

# 西部利得个股精选股票型证券投资基金

## 更新招募说明书

(2019 年第二期)

### (摘要)

#### 【重要提示】

本基金的募集申请经中国证券监督管理委员会 2016 年 9 月 28 日证监许可【2016】2220 号文准予注册。本基金的基金合同于 2017 年 1 月 23 日生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册，但中国证监会对本基金募集申请的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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。

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，也包括本基金的特定风险等。本基金资产可投资于科创板股票，科创板股票的特定风险主要包括流动性风险、退市风险和投资集中风险等。本基金的一般风险及特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节等。

本基金参与科创板投资，基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分资产投资于科创板或选择不将基金资产投资于科创板，基金资产并非必然投资科创板。

本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，属于证券投资基金中的高风险水平投资品种。

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 2019 年 7 月 23 日，基金投资组合报告和基金业绩表现截止至 2019 年 6 月 30 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：何方

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：叁亿伍仟万元

存续期限：持续经营

联系人：陈眉媚

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	178,500,000	51%
利得科技有限公司	171,500,000	49%
合计	350,000,000	100%

## 二、主要人员情况

### 1、董事会成员

何方先生：董事长

何方先生，董事，硕士研究生。毕业于上海财经大学经济学专业。17年证券从业经历。历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。2010年起任西部证券副总经理。2017年3月至9月代为履行西部证券总经理职务。2017年9月起任西部证券总经理。自2019年3月起任公司董事长。

贺燕萍女士：董事

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，22年证券从业经历。曾任北京市永安宾馆业务主管、华夏证券股份有限公司研究所客户部经理、中信建投证券股份有限公司机构销售部总经理助理、光大证券股份有限公司销售交易部副总经理、光大证券股份有限公司销售交易部总经理、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。

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，利得科技有限公司执行董事，现任利得科技有限公司董事长兼总经理。

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 律师事务所法律顾问。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

徐剑钧先生：监事会主席

徐剑钧，监事会主席。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，24 年证券从业经历。曾任陕西省证监局市场部负责人、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。2010 年 7 月加入本公司，历任公司督察长、董事长，自 2018 年 10 月起任公司监事会主席。

谢娟女士：监事

谢娟女士，监事。毕业于四川大学行政管理专业，获硕士学位。曾任中国银行重庆市分行助理风险经理、南洋商业银行总行风险主任。现任公司风险管理部副总经理（主持工作）。

何晔女士：监事

何晔女士，监事。毕业于复旦大学应用数学专业。曾任友邦保险公司中国区呼叫中心副经理、国泰基金管理有限公司客服部呼叫中心主管、客服部副总监（主持工作），现任公司营销服务部总经理、电子商务部总经理。

### 3、公司高级管理人员

何方先生：董事长

何方先生，董事长，硕士研究生学历，毕业于上海财经大学经济学专业。17 年证券从业经历。历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。2010 年起任西部证券副总经理。2017 年 3 月至 9 月代为履行西部证券总经理职务。2017 年 9 月起任西部证券总经理。自 2019 年 3 月起任公司董事长。

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，22 年证券从业经历。曾任北京市永安宾馆业务主管、华夏证券股份有限公司研究所客户部经理、中信建投证券股份有限公司机构销售部总经理助理、光大证券股份有限公司销售交易部副总经理、光大证券股份有限公司销售交易部总经理、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。

赵毅先生：督察长

赵毅先生，督察长，硕士研究生，毕业于加拿大卡尔加里大学工商管理硕士专业，23 年证券从业经历。曾任北京大学社会科学处职员、北京市波姆红外技术公司总经理助理、华夏证券有限责任公司高级投资经理、华夏基金管理有限公司股票分析师、华夏基金管理有限公司风险管理部总经理助理。2015 年 12 月加入本公司，历任公司风险管理部总经理，自 2016 年 9 月起任公司督察长。

