

西部利得中证500等权重指数分级证券投资基金2017年年度报告摘要

2017年12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: 兴业银行股份有限公司
报告日期: 2018年3月30日

% benchmark(t) = 95% \* (中证500等权重指数收益率(t) - 中证500等权重指数收益率(t-1)) + 5% \* 商业银行人民币活期存款利率(t/365) + benchmark(t-1) + % benchmark(t-1)
基金业绩比较基准: 中证500等权重指数收益率+1.00%

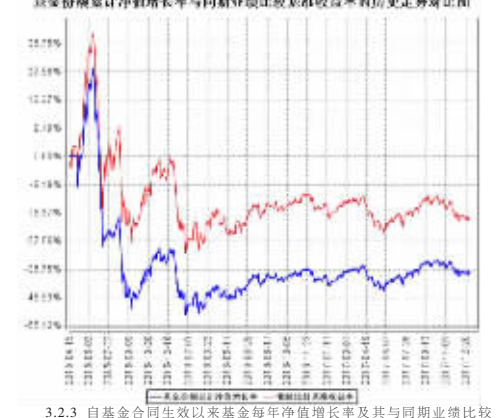


图1 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

1.1 重要提示
1.2 基金概况
1.3 主要财务指标和净值增长率

Table with 2 columns: Item and Value. Includes fund name, code, and dates.

3.2.2 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

4.1 基金管理人及基金经理情况
4.1.1 基金管理人及基金经理情况

Table listing fund managers and their tenure. Columns include Name, Position, Tenure Start, and Tenure End.

5.1 基金投资策略
5.2 资产配置策略

5.3 风险控制策略
5.4 业绩比较基准

6.1 基金资产净值及基金份额净值

6.2 基金份额持有人数量及基金份额持有人集中度

6.3 基金管理人运用基金资产买卖证券的明细

6.4 基金管理人运用基金资产投资于权证情况

6.5 基金管理人运用基金资产投资于股指期货情况

6.6 基金管理人运用基金资产投资于国债期货情况

6.7 基金管理人运用基金资产投资于证券公司短期公司债券情况

6.8 基金管理人运用基金资产投资于资产支持证券情况

6.9 基金管理人运用基金资产投资于其他品种情况

7.1 基金管理人报告期内基金投资策略和运作分析

7.2 基金管理人报告期内基金业绩分析

7.3 基金管理人报告期内基金投资组合报告

7.4 基金管理人报告期内基金估值程序等事项的说明

7.5 基金管理人报告期内基金持有人投诉处理情况

7.6 基金管理人报告期内基金托管人履职情况

7.7 基金管理人报告期内基金销售费用

7.8 基金管理人报告期内基金利润分配情况

7.9 基金管理人报告期内基金费用

7.10 基金管理人报告期内基金其他事项

8.1 基金资产净值及基金份额净值

8.2 基金份额持有人数量及基金份额持有人集中度

8.3 基金管理人运用基金资产买卖证券的明细

8.4 基金管理人运用基金资产投资于权证情况

8.5 基金管理人运用基金资产投资于股指期货情况

8.6 基金管理人运用基金资产投资于国债期货情况

8.7 基金管理人运用基金资产投资于证券公司短期公司债券情况

8.8 基金管理人运用基金资产投资于资产支持证券情况

8.9 基金管理人运用基金资产投资于其他品种情况

4.8 管理人会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明
4.9 报告期内管理人对本基金持有人人数或基金份额净值预警事项的说明

