

# 西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金

## 更新招募说明书

(2016 年第一期)

### (摘要)

西部利得中证500等权重指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会2014年12月25日证监许可【2014】1414号文准予注册。本基金的基金合同于2015年4月15日生效。

#### 【重要提示】

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人根据所持有份额享受基金的收益，但同时也要承担相应的投资风险。投资有风险，投资人在投资本基金前，请认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦承担基金投资中出现的各类风险。基金投资中的风险包括：市场风险、管理风险、技术风险、合规风险等，也包括本基金的指数投资风险、不同风险收益特征、折/溢价风险、以及份额配对转换及基金份额折算等业务办理过程中特定风险等。

本基金为股票型指数基金，预期风险大于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额看，西部利得中证 500 等权重 A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；西部利得中证 500 等权重 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。

投资有风险，投资人认购（申购）基金时应认真阅读本基金的招募说明书及基金合同。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

本次招募说明书的更新内容中与托管相关的信息已经本基金托管人复核。所载内容截止日为 2016 年 4 月 15 日，投资组合报告为 2016 年一季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

## 第一部分 基金管理人

### 一、公司概况

名称：西部利得基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 11 层 02、03 单元

办公地址：上海市浦东新区杨高南路 799 号陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 11 层

法定代表人：安保和

成立时间：2010 年 7 月 20 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监许可[2010]864 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：叁亿元

存续期限：持续经营

联系人：韦佳

联系电话：（021）38572888

股权结构：

股东	出资额（元）	出资比例
西部证券股份有限公司	153,000,000	51%
上海利得财富资产管理有限公司	147,000,000	49%
合计	300,000,000	100%

### 二、主要人员情况

#### 1. 董事会成员：

安保和先生：董事长

安保和先生，董事长，硕士研究生，高级经济师。毕业于西安交大管理学院，获工商管理硕士学位，22年证券从业经历。1993年起任陕西省科技风险投资公司经理。1994年起任中国工商银行陕西省信托投资有限责任公司经理。1997年起在陕西信托投资有限公司工作，历任公司总经理助理、董事会秘书、副总经理。2001年起任西部证券股份有限公司董事总经理。自2010年起任公司董事长。

贺燕萍女士，董事，硕士研究生，高级经济师。毕业于中国社会科学院研究生院，获经济学硕士学位，18年证券从业经历。1990年起任北京市永安宾馆业务主管。1998年起任华夏证券股份有限公司研究所客户部经理。2006年起任中信建投证券股份有限公司机构销售部总经理助理。2007年起在光大证券股份有限公司工作，历任销售交易部副总经理、销售交易部总经理。2013年1月起任光大证券资产管理公司总经理。2013年8月起任国泰基金管理有限公司副总经理。自2015年11月起任公司总经理。

刘建武先生：董事

刘建武先生，董事，博士研究生，高级经济师。毕业于西安西北大学，获经济学博士学位。1991年起在陕西省计划委员会经济研究所工作。1993年起在西安市人民政府办公厅工作，历任财贸、金融、经济管理副处级秘书，科技文教管理处处长。2001年起任西安高新管委会管理办副主任及西安高科集团公司副总经理。2002年起任西安市投资服务中心投资管理副主任。2003年起任陕西省投资集团公司金融证券管理部门经理。2005年10月任西部证券股份有限公司董事长、党委书记。目前兼任陕西能源集团有限公司董事、中国证券业协会理事、陕西证券期货业协会会长。

李兴春先生：董事

李兴春先生，董事，博士。毕业于南京大学，获管理科学与工程博士学位。曾任携程旅行网高级总监，富友证券有限责任公司副总裁，泛亚信托投资有限公司执行副总裁，西部发展控股有限公司董事、总裁，现任上海利得财富管理有限公司执行董事。

陈伟忠先生：独立董事

陈伟忠，教授，独立董事，博士研究生。毕业于西安交通大学，获管理学博士学位。长期从事金融研究及管理工作。1984年起历任西安交通大学教研室

主任、系主任、博导，同济大学经管学院现代金融研究所所长。现担任同济大学经济金融系主任、同济大学上海期货研究院院长、应用经济学学术委员会主任、中国金融学会金融工程分会理事、上海金融学会常务理事。

沈宏山先生：独立董事

沈宏山先生：独立董事。毕业于北京大学法学院，获法学硕士学位。曾任君安证券、国泰君安证券法律事务部、人力资源部、收购兼并部门业务董事，方正证券法律事务部总经理等职务。爱建证券有限公司、上海辰光医疗股份有限公司独立董事，安信证券内核委员。现任德恒上海律师事务所主任，高级合伙人。

严荣荣女士：独立董事

严荣荣，独立董事，硕士研究生。毕业于西北政法学院、美国纽约大学法学院。曾任 Gless Lutz & Partner 律师事务所律师。现任君合律师事务所合伙人。中华全国律师协会会员和上海市律师协会会员。

## 2. 监事会成员：

王光辉先生：监事会主席

王光辉先生，监事会主席。毕业于中南财经政法大学工商管理专业，研究生学历。曾任陆家嘴国际信托公司济南业务部总经理，兴业银行济南分行同业部总经理，万家共赢资产管理有限公司副总经理。现任上海利得财富资产管理有限公司总裁助理。

