(上接 D231 版)

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	–	–	–
本期利润	3,914,007.56	3,671,936.99	7,585,944.55
本期基金份额交易产生的变动数	−128,336.78	−11,506.45	−139,843.23
其中:基金申购款	193.73	390.38	584.11
基金赎回款	−128,530.51	−11,896.83	−140,427.34
本期已分配利润	–	–	–
本期末	3,785,670.78	3,660,430.54	7,446,101.32

7.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期 2017 年 6 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	59,145.11	–
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	2,870.81	–
其他	26,978.45	–
合计	88,994.37	–

注:本基金在本报告期成立,无上年度可比数据。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位:人民币元

项目	本期 2017 年 6 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	43,434,971.68	–
减:卖出股票成本总额	41,929,821.78	–
买卖股票差价收入	1,505,149.90	–

注:本基金在本报告期成立,无上年度可比数据。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位:人民币元

项目	本期 2017 年 6 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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	53,373.24	–
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	53,373.24	–

注:本基金在本报告期成立,无上年度可比数据。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位:人民币元

项目	本期 2017 年 6 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	45,390,778.21	–
减:卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	44,777,331.60	–
减:应收利息总额	560,073.37	–
买卖债券差价收入	53,373.24	–

注:本基金在本报告期成立,无上年度可比数据。

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

单位:人民币元

项目	本期 2017 年 6 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	–	–
减:现金支付赎回款总额	–	–
减:赎回债券成本总额	–	–
减:赎回债券应收利息总额	–	–
赎回差价收入	–	–

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

单位:人民币元

项目	本期 2017 年 6 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
申购基金份额对价总额	–	–
减:现金支付申购款总额	–	–
减:申购债券成本总额	–	–
减:申购债券应收利息总额	–	–
申购差价收入	–	–

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位:人民币元

项目	本期 2017 年 6 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
卖出资产支持证券成交总额	–	–
减:卖出资产支持证券成本总额	–	–
减:应收利息总额	–	–
资产支持证券投资收益	–	–

本基金于本报告期内及上年度期内均未持有资产支持证券。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

贵金属不在本基金投资范围内。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

贵金属不在本基金投资范围内。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

贵金属不在本基金投资范围内。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

贵金属不在本基金投资范围内。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位:人民币元

项目	本期 2017 年 6 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
卖出权证成交总额	–	–
减:卖出权证成本总额	–	–
买卖权证差价收入	–	–

本基金于本报告期内及上年度期内均未持有衍生工具。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位:人民币元

项目	本期收益金额 2017 年 6 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间收益金额 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
股指期货－投资收益	–	

本基金于本报告期内及上年度期内均未持有衍生工具。

7.4.7.16 股利收益

单位:人民币元

项目	本期 2017 年 6 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	–	–
基金投资产生的股利收益	–	–
合计	–	–

本基金于本报告期末未发生股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期 2017 年 6 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	3,671,936.99	–
——股票投资	3,940,398.09	–
——债券投资	−268,461.10	–
——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	–	–
合计	3,671,936.99	–

注:本基金在本报告期成立,无上年度可比数据。

7.4.7.18 其他收入

单位:人民币元

项目	本期 2017 年 6 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	50,422.49	–
其他	3,780.82	–
合计	54,203.31	–

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。

7.4.7.19 交易费用

单位:人民币元

项目	本期 2017 年 6 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	130,929.77	–
银行间市场交易费用	1,925.00	–
合计	132,854.77	–

注:本基金在本报告期成立,无上年度可比数据。

7.4.7.20 其他费用

单位:人民币元

项目	本期 2017 年 6 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
审计费用	45,000.00	–
信息披露费	60,000.00	–
债券账户维护费	4,500.00	–
其他	500.00	
合计	110,000.00	–

注:本基金在本报告期成立,无上年度可比数据。

7.4.7.21 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。

7.4.8 关联方关系

项目	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、基金销售机构
西部证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
利得科技有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
中国银河证券股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

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。

7.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金在本报告期内未与关联方交易。本基金在本报告期成立,无上年度可比数据。

7.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.9.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2017 年 6 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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	75,252,139.95	63.24%	–	–

本基金在本报告期成立,无上年度可比数据。

7.4.9.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2017 年 6 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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	25,110,547.54	100.00%	–	–