### 4、本基金基金经理

刘荟女士，公募投资部副总经理、基金经理，硕士毕业于辽宁大学应用数学专业。11 年证券从业年限。曾任群益证券股份有限公司研究员。2014 年 1 月加入本公司，曾任研究员，现任公募投资部副总经理、基金经理。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，自 2016 年 8 月至 2017 年 10 月担任西部利得景瑞灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自 2016 年 11 月至 2017 年 12 月担任西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自 2017 年 1 月至 2018 年 5 月担任西部利得个股精选股票型证

券投资基金的基金经理，自 2017 年 3 月至 2018 年 5 月担任西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自 2017 年 7 月至 2019 年 6 月担任西部利得祥瑞债券型证券投资基金的基金经理，自 2018 年 6 月起担任西部利得景程灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自 2018 年 9 月起担任西部利得事件驱动股票型证券投资基金的基金经理，自 2019 年 3 月担任西部利得个股精选股票型证券投资基金的基金经理，自 2019 年 4 月担任西部利得新动向灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

崔惠军先生，公募投资部副总经理、权益量化投资总监、公募权益投资部总经理、公募指数投资部总经理、基金经理，硕士毕业于中国人民大学数量经济专业。18 年证券从业年限。曾任世纪证券证券投资部分析师、中企东方资产管理有限公司投资策略部高级经理、东方证券金融衍生品业务总部总经理助理、鹏华基金量化及衍生品投资部总经理助理。于 2017 年 8 月加入本公司，现任公募投资部副总经理、权益量化投资总监、公募权益投资部总经理、公募指数投资部总经理、基金经理。自 2018 年 1 月至 2019 年 3 月担任西部利得个股精选股票型证券投资基金的基金经理。

#### 5、基金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：

投资决策委员会主任委员，王宇先生，总经理助理、公募投资部总经理。硕士毕业于南开大学金融学专业，13 年证券从业年限。曾任上海银行股份有限公司交易员、光大证券股份有限公司投资经理、交银施罗德基金管理有限公司投资经理。2016 年 9 月起加入西部利得基金管理有限公司，曾任公司专户投资部副总经理、专户投资部总经理、投资经理，现任总经理助理、公募投资部总经理。

投资决策委员会副主任委员，崔惠军先生，公募投资部副总经理、权益量化投资总监、公募权益投资部总经理、公募指数投资部总经理、基金经理。硕士毕业于中国人民大学数量经济专业，获得理学硕士学位。18 年证券从业年限。曾任世纪证券证券投资部分析师、中企东方资产管理有限公司投资策略部高级经理、东方证券金融衍生品业务总部总经理助理、鹏华基金量化及衍生品投资部总经理助理。于 2017 年 8 月加入本公司，现任公募投资部副总经理、权

益量化投资总监、基金经理。自 2018 年 7 月起担任西部利得中证国有企业红利指数增强型证券投资基金 (LOF) 的基金经理, 自 2018 年 10 月起担任西部利得事件驱动股票型证券投资基金的基金经理。

投资决策委员会委员, 吴江先生, 总经理助理、投资总监, 硕士毕业于复旦大学财政学专业。13 年证券从业年限。曾任兴业银行资金营运中心交易员、农银汇理基金管理有限公司基金经理、固定收益部副总经理。2016 年 8 月加入本公司, 现任总经理助理、投资总监。

投资决策委员会委员, 刘荟女士, 公募投资部副总经理、基金经理, 毕业于辽宁大学应用数学专业。11 年证券从业年限。曾任群益证券股份有限公司研究员。2014 年 1 月加入本公司, 曾任研究员, 现任公募投资部副总经理、基金经理。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, 自 2018 年 6 月起担任西部利得景程灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 自 2018 年 9 月起担任西部利得事件驱动股票型证券投资基金的基金经理, 自 2019 年 3 月担任西部利得个股精选股票型证券投资基金的基金经理, 自 2019 年 4 月担任西部利得新动向灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

投资决策委员会委员, 韩丽楠女士, 机构部副总经理、基金经理, 硕士毕业于英国约克大学经济与金融专业, 获理学硕士学位。15 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, 现任机构部副总经理、基金经理。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, 自 2016 年 6 月起担任西部利得稳健双利债券型证券投资基金的基金经理, 自 2016 年 12 月起担任西部利得祥运灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 自 2017 年 2 月起担任西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 自 2017 年 8 月起担任西部利得天添益货币市场基金的基金经理, 自 2018 年 5 月起担任西部利得汇盈债券型证券投资基金的基金经理, 自 2018 年 11 月起担任西部利得新富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