何方先生：监事

何方先生，监事。毕业于上海财经大学，硕士研究生学历。曾任汉唐证券资产管理部研究员、西部证券投资管理总部投资经理、西部证券投资管理总部副总经理、西部证券投资管理总部总经理、西部证券总经理助理兼上海第一分公司总经理。现任西部证券副总经理兼上海第一分公司总经理。

杨超先生：监事

杨超先生，监事，硕士学历。先后毕业于上海同济大学信息工程专业，获学士学位；上海交通大学软件工程专业，获硕士学位。曾任汇添富基金高级 IT 经理、中银国际证券信息技术部经理、华夏证券软件开发工程师。现任公司总经理助理兼信息技术部总监兼电子商务部总监。

毛灵俊先生：监事

毛灵俊先生，监事。毕业于华东政法大学刑事司法学院，获法学学士学位。曾任职于申万菱信基金管理有限公司。现任公司监察稽核部总监。

### 3. 公司高级管理人员

安保和先生：董事长

安保和先生，董事长，硕士研究生，高级经济师。毕业于西安交大管理学院，获工商管理硕士学位，22年证券从业经历。1993年起任陕西省科技风险投资公司经理。1994年起任中国工商银行陕西省信托投资有限责任公司经理。1997年起在陕西信托投资有限公司工作，历任公司总经理助理、董事会秘书、副总经理。2001年起任西部证券股份有限公司董事总经理。自2010年起任公司董事长。

贺燕萍女士：总经理

贺燕萍女士，总经理，硕士研究生，高级经济师。毕业于中国社会科学院研究生院，获经济学硕士学位，18年证券从业经历。1990年起任北京市永安宾馆业务主管。1998年起任华夏证券股份有限公司研究所客户部经理。2006年起任中信建投证券股份有限公司机构销售部总经理助理。2007年起在光大证券股份有限公司工作，历任销售交易部副总经理、销售交易部总经理。2013年1月起任光大证券资产管理有限公司总经理。2013年8月起任国泰基金管理有限公司副总经理。自2015年11月起任公司总经理。

徐剑钧先生：督察长

徐剑钧先生，督察长，博士研究生，高级经济师。毕业于陕西师范大学、复旦大学及西安西北大学，分别获理学硕士（基础数学）和经济学博士学位。曾在英国爱丁堡大学从事资本市场研究工作，21年证券从业经历。1995年3月起任陕西省证监局市场部负责人。1995年10月起任陕西证券有限公司总经理助理。2001年起任西部证券股份有限公司副总经理。自2010年起任公司督察长。

### 4. 基金经理

付琦先生，基金经理。硕士毕业于加拿大渥太华大学工商管理专业。15年证券从业年限。曾任海通证券股份有限公司业务董事、招商基金管理有限公司机构理财部高级经理、研究部高级研究员。2013年7月加入西部利得基金管理有限公司，现任总经理助理兼投资总监兼投资部总监。自2013年8月起在我公

司担任西部利得新动向灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2015 年 4 月起任西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金经理。

原泉先生，基金经理。硕士毕业于复旦大学金融工程专业。5 年证券从业年限。曾任万得资讯有限公司项目经理、日邮物流（中国）有限公司经理、太平资产管理有限公司经理、财通基金管理有限公司产品经理。2013 年 8 月加入西部利得基金管理有限公司，曾任产品设计部总监。自 2015 年 4 月起在我公司担任西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金经理，自 2016 年 1 月起在我公司担任西部利得新盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

曹祥先生，基金经理助理，硕士研究生，毕业于南京大学微电子学与固体电子学专业，获工学硕士学位，6 年证券从业年限。曾任南证期货有限公司研究员、国泰君安期货有限公司研究员。2015 年 8 月加入西部利得基金管理有限公司，现任高级研究员。自 2015 年 12 月起任西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金经理助理。

#### 5. 投资决策委员会成员

本基金采取集体投资决策制度。

投资决策委员会由下述委员组成：

投资决策委员会主席，贺燕萍女士，总经理，硕士研究生，高级经济师。毕业于中国社会科学院研究生院，获经济学硕士学位，18 年证券从业经历。1990 年起任北京市永安宾馆业务主管。1998 年起任华夏证券股份有限公司研究所客户部经理。2006 年起任中信建投证券股份有限公司机构销售部总经理助理。2007 年起在光大证券股份有限公司工作，历任销售交易部副总经理、销售交易部总经理。2013 年 1 月起任光大证券资产管理有限公司总经理。2013 年 8 月起任国泰基金管理有限公司副总经理。自 2015 年 11 月起任公司总经理。

投资决策委员会成员，陶翀先生，联席投资总监。硕士研究生，毕业于上海财经大学应用经济学专业，获经济学硕士学位。11 年证券从业经验。历任新理益集团有限公司高级分析师、国华人寿保险股份有限公司投资经理。2012 年 3 月加入我公司，现任联席投资总监。

