4,400.00	0.09
176	600233	圆通速递	300	4,368.00	0.09
177	600705	中航资本	1,100	4,356.00	0.09
178	600606	绿地控股	700	4,326.00	0.09
179	601162	天风证券	700	4,242.00	0.08
180	600115	东方航空	1,000	4,220.00	0.08

181	002422	科伦药业	200	4,200.00	0.08
182	600038	中直股份	100	4,107.00	0.08
183	002179	中航光电	100	4,101.00	0.08
184	603369	今世缘	100	3,979.00	0.08
185	601111	中国国航	600	3,966.00	0.08
186	601066	中信建投	100	3,938.00	0.08
187	002153	石基信息	100	3,903.00	0.08
188	603799	华友钴业	100	3,886.00	0.08
189	601600	中国铝业	1,400	3,864.00	0.08
190	600637	东方明珠	400	3,860.00	0.08
191	003816	中国广核	1,300	3,848.00	0.08
192	600061	国投资本	300	3,819.00	0.08
193	600011	华能国际	900	3,798.00	0.08
194	601618	中国中冶	1,500	3,765.00	0.07
195	601816	京沪高铁	600	3,738.00	0.07
196	600998	九州通	200	3,724.00	0.07
197	002601	龙蟠佰利	200	3,700.00	0.07
198	601607	上海医药	200	3,676.00	0.07
199	601360	三六零	200	3,662.00	0.07
200	600066	宇通客车	300	3,660.00	0.07
200	600176	中国巨石	400	3,660.00	0.07
201	600489	中金黄金	400	3,656.00	0.07
202	601997	贵阳银行	500	3,580.00	0.07
203	600177	雅戈尔	600	3,576.00	0.07
204	600068	葛洲坝	600	3,570.00	0.07
205	000703	恒逸石化	390	3,560.70	0.07
206	000961	中南建设	400	3,560.00	0.07
207	600390	五矿资本	500	3,530.00	0.07
208	601727	上海电气	700	3,528.00	0.07
209	601021	春秋航空	100	3,524.00	0.07
210	002157	正邦科技	200	3,496.00	0.07
211	002252	上海莱士	400	3,384.00	0.07
212	000728	国元证券	400	3,360.00	0.07
213	600760	中航沈飞	100	3,282.00	0.06
214	601198	东兴证券	300	3,270.00	0.06
215	000656	金科股份	400	3,264.00	0.06
216	600271	航天信息	200	3,248.00	0.06
217	002146	荣盛发展	400	3,240.00	0.06
218	600332	白云山	100	3,233.00	0.06

219	601838	成都银行	400	3,184.00	0.06
220	600516	方大炭素	500	3,140.00	0.06
221	002508	老板电器	100	3,111.00	0.06
222	601998	中信银行	600	3,090.00	0.06
223	600118	中国卫星	100	3,083.00	0.06
224	002739	万达电影	200	3,054.00	0.06
225	600004	白云机场	200	3,048.00	0.06
226	600219	南山铝业	1,500	3,045.00	0.06
227	601878	浙商证券	300	2,973.00	0.06
228	600018	上港集团	700	2,940.00	0.06
229	600498	烽火通信	100	2,891.00	0.06
230	600297	广汇汽车	900	2,871.00	0.06
231	601018	宁波港	800	2,856.00	0.06
232	600674	川投能源	300	2,781.00	0.06
233	002607	中公教育	100	2,775.00	0.05
234	600170	上海建工	900	2,763.00	0.05
235	600369	西南证券	600	2,754.00	0.05
236	601658	邮储银行	600	2,742.00	0.05
237	601117	中国化学	500	2,740.00	0.05
238	600085	同仁堂	100	2,712.00	0.05
239	600362	江西铜业	200	2,692.00	0.05
240	600208	新湖中宝	900	2,682.00	0.05
241	002958	青农商行	600	2,658.00	0.05
241	600655	豫园股份	300	2,658.00	0.05
242	600977	中国电影	200	2,626.00	0.05
243	601319	中国人保	400	2,576.00	0.05
244	002939	长城证券	200	2,464.00	0.05
245	600027	华电国际	700	2,394.00	0.05
246	601633	长城汽车	300	2,316.00	0.05
247	601881	中国银河	200	2,294.00	0.05
248	600583	海油工程	500	2,275.00	0.05
249	601231	环旭电子	100	2,184.00	0.04
250	603156	养元饮品	100	2,150.00	0.04
251	600848	上海临港	100	2,147.00	0.04
252	601992	金隅集团	700	2,142.00	0.04
253	000786	北新建材	100	2,133.00	0.04
254	000627	天茂集团	400	2,084.00	0.04
255	601236	红塔证券	100	1,940.00	0.04
256	000671	阳光城	300	1,902.00	0.04

257	000723	美锦能源	300	1,878.00	0.04
258	000709	河钢股份	900	1,836.00	0.04
259	601698	中国卫通	100	1,801.00	0.04
260	601238	广汽集团	200	1,800.00	0.04
261	600188	兖州煤业	200	1,752.00	0.03
262	600398	海澜之家	300	1,746.00	0.03
263	002558	巨人网络	100	1,740.00	0.03
264	601919	中远海控	500	1,735.00	0.03
265	000708	中信特钢	100	1,709.00	0.03
266	600989	宝丰能源	200	1,684.00	0.03
267	002468	申通快递	100	1,641.00	0.03
268	601577	长沙银行	200	1,588.00	0.03
269	601916	浙商银行	400	1,576.00	0.03
270	600482	中国动力	100	1,570.00	0.03
271	601898	中煤能源	400	1,520.00	0.03
272	600025	华能水电	400	1,516.00	0.03
273	002945	华林证券	100	1,381.00	0.03
274	600372	中航电子	100	1,332.00	0.03
275	601808	中海油服	100	1,314.00	0.03
276	600299	安迪苏	100	1,222.00	0.02
277	601828	美凯龙	100	1,059.00	0.02
278	601077	渝农商行	200	944.00	0.02
279	600968	海油发展	400	932.00	0.02
280	601298	青岛港	100	568.00	0.01
281	601212	白银有色	200	510.00	0.01