本基金在本报告期成立,无上年度可比数据。

7.4.9.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2017 年 6 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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	105,000,000.00	100.00%	–	–

本基金在本报告期成立,无上年度可比数据。

7.4.9.1.4 权证交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2017 年 6 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

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。

7.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2017 年 6 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 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	53,526.46	69.73%	26,220.06	67.19%
关联方名称	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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

本基金上年度应支付关联方的佣金为零。

7.4.9.2 关联方报酬

7.4.9.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2017 年 6 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,632,697.20	–
其中:支付销售机构的客户维护费	26.29	–

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 1.5%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 × 1.5% / 当年天数。

7.4.9.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2017 年 6 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	108,846.51	–

注:支付基金托管人中国银河证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.1%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:

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.1% / 当年天数。

7.4.9.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期 2017 年 6 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
合计	–
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

本基金于本报告期和上一报告期均未产生销售服务费用。

7.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2017 年 6 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.9.4.1 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 2017 年 6 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
基金合同生效日(2017 年 6 月 16 日)持有的基金份额	–	–
期初持有的基金份额	–	–
期间申购 / 买入总份额	–	–
期间因拆分变动份额	–	–
减:期间赎回 / 卖出总份额	–	–
期末持有的基金份额	–	–
期末持有的基金份额占基金总份额比例	–	–

本基金管理人于本报告期末运用固有资金投资本基金。本基金为本报告期内成立的基金,无上年度可比期间。7.4.9.4.2 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 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 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
西部利得－鑫泰通铭 1 号资产管理计划	18,003,050.00	9.5741%	–	–
西部利得－东方睿德 3 号资产管理计划	20,003,500.00	10.6380%		
西部利得－东方睿德 1 号资产管理计划	20,003,500.00	10.6380%		
西部利得－东方睿德 5 号资产管理计划	20,003,500.00	10.6380%		
西部利得－东方睿德 2 号资产管理计划	20,003,500.00	10.6380%		
西部利得－吉鑫 1 号资产管理计划	30,001,700.00	15.9551%		
西部利得－添丰通铭 1 号资产管理计划	30,001,700.00	15.9551%		
西部利得－和兴 1 号资产管理计划	30,001,700.00	15.9551%		

本基金为本报告期内成立的基金,无上年度可比期间。

7.4.9.5 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 2017 年 6 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

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。

7.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

本期 2017 年 6 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:份)	总金额
上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:份)	总金额

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。本基金为本报告期内成立的基金,无上年度可比期间。

7.4.9.7 其他关联交易事项的说明

–

7.4.10 期末(2017 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.10.1 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

7.4.10.1.1 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

7.4.10.1.2 受限证券类别:债券

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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注

7.4.10.1.3 受限证券类别:权证

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:份)	期末成本总额	期末估值总额	备注

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。

7.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

–

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
合计				–	–

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。

7.4.10.3.2 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。

7.4.11 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属的层次,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 2017 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 37,564,773.80 元,属于第二层级的余额为 86,348,500.00 元,无属于第三层级的余额。

(ii)公允价值所属层级间的重大变动

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还是第三层次。

(iii)第三层级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 2017 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(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。

§8 投资组合报告

8.1 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	37,564,773.80	19.14
	其中:股票	37,564,773.80	19.14
2	固定收益投资	86,348,500.00	44.00
	其中:债券	86,348,500.00	44.00
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	59,400,000.00	30.27
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	11,216,452.05	5.72
7	其他各项资产	1,712,253.95	0.87
8	合计	196,241,979.80	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	809,550.00	0.41
B	采矿业	–	–
C	制造业	36,755,223.80	18.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
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	–	–
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
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	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	37,564,773.80	19.22

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

8.3 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 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	000858	五粮液	123,000	9,825,240.00	5.03
2	600887	伊利股份	239,000	7,693,410.00	3.94
3	600519	贵州茅台	10,120	7,058,598.80	3.61
4	603589	口子窖	108,500	4,996,425.00	2.56
5	300296	利亚德	207,000	4,034,430.00	2.06
6	002185	华天科技	155,000	1,320,600.00	0.68
7	600584	长电科技	44,000	938,520.00	0.48
8	002293	罗莱生活	60,000	888,000.00	0.45
9	002041	登海种业	63,000	809,550.00	0.41

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入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