投资决策委员会成员，付琦先生，总经理助理兼投资总监兼投资部总监，硕士毕业于加拿大渥太华大学工商管理专业。15 年证券从业年限。曾任海通证券股份有限公司业务董事、招商基金管理有限公司机构理财部高级经理、研究

部高级研究员。2013年7月加入我公司。自2013年8月起在我公司担任西部利得新动向灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2015年4月起在我公司担任西部利得中证500等权重指数分级证券投资基金基金经理。

投资决策委员会成员，刘荟女士，投资部副总监，硕士毕业于辽宁大学应用数学专业。8年证券从业年限。曾任群益证券股份有限公司研究员。自2014年1月起在我公司担任研究员，现任投资部副总监。自2016年1月起担任西部利得策略优选混合型证券投资基金的基金经理。

投资决策委员会成员，韩丽楠女士，基金经理，硕士研究生，毕业于英国约克大学经济与金融专业，获理学硕士学位。11年证券从业年限。曾任渣打银行国际管理培训生、诺德基金管理有限公司研究员、上海元普投资管理有限公司固定收益投资总监。2015年5月加入西部利得基金管理有限公司，曾任基金经理助理。自2015年8月起担任西部利得成长精选灵活配置混合型证券投资基金、西部利得多策略优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自2016年2月起担任西部利得新盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自2016年3月起担任西部利得行业主题优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

6. 上述人员之间不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责

1. 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
2. 办理基金备案手续；
3. 对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
4. 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
5. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
6. 编制季度、半年度和年度基金报告；
7. 计算并公告基金资产及份额净值，确定基金份额申购、赎回价格；
8. 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
9. 召集基金份额持有人大会；
10. 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

11. 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

12. 有关法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他职责。

#### **四、基金管理人的承诺**

1. 基金管理人将遵守《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的相关规定，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法违规行为的发生。

2. 基金管理人不得从事下列行为：

- (1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

3. 基金经理承诺

(1) 依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

(2) 不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益；

(3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

#### **五、基金管理人内部控制制度及风险控制体系**

1. 内部控制制度概述

公司内部控制是指公司为合理地评价和控制风险，保证经营运作符合公司的发展规划，防范和化解风险，保护投资人、公司和公司股东的合法权益，在充分考虑内外部环境的基础上，通过建立组织机制、运用管理方法、实施操作程序与控制措施所形成的风险导向型的内部控制体系。

(1) 内部控制的原则

1) 健全性原则：内部控制须覆盖公司的各项业务、各个部门或机构和各级岗位，并渗透到各项业务过程，涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节；



2) 有效性原则：通过科学的内控手段和方法，建立合理适用的内控程序，并适时调整和不断完善，维护内控制度的有效执行；

3) 独立性原则：公司各机构、部门和岗位的职责应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离；

4) 防火墙原则：公司管理的基金资产、自有资产以及其他资产的运作应当分离，基金投资研究、决策、执行、清算、评估等部门和岗位，应当在物理上和制度上适当隔离，以达到风险防范的目的；

5) 相互制约原则：公司组织机构、内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡；

6) 成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

## (2) 内部控制的制度系统

公司内部控制制度系统包括四个层次：第一个层次是国家有关法律法规和公司章程；第二个层次是包括内部控制大纲在内的基本管理制度；第三个层次是部门管理制度；第四个层次是各项具体业务规则。

1) 国家有关法律法规是公司一切制度的最高准则，公司章程是公司管理制度的基本原则，公司章程、董事会及其下属的专门委员会的管理规定是制订各项制度的基础和前提；

2) 内部控制大纲是依据国家相关法律法规、监管机构的有关规定以及公司章程规定的内控原则而确定的方针和策略，是内部控制纲领性文件，对制订各项基本管理制度和部门业务规章起着指导性的作用。公司内部控制是公司为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理办法、操作程序与控制措施的总称；

3) 公司基本管理制度包括了以下内容：内部控制大纲、风险控制制度、投资管理制度、监察稽核制度、基金会计制度、信息披露制度、信息技术管理制度、紧急应变制度、公司财务管理制度、人力资源管理制度和资料档案管理制度等；

4) 部门管理制度是根据公司章程和内控大纲等文件的要求，在基本管理制度的基础上，对各部门内部管理的具体说明，包括主要职责、岗位设置、岗位责任及操作规程等；

5) 各项具体业务规则是针对公司的某项具体业务, 对该业务的操作要求、流程、授权等作出的详细完整的规定。

### (3) 内部控制的要素

公司内部控制的要素主要包括: 控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通及内部监控。

#### 1) 控制环境

公司设立董事会, 向股东会负责。董事会由 7 名董事组成, 其中独立董事 3 名。董事会下设合规审核委员会、资格审查委员会及薪酬与考核委员会等各专门委员会。董事会是股东会的执行机构, 依照法律法规及公司章程的规定贯彻执行股东会的决议, 行使决定公司经营和投资方案等重大职权。公司设立监事会, 向股东会负责, 依照《公司法》和公司章程对公司经营管理活动、董事和公司管理层的经营管理行为进行监督。公司的日常经营管理工作在总经理的领导下运行, 总经理直接对董事会负责。