投资决策委员会委员，陈保国先生，研究部总经理，硕士毕业于上海理工大学系统理论专业，获理学硕士学位。9 年证券从业年限。曾任西藏同信证券有限公司研究员、上海嘉华投资有限公司研究员。2016 年 1 月加入我公司，曾任研究员、研究部副总经理、研究部副总经理（主持工作），现任研究部总经理。

投资决策委员会委员，盛丰衍先生，基金经理，硕士毕业于复旦大学计算机应用技术专业，获得理学硕士学位。6 年证券从业年限。曾任光大证券股份有限公司权益投资助理、上海光大证券资产管理有限公司研究员、兴证证券资产管理有限公司量化研究员。2016 年 10 月加入本公司，现任基金经理。自 2016 年 11 月起担任西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金的基金经理，自 2018 年 1 月起担任西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自 2018 年 7 月起担任西部利得中证国有企业红利指数增强型证券投资基金（LOF）的基金经理，自 2019 年 3 月起担任西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金的基金经理。

投资决策委员会委员，刘心峰先生，基金经理，英国曼彻斯特大学数量金融专业，获得理学硕士学位。7 年证券从业年限。曾任中德安联人寿保险有限公司交易员、华泰柏瑞基金管理有限公司交易员。2016 年 11 月加入本公司，现任基金经理。自 2017 年 2 月起担任西部利得天添鑫货币市场基金、西部利得天添富货币市场基金、西部利得合享债券型证券投资基金的基金经理，自 2017 年 8 月起担任西部利得天添益货币市场基金的基金经理，自 2019 年 6 月起担任西部利得添盈短债债券型证券投资基金。

投资决策委员会委员，严志勇先生，公募固定收益部副总经理（主持工作）、基金经理。硕士毕业于复旦大学数量经济学专业，获得理学硕士学位。8 年证券从业年限。曾任上海强生有限公司管理培训生、中国国际金融股份有限公司研究员、中证指数有限公司研究员、兴业证券股份有限公司研究员、鑫元基金管理有限公司债券研究主管。2017 年 5 月加入本公司，现任公募固定收益部副总经理（主持工作）、基金经理。自 2017 年 8 月起担任西部利得汇享债券型证券投资基金的基金经理，自 2018 年 4 月起担任西部利得合享债券型证券投资基金的基金经理，自 2018 年 6 月西部利得景程灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自 2018 年 11 月西部利得得尊纯债债券型证券投资基金的基金经



理，自 2019 年 6 月西部利得聚享一年定期开放债券型证券投资基金。

投资决策委员会委员，张翔先生，机构部联席总经理、基金经理。硕士毕业于荷兰代尔夫特理工大学概率、风险及统计专业，获得理学硕士学位。13 年证券从业年限。曾任上海汇富融略投资顾问有限公司助理副总裁、派杰亚洲证券有限公司研究员及产品协调员、华富基金管理有限公司高级经理、德邦基金管理有限公司基金经理。2017 年 3 月加入本公司，现任机构部联席总经理、基金经理。自 2017 年 10 月西部利得新润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) 不得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系统。

(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（以下简称“兴业银行”）

注册地址：福州市湖东路 154 号

办公地址：上海市银城路 167 号

法定代表人：高建平

成立时间：1988 年 8 月 22 日

注册资本：207.74 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2005]74 号

托管部门联系人：刘峰

电话：021-52629999

传真：021-62159217

### 二、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 207.74 亿元。

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。截至 2018 年 12 月 31 日，兴业银行资产总额达 6.71 万亿元，实现营业收入 1582.87 亿元，全年实现归属于母公司股东的净利润 606.20 亿元。

### 三、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、产品管理处、稽核监察处、运行管理处、养老金管理中心等处室，共有员工 100 余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

### 四、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。截至2019年6月30日，兴业银行共托管证券投资基金267只，托管基金的基金资产净值合计10468.1亿元，基金份额合计10311.43亿份。