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	13,652,247.07	6.98
2	000858	五粮液	9,530,810.26	4.88
3	600887	伊利股份	6,334,071.00	3.24
4	603589	口子窖	5,497,623.00	2.81
5	300296	利亚德	4,689,977.00	2.40
6	002127	南极电商	3,384,834.40	1.73
7	000568	泸州老窖	2,879,635.00	1.47
8	601688	华泰证券	2,391,138.00	1.22
9	601377	兴业证券	2,283,000.00	1.17
10	002241	歌尔股份	2,143,346.00	1.10
11	600999	招商证券	2,046,773.00	1.05
12	600584	长电科技	1,996,888.00	1.02
13	600276	恒瑞医药	1,532,179.00	0.78
14	002185	华天科技	1,531,150.00	0.78
15	600588	用友网络	1,384,515.00	0.71
16	300098	高新兴	1,354,485.00	0.69
17	002041	登海种业	1,270,025.00	0.65
18	300059	东方财富	1,211,305.60	0.62
19	600958	东方证券	1,188,200.00	0.61
20	000166	申万宏源	1,028,600.00	0.53

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

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(%)
1	600519	贵州茅台	10,020,531.00	5.13
2	002127	南极电商	3,233,811.00	1.65
3	000568	泸州老窖	2,762,666.20	1.41
4	601688	华泰证券	2,277,992.00	1.17
5	601377	兴业证券	2,273,050.00	1.16
6	002241	歌尔股份	2,199,203.00	1.12
7	600999	招商证券	2,151,390.00	1.10
8	600584	长电科技	1,519,014.00	0.78
9	000858	五粮液	1,506,900.00	0.77
10	600276	恒瑞医药	1,350,676.00	0.69
11	300098	高新兴	1,340,354.00	0.69
12	600588	用友网络	1,326,755.00	0.68
13	600958	东方证券	1,102,650.00	0.56
14	300059	东方财富	1,086,100.00	0.56
15	000166	申万宏源	1,021,700.00	0.52
16	002475	立讯精密	954,224.00	0.49
17	600195	中牧股份	953,117.32	0.49
18	000661	长春高新	864,600.00	0.44
19	000681	视觉中国	760,878.16	0.39
20	000997	新大陆	758,130.00	0.39

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

买入股票成本(成交)总额		75,554,197.49	75,554,197.49
卖出股票收入(成交)总额		43,434,971.68	43,434,971.68

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

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	9,950,500.00	5.09
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	9,886,000.00	5.06
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	66,512,000.00	34.02
9	其他	–	–
10	合计	86,348,500.00	44.17

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

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	112278	15 东莞债	100,000	9,886,000.00	5.06
2	111792610	17 贵州银行 CD017	100,000	9,541,000.00	4.88
3	111783518	17 包商银行 CD111	100,000	9,499,000.00	4.86
4	111783471	17 桂林银行 CD105	100,000	9,497,000.00	4.86
5	111783443	17 龙江银行 CD197	100,000	9,496,000.00	4.86
5	111783512	17 贵州银行 CD040	100,000	9,496,000.00	4.86

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

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

贵金属不在本基金投资范围内。

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

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

国债期货不在本基金投资范围内。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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
公允价值变动总额合计(元)					–
国债期货投资本期收益(元)					–
国债期货投资本期公允价值变动(元)					–

国债期货不在本基金投资范围内。

8.11.3 本期国债期货投资评价

国债期货不在本基金投资范围内。

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

序号	名称	金额
1	存出保证金	45,682.76
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	1,666,371.43
5	应收申购款	199.76
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	1,712,253.95

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

序号	债券代码	债券名称	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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明

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项之间可能存在尾差。

§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

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
198	949,690.38	188,022,150.00	99.99%	16,545.06	0.01%

9.3 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	309.83	0.0002%

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

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 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2017 年 6 月 16 日)基金份额总额	208,028,738.81
本报告期期初基金份额总额	–
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	25,558.70
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	20,015,602.45
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"−"填列)	–
本报告期期末基金份额总额	188,038,695.06

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开本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。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变更。

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

本报告期为本基金审计的会计师事务所改聘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

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	
银河证券	2	75,252,139.95	63.24%	53,526.46	69.73%	–
国金证券	1	43,737,029.22	36.76%	23,237.56	30.27%	–
东吴证券	2	–	–	–	–	–

