

(上接 D240 版)

8.4.3 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

Table with 2 columns: 买入股票成本(成交)总额, 卖出股票收入(成交)总额. Values: 516,734,476.73, 550,555,126.47

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Lists various bond types like 国家债券, 央行票据, etc.

本基金于本报告期末未持有债券。 8.6 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

Table with 5 columns: 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(%).

本基金于本报告期末未持有债券。 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细 金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

8.8 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 本基金于本报告期末未持有贵金属。 8.9 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 金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

本基金于本报告期末未持有权证。 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 8.10.1 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合约。 8.10.2 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合约。 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 8.11.1 本期国债期货投资政策 本基金于本报告期内未持有国债期货。 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with 6 columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险指标说明. Summary of derivatives positions.

本基金于本报告期内未持有国债期货。 8.11.3 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。 8.12 投资组合报告附注 8.12.1 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。 8.12.2 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。 8.12.3 期末其他各项资产构成 单位:人民币元

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额. Summary of other assets.

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细 金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Summary of convertible bonds.

本基金于本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 金额单位:人民币元

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%), 流通受限情况说明. Summary of restricted stocks.

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数之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 份额单位:份

Table with 6 columns: 持有人户数(户), 户均持有的基金份额, 机构投资者, 个人投资者, 持有份额, 占基金份额比例. Summary of shareholder structure.

注:1.“持有人户数”合计数小于各份额级别持有人户数的总和,是由于一个持有人同时持有多个级别基金份额; 2.分级基金机构/个人投资者持有份额占基金份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

Table with 3 columns: 项目, 持有份额总数(份), 占基金总份额比例. Summary of fund manager holdings.

9.4 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

Table with 2 columns: 项目, 持有基金份额总量的数量区间(万份). Summary of fund manager holdings by range.

§ 10 开放式基金份额变动 单位:份

Table with 2 columns: 项目, 基金份额. Summary of fund share changes.

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会,无基金份额持有人大会决议。

11.2 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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金审计的会计师事务所仍为毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙),本报告期应支付毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审计费人民币45,000元。截至报告期末连续服务期为1-2年。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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

Table with 6 columns: 券商名称, 交易单元数量, 股票交易, 应支付给券商的佣金, 备注. Summary of broker usage for equity investments.

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稳定;(3)经营行为规范,在最近一年无重大违规行为;(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)公司具有较深的研究能力,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。

11.7.2 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

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易. Summary of broker usage for other investments.

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

Table with 6 columns: 投资者类别, 序号, 持有基金份额比例达到或超过 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. Summary of large shareholders.

产品特有风险

本基金为混合型基金,其主要风险包括但不限于:股票价格波动风险、信用风险、流动性风险等。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。 西部利得基金管理有限公司 2018年3月30日

(上接 D226 版)

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细 金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期末基金资产净值比例(%). Summary of top 20 stocks sold.

8.4.3 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

Table with 2 columns: 买入股票成本(成交)总额, 卖出股票收入(成交)总额. Values: 1,146,077,183.25, 940,895,747.64

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 金额单位:人民币元

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

本基金于本报告期末未持有债券。 8.6 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

Table with 5 columns: 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(%).

本基金于本报告期末未持有债券。 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细 金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

本基金于本报告期末未持有权证。 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 8.10.1 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合约。 8.10.2 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合约。 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 8.11.1 本期国债期货投资政策 本基金于本报告期内未持有国债期货。 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with 6 columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险指标说明. Summary of derivatives positions.

本基金于本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 金额单位:人民币元

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%), 流通受限情况说明. Summary of restricted stocks.

本基金于本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额. Summary of other assets.

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细 金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Summary of convertible bonds.

本基金于本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 金额单位:人民币元

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%), 流通受限情况说明. Summary of restricted stocks.

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。 8.12.6 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数之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 份额单位:份

Table with 6 columns: 持有人户数(户), 户均持有的基金份额, 机构投资者, 个人投资者, 持有份额, 占基金份额比例. Summary of shareholder structure.

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

Table with 3 columns: 项目, 持有份额总数(份), 占基金总份额比例. Summary of fund manager holdings.

9.4 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

Table with 2 columns: 项目, 持有基金份额总量的数量区间(万份). Summary of fund manager holdings by range.

§ 10 开放式基金份额变动 单位:份

Table with 2 columns: 项目, 基金份额. Summary of fund share changes.

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会,无基金份额持有人大会决议。

11.2 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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金审计的会计师事务所仍为毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙),本报告期应支付毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审计费人民币45,000元。截至报告期末连续服务期为1-2年。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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

Table with 6 columns: 券商名称, 交易单元数量, 股票交易, 应支付给券商的佣金, 备注. Summary of broker usage for equity investments.

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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

Table with 6 columns: 券商名称, 交易单元数量, 股票交易, 应支付给券商的佣金, 备注. Summary of broker usage for equity investments.

11.7.2 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

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易. Summary of broker usage for other investments.

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

Table with 6 columns: 投资者类别, 序号, 持有基金份额比例达到或超过 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. Summary of large shareholders.

产品特有风险

本基金为股票型基金,其主要风险包括但不限于:股票价格波动风险、流动性风险等。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

Table with 6 columns: 投资者类别, 序号, 持有基金份额比例达到或超过 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. Summary of large shareholders.

产品特有风险

本基金为股票型基金,其主要风险包括但不限于:股票价格波动风险、流动性风险等。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。 西部利得基金管理有限公司 2018年3月30日