## 五、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。

## 六、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。

## 七、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项，对基金管理人进行业务监督、核查。

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。基金管理人对基金托管人通知的违规事项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有关重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，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、行政法规和其他有关规定，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

##### （一）直销机构：

西部利得基金管理有限公司直销柜台及电子交易平台

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 楼

法定代表人：何方

联系人：陈眉媚

客服热线：400-700-7818

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

##### （二）代销机构：

#### 1.西部证券股份有限公司

地址：西安市新城东大街 319 号 8 幢 10000 室

法定代表人：刘建武

联系人：梁承华

客服热线：95582

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

#### 2.上海利得基金销售有限公司

地址：上海虹口区东大名路 1098 号 53 楼

法定代表人：李兴春

联系人：曹怡晨

客服热线：400-921-7755

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

### 3. 中国银行股份有限公司

公司地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

联系人：陈洪源

客服热线：95566

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

### 4. 申万宏源证券有限公司

地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系人：黄莹

客服热线：95523 或 4008895523

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

### 5. 中国银河证券股份有限公司

地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈共炎

联系人：邓颜

客服热线：4008-888-888 或 95551

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

### 6. 中泰证券股份有限公司

地址：济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系人：许曼华

客服热线：95538

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

### 7. 国金证券股份有限公司

地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪、贾鹏

客服热线：95310

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

#### 8.平安证券股份有限公司

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：詹露阳

联系人：周驰

客服热线：95511-8

网址：[stock.pingan.com](http://stock.pingan.com)