5.1 基金管理人对本基金托管人履职情况
5.2 基金管理人对本基金销售机构履职情况

5.3 基金管理人对本基金估值程序等事项的说明
5.4 基金管理人对本基金持有人投诉处理情况

5.5 基金管理人对本基金销售费用
5.6 基金管理人对本基金利润分配情况

5.7 基金管理人对本基金费用
5.8 基金管理人对本基金其他事项

5.9 基金管理人对本基金估值程序等事项的说明

5.10 基金管理人对本基金持有人投诉处理情况

5.11 基金管理人对本基金销售费用
5.12 基金管理人对本基金利润分配情况

5.13 基金管理人对本基金费用
5.14 基金管理人对本基金其他事项

5.15 基金管理人对本基金估值程序等事项的说明

5.16 基金管理人对本基金持有人投诉处理情况

5.17 基金管理人对本基金销售费用
5.18 基金管理人对本基金利润分配情况

5.19 基金管理人对本基金费用
5.20 基金管理人对本基金其他事项

5.21 基金管理人对本基金估值程序等事项的说明

5.22 基金管理人对本基金持有人投诉处理情况

5.23 基金管理人对本基金销售费用
5.24 基金管理人对本基金利润分配情况

5.25 基金管理人对本基金费用
5.26 基金管理人对本基金其他事项

5.27 基金管理人对本基金估值程序等事项的说明

5.28 基金管理人对本基金持有人投诉处理情况

5.29 基金管理人对本基金销售费用
5.30 基金管理人对本基金利润分配情况

5.31 基金管理人对本基金费用
5.32 基金管理人对本基金其他事项

5.33 基金管理人对本基金估值程序等事项的说明

5.34 基金管理人对本基金持有人投诉处理情况

5.35 基金管理人对本基金销售费用
5.36 基金管理人对本基金利润分配情况

5.37 基金管理人对本基金费用
5.38 基金管理人对本基金其他事项

5.39 基金管理人对本基金估值程序等事项的说明

5.40 基金管理人对本基金持有人投诉处理情况

5.41 基金管理人对本基金销售费用
5.42 基金管理人对本基金利润分配情况

5.43 基金管理人对本基金费用
5.44 基金管理人对本基金其他事项

5.45 基金管理人对本基金估值程序等事项的说明

5.46 基金管理人对本基金持有人投诉处理情况

5.47 基金管理人对本基金销售费用
5.48 基金管理人对本基金利润分配情况

5.49 基金管理人对本基金费用
5.50 基金管理人对本基金其他事项

5.51 基金管理人对本基金估值程序等事项的说明

5.52 基金管理人对本基金持有人投诉处理情况

5.53 基金管理人对本基金销售费用
5.54 基金管理人对本基金利润分配情况

5.55 基金管理人对本基金费用
5.56 基金管理人对本基金其他事项

5.57 基金管理人对本基金估值程序等事项的说明

5.58 基金管理人对本基金持有人投诉处理情况

5.59 基金管理人对本基金销售费用
5.60 基金管理人对本基金利润分配情况

5.61 基金管理人对本基金费用
5.62 基金管理人对本基金其他事项

5.63 基金管理人对本基金估值程序等事项的说明

5.64 基金管理人对本基金持有人投诉处理情况

5.65 基金管理人对本基金销售费用
5.66 基金管理人对本基金利润分配情况

本报告期: 2017年1月1日至2017年12月31日
货币单位: 人民币元

Table with columns: Item, 2017年1月1日至2017年12月31日, 2016年1月1日至2016年12月31日. Includes Balance Sheet, Income Statement, and Profit Statement.

2016年1月1日至2016年12月31日

Table with columns: Item, 2016年1月1日至2016年12月31日, 2015年1月1日至2015年12月31日.

2015年1月1日至2015年12月31日

Table with columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日.

2014年1月1日至2014年12月31日

Table with columns: Item, 2014年1月1日至2014年12月31日, 2013年1月1日至2013年12月31日.

2013年1月1日至2013年12月31日

Table with columns: Item, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日.

2012年1月1日至2012年12月31日

Table with columns: Item, 2012年1月1日至2012年12月31日, 2011年1月1日至2011年12月31日.

2011年1月1日至2011年12月31日

Table with columns: Item, 2011年1月1日至2011年12月31日, 2010年1月1日至2010年12月31日.

2010年1月1日至2010年12月31日

Table with columns: Item, 2010年1月1日至2010年12月31日, 2009年1月1日至2009年12月31日.

2009年1月1日至2009年12月31日

关联方名称: 本期 2017年1月1日至2017年12月31日, 上期 2016年1月1日至2016年12月31日. Includes transaction amounts and percentages.

Table showing related party transactions for the period 2017年1月1日至2017年12月31日.

关联方名称: 本期 2016年1月1日至2016年12月31日, 上期 2015年1月1日至2015年12月31日.

Table showing related party transactions for the period 2016年1月1日至2016年12月31日.

关联方名称: 本期 2015年1月1日至2015年12月31日, 上期 2014年1月1日至2014年12月31日.

Table showing related party transactions for the period 2015年1月1日至2015年12月31日.

关联方名称: 本期 2014年1月1日至2014年12月31日, 上期 2013年1月1日至2013年12月31日.

Table showing related party transactions for the period 2014年1月1日至2014年12月31日.

关联方名称: 本期 2013年1月1日至2013年12月31日, 上期 2012年1月1日至2012年12月31日.

Table showing related party transactions for the period 2013年1月1日至2013年12月31日.

关联方名称: 本期 2012年1月1日至2012年12月31日, 上期 2011年1月1日至2011年12月31日.

Table showing related party transactions for the period 2012年1月1日至2012年12月31日.

关联方名称: 本期 2011年1月1日至2011年12月31日, 上期 2010年1月1日至2010年12月31日.

Table showing related party transactions for the period 2011年1月1日至2011年12月31日.

关联方名称: 本期 2010年1月1日至2010年12月31日, 上期 2009年1月1日至2009年12月31日.

Table showing related party transactions for the period 2010年1月1日至2010年12月31日.

关联方名称: 本期 2009年1月1日至2009年12月31日, 上期 2008年1月1日至2008年12月31日.

Table showing related party transactions for the period 2009年1月1日至2009年12月31日.

关联方名称: 本期 2008年1月1日至2008年12月31日, 上期 2007年1月1日至2007年12月31日.

Table showing related party transactions for the period 2008年1月1日至2008年12月31日.

关联方名称: 本期 2007年1月1日至2007年12月31日, 上期 2006年1月1日至2006年12月31日.

Table showing related party transactions for the period 2007年1月1日至2007年12月31日.