公司设立督察长, 对董事会负责, 负责监督检查基金和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况, 行使法律法规及公司章程规定的职权。

#### 2) 风险评估

A、董事会下属的合规审核委员会对公司制度的合规性和有效性进行评估, 并对公司与基金运作的合法合规性进行监督检查, 以协助董事会确定风险管理目标, 提出风险防范措施的建议, 建立并有效维持公司内部控制系统, 确保公司规范健康发展;

B、公司经营层下设风险控制委员会, 向总经理负责, 负责对基金投资风险控制及公司运作风险控制的有效性进行分析和评估, 评估公司面临的风险事项将导致公司在承担法律责任、社会和公众责任、经济损失或是在以上三个领域的任何组合损失, 以及对商业机会、运营基础以及法律责任等方面的影响, 具体包括负责审核公司的风险控制制度和风险管理流程, 识别、监控与管理公司整体风险;

C、公司经营层下设投资决策委员会, 负责对公司的基金产品及各投资品种的市场风险、流动性风险、信用风险等进行风险分析和评估, 采用风险量化技术和风险限额控制等方法把控基金投资整体风险;

D、各业务部门是公司内部控制的具体实施单位, 负责对职责范围内的业务

所面临的风险进行识别和评估。各业务部门在公司基本管理制度的基础上，根据具体情况制订本部门的业务管理规定、操作流程及内部控制规定，对业务风险进行控制。部门管理层定期对部门内风险进行评估，确定风险管理措施并实施，监控风险管理绩效，以不断改进风险管理能力。

### 3) 控制活动

公司根据自身经营的特点，从组织结构、操作流程及报告制度等多种管理方式入手，设立顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线：

A、各岗位职责明确，有详细的岗位说明书和业务流程，各岗位人员在上岗前均应知悉并以书面方式承诺遵守，在授权范围内承担责任；

B、建立重要业务处理凭据传递和信息沟通机制，相关部门和岗位之间相互监督制衡；

C、公司督察长和内部监察稽核部门独立于其他部门，对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈。

### 4) 信息与沟通

公司采用适当、有效的信息系统，识别、采集、加工并相互交流经营活动所需的一切信息。信息系统须保证业务经营信息和财务会计资料的真实性、准确性和完整性，必须能实现公司内部信息的沟通和共享，促进公司内部管理顺畅实施。公司根据组织架构和授权制度，建立清晰的业务报告系统，保障信息的及时、准确的传递，并且维护渠道的畅通。

### 5) 内部监控

公司内部控制的监督系统由监事会、督察长和监察稽核部等组成，监督系统通过其监督职能的行使确保公司决策系统和执行系统合法、合规、高效地运作。根据市场环境、新的金融工具、新的技术应用和新的法律法规等情况，公司组织专门部门对原有的内部控制进行全面的自查，审查其合法合规性、合理性和有效性，适时改进。

#### (4) 内部控制的检测

内部控制检测的过程包括如下：

- 1) 内控制度设计检测；
- 2) 内部控制执行情况测试；
- 3) 将测试结果与内控目标进行比较；

4) 形成测试报告, 得出继续运行或纠偏的结论。

## 2. 风险控制体系

公司风险控制体系包括以下三个层次:

1) 第一层次为公司各业务相关部门对各自部门的风险控制负责;

2) 第二层次为总经理、风险控制委员会及监察稽核部;

3) 第三层次为董事会、合规审核委员会及督察长;

4) 为了有效地控制公司内部风险, 公司各业务部门建立第一道监控防线。

独立的监察稽核部, 对各业务部门的各项业务全面实行监督反馈, 必要时对有关部门进行不定期突击检查。同时, 监察稽核部对于日常操作中发现的或认为具有潜在可能的问题出具监察稽核报告向风险控制委员会和总经理报告, 形成第二道监控防线。督察长在工作上向中国证监会和董事会负责, 并就将检查结果汇报合规审核委员会和董事会, 形成第三道监控防线。

## 3. 基金管理人关于内部控制的声明

(1) 本基金管理人知晓建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任;

(2) 上述关于内部控制的披露真实、准确;

