

西部利得合赢债券型证券投资基金 2017年第1季度报告

2017年3月31日

西部利得新盈灵活配置混合型证券投资基金 2017年第1季度报告

2017年3月31日

基金管理人:西部利得基金管理有限公司 基金托管人:国泰君安证券股份有限公司

重要提示 基金管理人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。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告自2017年1月1日起至3月31日止。

82 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 基金管理人, 基金托管人, 基金销售机构, 基金业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人, 基金销售机构, 基金业绩比较基准, 风险收益特征.

83 主要财务指标和基金净值表现

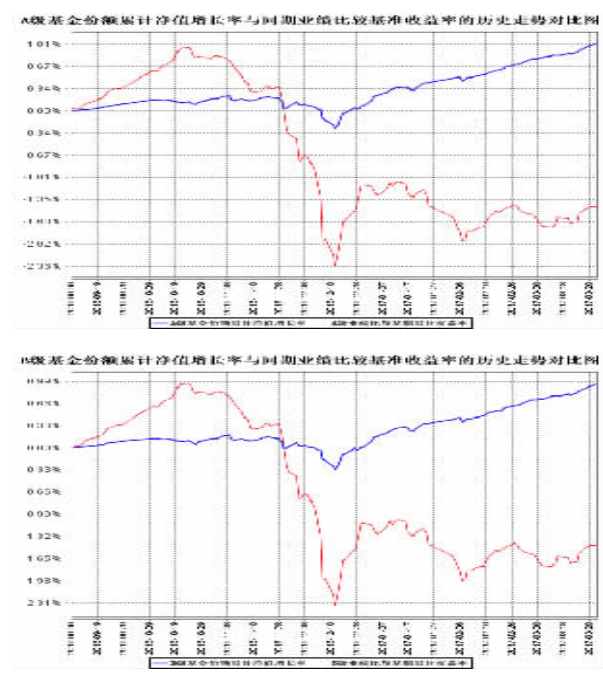
3.1 主要财务指标 单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2017年1月1日至2017年3月31日)

3.2 基金净值表现 3.2.1 本报告期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

Table with 2 columns: 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

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注:1. 本基金基金合同生效日为2016年9月9日,至本报告期末,本基金生效时间满一年。

2. 按照基金合同的约定,本基金自基金合同生效日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金建仓期为2016年9月9日至2017年3月8日,至本报告期末,本基金仍处于建仓期。

84 管理人报告 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

注:1. 任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日;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 管理人报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《基金合同》等法律法规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,力争为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明 4.3.1 公平交易专项说明 4.3.2 公平交易专项说明

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督,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)等。

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 报告期内基金投资策略和运作分析 2017年一季度,国内经济继续温和复苏,CPI在春节后大幅回落,通胀压力有所下降。

本基金在报告期内采用稳健的投资策略,操作上以配置高评级同业存单为主,并均衡分布于各期限,保持合适的组合久期,从而获得较稳定的收益,同时尽量规避各种市场风险。

4.5 报告期内基金的业绩表现 报告期内本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”。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 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。

85 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 5.3 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.4 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

Table with 5 columns: 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(%)

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

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

5.7 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权证投资明细

5.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9 投资组合报告附注 5.9.1 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。

5.9.2 股票不在本基金投资范围内。

5.9.3 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

86 开放式基金份额变动 单位:份

Table with 2 columns: 项目, 西部利得合赢债券A, 西部利得合赢债券C

87 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

88 影响投资者决策的其他重要信息

89 备查文件目录 9.1 备查文件目录

(1)中国证监会批准西部利得合赢债券型证券投资基金设立的相关文件;

(2)《西部利得合赢债券型证券投资基金基金合同》;

(3)《西部利得合赢债券型证券投资基金招募说明书》;

(4)《西部利得合赢债券型证券投资基金托管协议》;

(5)基金管理人《基金管理人内部控制制度》;

(6)报告期内西部利得合赢债券型证券投资基金公告的各项原稿。

9.2 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

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

(2)网站查阅:基金管理人网址: http://www.westleadfund.com 投资者对本报告如有疑问,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 2017年4月21日

基金管理人:西部利得基金管理有限公司 基金托管人:中国银河证券股份有限公司

重要提示 基金管理人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。

基金托管人中国银河证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告自2017年1月1日起至3月31日止。

82 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 基金管理人, 基金托管人, 基金销售机构, 基金业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人, 基金销售机构, 基金业绩比较基准, 风险收益特征.

83 主要财务指标和基金净值表现

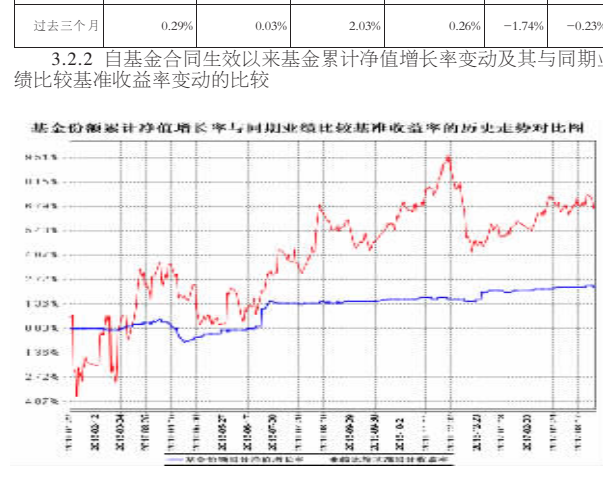
3.1 主要财务指标 单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2017年1月1日至2017年3月31日)

3.2 基金净值表现 3.2.1 本报告期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

Table with 2 columns: 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

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注:1. 任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日;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 管理人报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《基金合同》等法律法规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,力争为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明 4.3.1 公平交易专项说明 4.3.2 公平交易专项说明

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督,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)等。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度国内经济出现复苏迹象,3月制造业PMI指数略超预期,连续八个月高于荣枯线,连续六个月保持在51.0以上,延续平稳扩张态势。

4.5 报告期内基金的投资组合和资产分布 4.5.1 报告期末按行业分类的股票投资组合 4.5.2 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.1 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

Table with 5 columns: 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(%)

5.2 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资产支持证券投资明细

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

5.4 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

5.5 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.6 投资组合报告附注 5.6.1 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。

5.6.2 股票不在本基金投资范围内。

5.6.3 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.6.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.6.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.6.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

86 开放式基金份额变动 单位:份

Table with 2 columns: 项目, 西部利得新盈混合A, 西部利得新盈混合B

87 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

88 影响投资者决策的其他重要信息

89 备查文件目录 9.1 备查文件目录

(1)中国证监会批准西部利得新盈灵活配置混合型证券投资基金设立的相关文件;

(2)《西部利得新盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

(3)《西部利得新盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;

(4)《西部利得新盈灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

(5)基金管理人《基金管理人内部控制制度》;

(6)报告期内西部利得新盈灵活配置混合型证券投资基金公告的各项原稿。

9.2 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

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

(2)网站查阅:基金管理人网址: http://www.westleadfund.com 投资者对本报告如有疑问,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 2017年4月21日

81 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

5.3 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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.5 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

Table with 5 columns: 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(%)

5.6 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

5.7 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

5.8 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

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.12 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.13 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.14 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资产支持证券投资明细

5.15 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

5.16 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

5.17 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.18 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.19 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.20 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.21 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.22 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.23 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.24 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.25 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.26 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.27 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.28 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.29 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.30 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.31 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.32 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.33 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.34 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.35 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.36 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.37 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.38 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.39 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.40 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.41 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明