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

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	25,110,547.54	100.00%	105,000,000.00	100.00%	–	–
国金证券	–	–	–	–	–	–
东吴证券	–	–	–	–	–	–

§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

截止本报告期末,本基金未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

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 D233 版)

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
170205	17 国开 05	2018 年 1 月 2 日	98.10	620,000	60,822,000.00
合计				620,000	60,822,000.00

–

7.4.9.3.2 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。

7.4.10 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属的层次,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 2017 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二层级的余额为 498,449,500.00 元,无属于第一层级和第三层级的余额(2016 年 12 月 31 日:第二层级余额 975,928,000,.00 元,无第一和第三层级余额)。

(ii)公允价值所属层级间的重大变动

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还是第三层次。

(iii)第三层级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 2017 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(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。

§8 投资组合报告

8.1 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	–	–
	其中:股票	–	–
2	固定收益投资	498,449,500.00	83.91
	其中:债券	498,449,500.00	83.91
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	52,310,318.47	8.81
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	3,632,346.33	0.61
7	其他各项资产	39,659,883.75	6.68
8	合计	594,052,048.55	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金于本报告期末未持有股票。

8.3 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

无。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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

本基金于本报告期末未持有股票。

8.4.2 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

本基金于本报告期末未持有股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金于本报告期末未持有股票。

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

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	216,162,000.00	40.57
2	央行票据	–	–
3	金融债券	165,789,000.00	31.12
	其中:政策性金融债	165,789,000.00	31.12
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	116,498,500.00	21.86
9	其他	–	–
10	合计	498,449,500.00	93.55

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

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	170205	17 国开 05	1,690,000	165,789,000.00	31.12
2	160016	16 附息国债 16	1,600,000	156,480,000.00	29.37
3	150012	15 附息国债 12	600,000	59,682,000.00	11.20
4	111782636	17 宁波通商银行 CD117	300,000	29,274,000.00	5.49
5	111791856	17 重庆银行 CD025	300,000	28,695,000.00	5.39

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

无。

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

贵金属不在本基金投资范围内。

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

本基金于本报告期末未持有权证。

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

国债期货不在本基金投资范围内。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

国债期货不在本基金投资范围内。

8.11.3 本期国债期货投资评价

国债期货不在本基金投资范围内。

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 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	73.70
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	9,659,810.05
5	应收申购款	30,000,000.00
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	39,659,883.75

8.12.3 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

序号	债券代码	债券名称	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处于转股期的可转换债券。

8.12.4 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金于本报告期末未持有股票。

8.12.5 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。

§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

份额级别	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
西部利得合赢债券 A	156	2,908.31	0.00	0.00%	453,696.90	100.00%
西部利得合赢债券 C	97	5,462,864.21	529,877,502.24	100.00%	20,325.71	0.00%
合计	240	2,209,798.02	529,877,502.24	99.91%	474,022.61	0.09%

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总份额比例的计算中,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

项目	份额级别	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	西部利得合赢债券 A	0.00	0.0000%
	西部利得合赢债券 C	0.00	0.0000%
	合计	0.00	0.0000%

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

项目	份额级别	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	西部利得合赢债券 A	0~10
	西部利得合赢债券 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	西部利得合赢债券 A	0
	西部利得合赢债券 C	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位:份

项目	西部利得合赢债券 A	西部利得合赢债券 C
基金合同生效日(2016 年 9 月 9 日)基金份额总额	104,181.23	200,095,846.97
本报告期期初基金份额总额	58,849.24	998,948,181.84
本报告期基金总申购份额	553,008.11	1,026,697,924.28
减:本报告期基金总赎回份额	158,160.45	1,495,748,278.17
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	453,696.90	529,897,827.95

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开本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

本报告期为本基金审计的会计师事务所改聘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 60,000 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

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	
国泰君安	2	–	–	–	–	–

注:1.基金租用席位的选择标准是:(1)资力雄厚,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。

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

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
国泰君安	402,303,193.76	100.00%	8,000,000.00	100.00%	–	–

§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

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	>6 个月	998,884,013.00	994,882,297.34	1,493,766,310.34	500,000,000.00	94.28%
个人	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
产品特有风险							
本基金为债券型基金,其主要风险包括但不限于: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