(3) 本公司承诺将根据市场环境变化及公司发展不断完善内部控制制度。

## 第二部分 基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称: 兴业银行股份有限公司

注册地址: 福州市湖东路 154 号

办公地址: 福州市湖东路 154 号

法定代表人: 高建平

成立日期: 1988 年 8 月 22 日

注册资本: 人民币 190.52 亿元

托管部门联系人: 杨扬

电话: 021-52629999

传真：021-62159217

## 2、发展概况及财务状况：

兴业银行成立于 1988 年 8 月，是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一，总行设在福建省福州市，2007 年 2 月 5 日正式在上海证券交易所挂牌上市（股票代码：601166），注册资本 190.52 亿元。自开业以来，兴业银行始终坚持与客户“同发展、共成长”和“服务源自真诚”的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。开业二十多年来，兴业银行始终坚持“真诚服务，相伴成长”的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务，坚持走差异化发展道路，经营实力不断增强。根据 2015 年业绩快报，截至 2015 年 12 月 31 日，兴业银行资产总额达 5.30 万亿元，实现营业收入 1544.99 亿元，全年实现归属于母公司股东的净利润 502.57 亿元。在 2015 年英国《银行家》杂志全球银行 1000 强排名中，兴业银行按一级资本排名位列第 36 位；在 2015 年《福布斯》全球上市企业 2000 强排名中，兴业银行位居第 73 位；在 2015 年《财富》世界 500 强中，兴业银行排名第 271 位，稳居全球银行 50 强、全球上市企业 100 强、世界企业 500 强。同时，在国内外各种权威机构组织的评比中，先后荣获“最佳中资银行”、“最佳战略创新银行”、“最佳绿色银行”、“亚洲可持续银行奖冠军”、“年度金控集团”、“最佳普惠金融银行”、“中国上市公司卓越董事会（主板）”、“亚洲最佳股东回报银行”、“最具社会责任上市公司”、“中华慈善突出贡献（单位）奖”、“中国最佳雇主”等多项大奖。

## 3、托管业务部的部门设置及员工情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合管理处、市场处、委托资产管理处、科技支持处、稽核监察处、运营管理处、期货业务管理处、期货存管结算处和养老金管理中心等处室，共有员工 120 余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

## 4、基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于 2005 年 4 月 26 日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74 号。截止 2016 年 3 月 31 日，兴业银行已托管开放式基金 82 只，托管基金财产规模 2824.63 亿元。

## 二、基金托管人的内部风险控制制度说明

## 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

## 2、内部控制组织结构

兴业银行基金托管业务内部风险控制组织结构由兴业银行风险管理部、法律与合规部、审计部、资产托管部内设稽核监察处及资产托管部各业务处室共同组成。总行风险管理部、法律与合规部、审计部对托管业务风险控制工作进行指导和监督；资产托管部内设独立、专职的稽核监察处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。。

## 3、内部风险控制原则

(1) 全面性原则：风险控制必须覆盖基金托管部的所有处室和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；风险控制责任应落实到每一业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

(2) 独立性原则：资产托管部设立独立的稽核监察处，该处室保持高度的独立性和权威性，负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

(3) 相互制约原则：各处室在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。

(4) 定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

(5) 防火墙原则：托管部自身财务与基金财务严格分开；托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门严格分离。

(6) 有效性原则。内部控制体系同所处的环境相适应，以合理的成本实现内控目标，内部制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制应当具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权力，内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正；

(7) 审慎性原则。内控与风险管理必须以防范风险，审慎经营，保证托管资产的安全与完整为出发点；托管业务经营管理必须按照“内控优先”的原则，在新设机构或新增业务时，做到先期完成相关制度建设；

(8) 责任追究原则。各业务环节都应有明确的责任人，并按规定对违反制度的直接责任人以及对负有领导责任的主管领导进行问责。

#### 4、内部控制制度及措施

(1) 制度建设：建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

(2) 建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。

(3) 风险识别与评估：稽核监察处指导业务处室进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。

(4) 相对独立的业务操作空间：业务操作区相对独立，实施门禁管理和音像监控。

(5) 人员管理：进行定期的业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。

(6) 应急预案：制定完备的《应急预案》，并组织员工定期演练；建立异地灾备中心，保证业务不中断。

### 三、基金托管人对本基金管理人进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，基金托管人对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场的信用风险控制、基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金的申购与赎回、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

基金托管人每日按时通过托管业务系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控：如发现接近法律法规和基金合同规定的控制比例情况，严密监

视，及时提醒基金管理人；发现违规行为，与基金管理人进行情况核实，并向基金管理人发出书面通知，督促其纠正，同时报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人并及时向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律法规，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人并及时向中国证监会报告。

## 第三部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### (1) 直销机构:

名称: 西部利得基金管理有限公司

住所: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号11层02、03单元

办公地址: 上海市浦东新区杨高南路799号陆家嘴世纪金融广场3号楼11层

法定代表人: 安保和

联系人: 韦佳

联系电话: (021) 38572888

网址: [www.westleadfund.com](http://www.westleadfund.com)

#### (2) 代销机构:

##### 1、场外代销机构

###### (1) 国泰君安证券股份有限公司

住所: 上海市浦东新区商城路618号



办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人：万建华

客户服务电话：400-8888-666

传真：(021) 38670666

联系电话：(021) 38676666

网址：www.gtja.com

(2) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层

办公地址：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层

法定代表人：李梅

客户服务电话：95523、400-889-5523

公司网址：www.swhysc.com

(3) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室（邮编：830002）

法定代表人：许建平

客户服务电话：400-800-0562

传真：010-88085195

网址：www.hysec.com

(4) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层法定代表人：其实

电话：(021) 54509988

传真：(021) 64385308

客服电话：400-1818-188

公司网址：www.1234567.com.cn

(5) 杭州数米基金销售有限公司

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼

法定代表人：陈柏青

电话：（021）60897840

传真：（0571）26698533

客服电话：400-0766-123

公司网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

（6）浙江同花顺基金销售有限公司

公司地址：浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼

法定代表人：凌顺平

电话：0571-88911818

客服电话：4008-773-772

网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

（7）上海利得基金销售有限公司

地址：上海市浦东新区峨山路91弄61号1幢12层（陆家嘴软件园10号楼）

法定代表人：沈继伟

电话：（021）50583533

传真：（021）50583535

客服电话：400-033-7933

网址：[www.leadbank.com.cn](http://www.leadbank.com.cn)