## 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	000977	浪潮信息	1,728,709.00	6.79
2	000651	格力电器	1,509,900.00	5.93
3	000858	五粮液	1,307,883.00	5.14
4	002475	立讯精密	1,197,741.00	4.70
5	002271	东方雨虹	1,126,302.00	4.42
6	002008	大族激光	811,375.00	3.19

7	002422	科伦药业	809,099.00	3.18
8	300285	国瓷材料	785,940.00	3.09
9	600519	贵州茅台	784,255.00	3.08
10	002001	新和成	782,879.00	3.08
11	300638	广和通	772,026.00	3.03
12	300326	凯利泰	759,964.82	2.99
13	300207	欣旺达	757,022.00	2.97
14	300142	沃森生物	747,037.00	2.93
15	002373	千方科技	746,974.00	2.93
16	601318	中国平安	720,094.33	2.83
17	002737	葵花药业	705,747.00	2.77
18	600900	长江电力	704,671.00	2.77
19	300144	宋城演艺	538,830.37	2.12
20	002007	华兰生物	533,214.00	2.09
21	000661	长春高新	525,774.00	2.07
22	000333	美的集团	518,088.00	2.04

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	600519	贵州茅台	2,309,311.00	9.07
2	601318	中国平安	2,119,807.00	8.33
3	000977	浪潮信息	1,989,555.00	7.82
4	600036	招商银行	1,604,655.10	6.30
5	600276	恒瑞医药	1,330,187.00	5.23
6	000651	格力电器	1,302,770.00	5.12
7	002271	东方雨虹	1,224,525.55	4.81
8	000858	五粮液	1,158,394.00	4.55
9	601916	浙商银行	1,133,440.75	4.45
10	601166	兴业银行	1,118,188.00	4.39
11	002475	立讯精密	1,101,739.00	4.33
12	300326	凯利泰	1,034,846.95	4.07
13	002373	千方科技	887,926.08	3.49
14	300638	广和通	881,274.00	3.46

15	600887	伊利股份	831,310.00	3.27
16	002001	新和成	790,560.00	3.11
17	600016	民生银行	776,193.00	3.05
18	300285	国瓷材料	767,174.00	3.01
19	600030	中信证券	756,726.00	2.97
20	600031	三一重工	750,991.76	2.95
21	002422	科伦药业	742,071.00	2.92
22	300207	欣旺达	736,549.00	2.89
23	002008	大族激光	712,595.00	2.80
24	601288	农业银行	695,033.00	2.73
25	300142	沃森生物	684,721.00	2.69
26	601328	交通银行	683,295.00	2.68
27	002737	葵花药业	665,958.00	2.62
28	600900	长江电力	596,874.50	2.34
29	600048	保利地产	589,170.00	2.31
30	600837	海通证券	547,012.00	2.15
31	600000	浦发银行	544,450.00	2.14
32	600196	复星医药	534,660.00	2.10
33	601601	中国太保	525,707.00	2.07
34	002007	华兰生物	516,505.00	2.03

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	41,489,315.66
卖出股票收入（成交）总额	58,919,720.25

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	901,350.00	17.84
	其中：政策性金融债	901,350.00	17.84
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	901,350.00	17.84

## 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	9,000	901,350.00	17.84

## 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	29,671.19
2	应收证券清算款	137,339.25
3	应收股利	-
4	应收利息	28,806.24
5	应收申购款	2,984.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	198,801.52

### 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

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
408	8,288.73	0.00	0.00%	3,381,800.52	100.00%

### 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	35,768.18	1.0577%

### 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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年9月26日）基金份额总额	232,738,634.84
本报告期期初基金份额总额	18,067,550.38
本报告期基金总申购份额	1,909,741.24
减：本报告期基金总赎回份额	16,595,491.10
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	3,381,800.52

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。  
托管业务的诉讼：报告期内未涉及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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
西部证券	3	44,336,084.07	44.16%	41,281.12	51.49%	-
中银国际	4	26,167,390.85	26.06%	19,107.70	23.83%	-
安信证券	2	15,650,252.01	15.59%	6,750.02	8.42%	-
申银万国	2	8,773,592.76	8.74%	8,170.67	10.19%	-
民生证券	1	2,952,227.12	2.94%	2,740.14	3.42%	-
长江证券	1	1,383,137.22	1.38%	1,288.04	1.61%	-
广发证券	2	1,138,105.00	1.13%	832.32	1.04%	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-

国泰君安	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-

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

### 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

西部证券	1,211,804.20	44.60%	3,000,000.00	56.60%	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
民生证券	1,505,149.80	55.40%	2,300,000.00	43.40%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

## 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	2020/5/27-2020/6/30	470,835.63	1,061,695.16	470,835.63	1,061,695.16	31.39%
产品	1	2020/1/1-2020/5/26	11,000,000.00	0.00	11,000,000.00	0.00	0.00%
产品特有风险							
<p>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。</p>							

### 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