（8）上海陆金所资产管理有限公司

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼

法定代表人：郭坚

电话：021-20665952

客服：400-821-9031

网址：[www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

（9）平安证券有限责任公司

办公地址：深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层

法定代表人：谢永林

电话：95511-8

网址：<http://stock.pingan.com>

（10）国金证券股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区芳甸路 1088 号紫竹国际大厦

法定代表人：冉云

电 话：95310

## 2、场内发售机构

(1) 本基金的场内发售机构为具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位。

(2) 本基金募集结束前获得基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位可新增为本基金的场内发售机构。

3、基金管理人可根据有关法律法规要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述销售机构，并及时公告。

## 二、注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

电话：（010）50938888

传真：（010）50938907

联系人：周莉

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

住所：上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室

办公地址：上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室

负责人：廖海

联系电话：（021）51150298

传真：（021）51150398

联系人：廖海

经办律师：廖海、刘佳

#### 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心  
11 楼

法定代表人：杨绍信

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：曹阳

经办注册会计师：单峰、曹阳

### 第四部分 基金的名称

西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金

### 第五部分 基金的类型

契约型开放式

### 第六部分 基金的投资目标

本基金采用指数化投资策略，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，追求对中证500等权重指数的有效跟踪。力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内，以分享中国经济的长期增长的成果，实现基金资产的长期增值。

### 第七部分 基金的投资范围

投资于具有良好流动性的金融工具，包括股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（不含中小企业私募债）、债券回购、资产支持证券、权证、央行票据、货币市场工具、银行存款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)。其中，中证 500 等权重指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%且不低于非现金资产的 80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

## 第八部分 基金的投资策略

本基金主要采用完全复制法，按照在中证 500 等权重指数中的成份股的构成及其基准权重构建股票投资组合，以拟跟踪中证 500 等权重指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，使跟踪误差控制在限定的范围之内。

### 1、资产配置策略

本基金管理人主要按照中证 500 等权重指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金投资于中证 500 等权重指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%；现金以及到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。基金管理人将综合考虑股票市场情况、基金资产的流动性要求等因素确定各类资产的具体配置比例。在巨额申购赎回发生、成份股大比例分红等情况下，管理人将在综合考虑冲击成本因素和跟踪效果后，及时将股票配置比例调整至合理水平。

### 2、股票投资策略

#### (1) 股票组合构建原则

本基金通过复制指数的方法，根据中证 500 等权重指数成份股组成及其基准权重构建股票投资组合。当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、

分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证 500 等权重指数的效果可能带来影响时，基金管理人将根据市场情况，采取合理措施控制基金的跟踪误差。

在特殊情况下，本基金将选择其他股票或股票组合对标的指数中的股票加以适当替换，这些情况包括但不限于以下情形：

- 1) 法律法规的限制；
- 2) 标的指数成份股流动性严重不足，或因受股票停牌的限制等其他市场因素，使基金管理人无法依指数权重购买某成份股；
- 3) 本基金资产规模过大导致本基金持有某些股票比例过高；
- 4) 成份股上市公司存在重大虚假陈述等违规行为、或者面临重大的不利行政处罚或司法诉讼；
- 5) 预期标的指数的成份股即将调整。

为了减小跟踪误差，本基金按照主营业务相近、市值相近、相关性较高及  $\beta$  值相近等原则来选择替代股票。

## (2) 股票组合调整方法

本基金将采用完全复制法构建股票投资组合，根据中证 500 等权重指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。同时，本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增发等因素的变化，对股票投资组合进行适时调整，以保证基金净值增长率与中证 500 等权重指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。

## 3、债券投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等流动性好的债券。本基金对债券进行配置的原则是：安全性与流动性优先，且兼顾收益性。

本基金在满足安全性与流动性的前提下，通过对国内外宏观经济形势的把握和系统分析国内财政政策与货币市场政策等因素变化对债券市场的影响，审慎研判债券市场风险收益特征的变化趋势，采取自上而下的策略构造组合，进行个券选择。

## 第九部分 基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：

$95\% \times \text{中证 500 等权重指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行人民币活期存款利率（税后）}$

本基金采取如上的业绩比较基准的主要理由是：1、本基金不低于 90%、不超过 95%的基金净资产将投资于中证 500 等权重指数成分股及其备选成分股，故选取中证 500 等权重指数收益率  $\times 95\%$  作为本基金股票投资的业绩比较基准；2、考虑到现金或到期日在一年以内的政府债券不得低于基金资产净值的 5%，故选取商业银行人民币活期存款利率（税后） $\times 5\%$  作为本基金固定收益类资产、货币资产的业绩比较基准是适当的。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更适于作为本基金业绩比较基准的指数时，本基金经基金管理人和基金托管人协商一致，可以在上报中国证监会备案后变更业绩比较基准，并及时公告，而不需召开基金份额持有人大会。

## 第十部分 基金的风险收益特征

本基金为股票型指数基金，预期风险大于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额看，西部利得中证 500 等权重 A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；西部利得中证 500 等权重 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。

## 第十一部分 基金的投资组合报告

基金管理人的董事会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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据基金合同规定，复核了本报告中的投资组合报告内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截止 2016 年 3 月 31 日，本报告所列财务数据未经审计。

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	9,586,547.36	91.74
	其中：股票	9,586,547.36	91.74
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	-	-
	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	739,820.21	7.08
7	其他资产	123,708.91	1.18
8	合计	10,450,076.48	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

(1) 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	169,885.00	1.67
B	采矿业	450,838.00	4.43
C	制造业	5,826,403.43	57.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	340,648.85	3.35
E	建筑业	303,518.06	2.98
F	批发和零售业	588,738.36	5.78
G	交通运输、仓储和邮政业	290,107.40	2.85
H	住宿和餐饮业	20,495.00	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	407,757.46	4.00
J	金融业	73,119.60	0.72
K	房地产业	550,632.60	5.41
L	租赁和商务服务业	144,795.10	1.42
M	科学研究和技术服务业	55,104.00	0.54
N	水利、环境和公共设施管理业	67,332.50	0.66
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-



Q	卫生和社会工作	22,500.00	0.22
R	文化、体育和娱乐业	170,973.00	1.68
S	综合	103,699.00	1.02
	合计	9,586,547.36	94.16

(2) 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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

(1) 报告期末指数投资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

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(%)
1	002018	华信国际	4,400	109,120.00	1.07
2	002219	恒康医疗	7,250	108,025.00	1.06
3	000563	陕国投A	2,500	35,725.00	0.35
4	600880	博瑞传播	3,100	34,596.00	0.34
5	002371	七星电子	1,200	32,664.00	0.32
6	002431	棕榈园林	1,000	31,800.00	0.31
7	600298	安琪酵母	800	30,304.00	0.30
8	002001	新和成	1,400	29,680.00	0.29
9	002299	圣农发展	1,100	29,579.00	0.29
10	600216	浙江医药	2,200	29,370.00	0.29

(2) 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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. 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. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明  
细

本基金本报告期末未持有权证。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

股指期货不在本基金投资范围内。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货不在本基金投资范围内。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本基金投资国债期货的投资政策

国债期货不在本基金投资范围内。

(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。

(3) 本基金投资国债期货的投资评价

国债期货不在本基金投资范围内。

11. 投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券中，除恒康医疗（002219.SZ）因公司信息  
披露涉嫌违反证券法律法规于2016年2月3日被中国证监会立案稽查外，其余  
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。

(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。

(3) 其他资产构成。

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	12,600.72
2	应收证券清算款	110,653.55
3	应收股利	-
4	应收利息	454.64
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	123,708.91

(4) 报告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。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

1) 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002018	华信国际	109,120.00	1.07	重大资产重组
2	002219	恒康医疗	108,025.00	1.06	重大事项

2) 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

(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。

## 第十二部分 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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

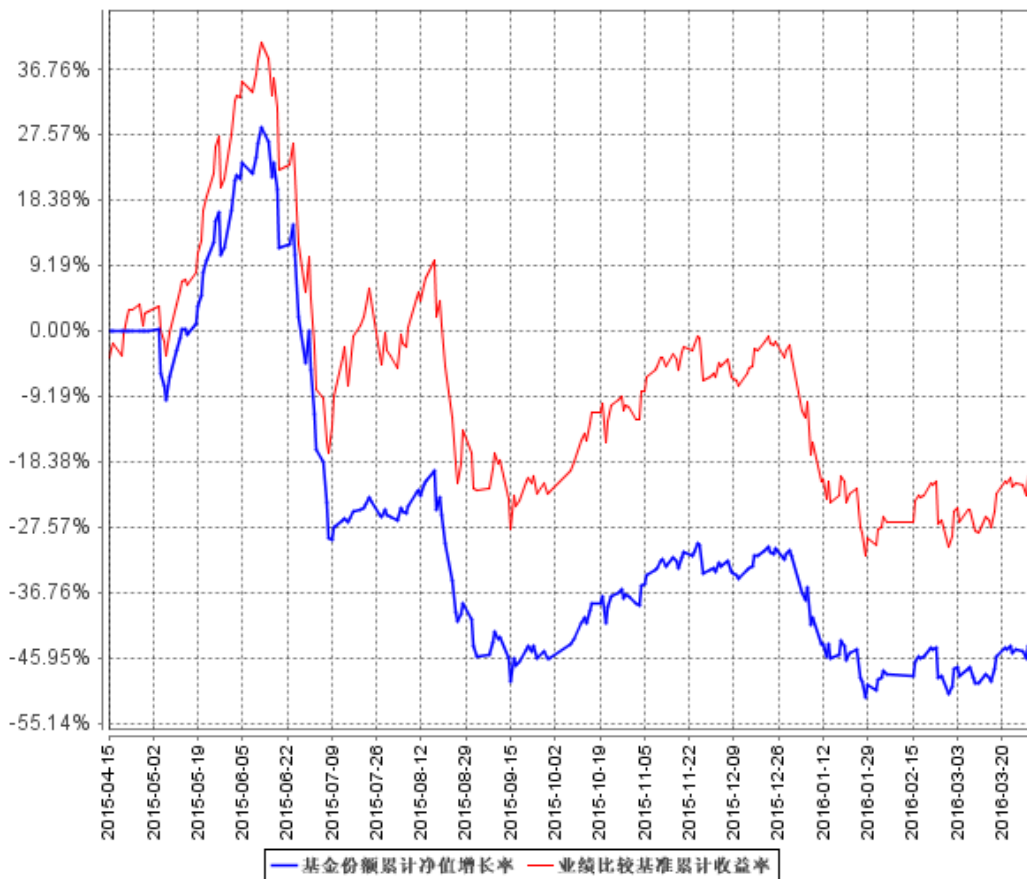
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2015年4月15日-2015年12	-31.50%	2.70%	-3.46%	3.06%	-28.04%	-0.36%

月31日						
2016年1月1日-2016年3月31日	-18.10%	3.01%	-17.42%	3.12%	-0.68%	-0.11%
2015年4月15日-2016年3月31日	-43.90%	2.78%	-20.28%	3.07%	-23.62%	-0.29%

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

西部利得中证500等权重指数分级证券投资基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

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



## 第十三部分 费用概览

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后的标的指数使用费；
- 4、基金上市费用；
- 5、因基金的证券交易或结算而产生的费用；
- 6、《基金合同》生效以后的信息披露费用；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、《基金合同》生效以后与基金有关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 9、基金的资金汇划费用；
- 10、证券账户开户费用、银行账户维护费用；
- 11、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

## 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值的 1.0%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.0%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。如遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。如遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 3、《基金合同》生效后的标的指数使用费

根据基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议，本基金标的的指数使用费年费率为 0.02%。通常情况下，指数使用费按前一日基金资产净值的 0.02%的年费率计提。

计算方法如下：

$$H=E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日计提的指数使用费

E 为前一日的基金资产净值

标的指数使用费从《基金合同》生效日开始每日计算，逐日累计，按季支付。标的指数使用费收取下限为每季度 5 万元（《基金合同》生效当季按实际计提金额收取，不设下限）。标的指数使用费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于次季初 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

如与指数编制方的指数使用协议约定的收费标准、支付方式等发生变更，按照变更后的费率、支付方式执行，此项无需召开基金份额持有人大会。

4、上述“一、基金费用的种类中第 4 至第 11 项费用”由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

### 三、不列入基金费用的项目

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 四、基金管理费和基金托管费的调整

调高基金管理费率、基金托管费率（但根据法律法规的要求提高该等报酬费率标准的除外），须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

## 五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 六、与基金销售有关的费用

### 1、西部利得中证 500 等权重份额的申购费用

西部利得中证 500 等权重份额的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

西部利得中证 500 等权重份额的申购费率：

场外申购费率	申购金额 (M)	申购费率
	M<50 万	1.00%
	50 万≤M<100 万	0.60%
	M≥100 万	每笔 1000 元
场内申购费率	申购金额 (M)	申购费率
	M<50 万	0
	50 万≤M<100 万	0
	M≥100 万	0

### 2. 西部利得中证 500 等权重份额的赎回费用

投资者可将其持有的全部或部分西部利得中证 500 等权重份额赎回。西部利得中证 500 等权重份额的赎回费用在投资者赎回西部利得中证 500 等权重份额时收取，扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产。

#### (1) 西部利得中证 500 等权重份额的场外赎回费率

场外赎回费	持有时间	赎回费率
	1 年以下	0.50%
	1 年 (含 1 年) - 2 年	0.25%
	2 年以上 (含 2 年)	0%

注 1：就赎回费率的计算而言，1 年指 365 日，2 年指 730 日，以此类推。

注 2：上述持有期是指在注册登记系统内，投资人持有基金份额的连续期限。

(2) 西部利得中证 500 等权重份额的场内赎回费率为固定值 0.5%，不按基金份额持有时间分段设置赎回费率。从场内转托管至场外的西部利得中证 500 等权重份额，从场外赎回时，其持有期限从转托管转入确认日开始计算。

3、基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4、基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低西部利得中证 500 等权重份额的销售费率。

#### 七、其他费用

本基金其他费用根据相关法律法规执行。

### 第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，对 2015 年 11 月 27 日公布的《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金招募说明书》进行更新，并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要更新的内容如下：

1. 根据最新资料，更新了“重要提示”部分。
2. 根据最新资料，更新了“第三部分 基金管理人”部分。
3. 根据最新资料，更新了“第四部分 基金托管人”部分。
4. 根据最新资料，更新了“第五部分 相关服务机构”部分。
5. 根据最新资料，更新了“第七部分 基金的募集”部分
6. 根据最新资料，更新了“第十部分 西部利得中证500等权重份额的申购与赎回”部分



7. 根据最新资料，更新了“第十三部分 基金的投资”部分。
8. 根据最新公告，更新了“第二十七部分 其他应披露的事项”。

西部利得基金管理有限公司

2016年5月27日