#### 9.中信证券股份有限公司

地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

联系人：侯艳红

客服热线：95548

网址：<http://www.cs.ecitic.com/>

#### 10.中信证券（山东）有限责任公司

地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人：杨宝林

联系人：孙秋月

客服热线：95548

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

#### 11.招商证券股份有限公司

地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 38—45 层

法定代表人：官少林

联系人：黄婵君

客服热线：95565、4008888111

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

#### 12.上海华信证券有限责任公司

地址：上海市黄浦区南京西路 399 号明天广场 18-23 层

法定代表人：郭林

联系人：李颖

客服热线：4008205999

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

### 13. 国泰君安证券股份有限公司

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

联系人：钟伟镇

客服热线：400-8888-666

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

### 14. 中银国际证券有限责任公司

地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39F

法定代表人：钱卫

联系人：王炜哲

客服热线：400-620-8888

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

### 15. 国信证券股份有限公司

地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 6 楼

法定代表人：何如

联系人：周杨

客服热线：95536

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

### 16. 中信建投证券股份有限公司

地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：魏明

客服热线：400-8888-108

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

### 17. 光大证券股份有限公司

地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

联系人：刘晨

客服热线：95525

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

#### 18.长城证券股份有限公司

地址：深圳市福田区深南大道 6008 号报业大厦 14 楼、16 楼、17 楼

法定代表人：何伟

联系人：金夏

客服热线：400-6666-888

网址：<http://www.cgws.com>

#### 19.联储证券有限责任公司

地址：北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 27 层

法定代表人：沙常明

联系人：丁倩云

客服热线：4006206868

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

#### 20.世纪证券股份有限责任公司

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层

法定代表人：姜味军

联系人：王雯

客服热线：4008-323-000

网址：<http://www.csc.com.cn/>

#### 21.信达证券股份有限公司

地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

联系人：尹旭航

客服热线：95321

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

#### 22.安信证券股份有限公司

地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人：王连志

联系人：陈剑虹

客服电话：95517

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

### 23.东海证券股份有限公司

地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

联系人：王一彦

客服热线：95531；400-8888-588

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

### 24.申万宏源西部证券有限公司

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

法定代表人：韩志谦

联系人：王怀春

客服热线：0991-2307105

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

### 25.和讯信息科技有限公司

地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

联系人：于杨

客服热线：400-920-0022

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

### 26.浙江同花顺基金销售有限公司

地址：杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼

法定代表人：凌顺平

联系人：费超超

客服热线：4008-773-772

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

27.泛华普益基金销售有限公司

地址：四川省成都市锦江区东大街 99 号平安金融中心 1501 室

法定代表人：于海锋

联系人：陈金红

客服热线：4008588588

网址：<https://www.puyifund.com/>

28.上海陆金所资产管理有限公司

地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

法定代表人：鲍东华

联系人：宁博宇

客服热线：4008219031

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

29.蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

法定代表人：陈柏青

联系人：韩爱彬

客服热线：4000-766-123

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

30.深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

法定代表人：张彦

联系人：文雯

客服热线：4001661188

网址：<http://www.new-rand.cn/>

31.上海万得基金销售有限公司

地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：王廷富

联系人：徐亚丹

客服热线：400-821-0203

网址：[www.520fund.com.cn](http://www.520fund.com.cn)



32.奕丰金融服务（深圳）有限公司

地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人：TAN YIK KUAN

联系人：叶健

客服热线：400-684-0500

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

33.上海好买基金销售有限公司

地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：王诗琦

客服热线：400-700-9665

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

34.天津万家财富资产管理有限公司

地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 5 层

法定代表人：李修辞

联系人：邵玉磊

客服热线：010-59013825

网址：<http://www.wanjiawealth.com/>

35.泰诚财富基金销售（大连）有限公司

地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

法定代表人：林卓

联系人：姜焕洋

客服热线：0411-88891212

网址：<http://www.taichengcaifu.com>

36.武汉市伯嘉基金销售有限公司

地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第七幢 23 层 1 号 4 号

法定代表人：陶捷

联系人：徐博

客服热线：400-027-9899

网址: [www.buyfunds.cn](http://www.buyfunds.cn)

37.天津万家财富资产管理有限公司

地址: 北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 5 层

法定代表人: 李修辞

联系人: 邵玉磊

客服热线: 010-59013825

网址: <http://www.wanjiawealth.com/>

38.北京晟视天下投资管理有限公司

地址: 北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

法定代表人: 蒋煜

联系人: 殷雯

客服热线: 400-818-8866

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

39.上海长量基金销售投资顾问有限公司

地址: 上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人: 张跃伟

联系人: 何昶

客服热线: 400-820-2899

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

40.海银基金销售有限公司

地址: 上海市浦东新区银城中路 8 号 4 楼

法定代表人: 刘惠

联系人: 毛林

客服热线: 400-808-1016

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

41.成都华弈恒信财富投资管理有限公司

地址: 中国(四川)自由贸易试验区成都高新区蜀锦路 88 号 1 号楼 32 楼 2

号

法定代表人: 赵壁

联系人: 徐莉

客服热线：400-8010-009

网址：<http://www.huayihengxin.com>

42.北京汇成基金销售有限公司

地址：北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层

法定代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

客服热线：400-619-9059

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

43.喜鹊财富基金销售有限公司

地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室

法定代表人：陈皓

联系人：曹砚财、张萌

客服热线：0891-6177483

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

44.上海挖财基金销售有限公司

地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室

法定代表人：胡燕亮

联系人：李娟

客服热线：021-50810673

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

45.上海华夏财富投资管理有限公司

地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层

法定代表人：毛淮平

联系人：仲秋玥

客服热线：400-817-5666

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

46.西部期货有限公司

地址：陕西省西安市新城东大街319号8幢10000室9层

法定代表人：陈杰

联系人：闫海

客服热线：400-688-6896

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

47.上海基煜基金销售有限公司

地址：上海市昆明路 518 号北美广场 A1002-A1003 室

法定代表人：王翔

联系人：吴鸿飞

客服热线：400-820-5369

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

48.中信期货有限公司

地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

联系人：罗文燕

客服热线：400-990-8826

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

49.大河财富基金销售有限公司

地址：贵州省贵阳市南明区新华路 110-134 号富中国际广场 1 栋 20 层 1.2 号

法定代表人：王荻

联系人：方凯鑫

客服热线：0851-8823-5678

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

50.北京恒天明泽基金销售有限公司

地址：北京市朝阳区东三环北路甲 19 号 SOHO 嘉盛中心 30 层 3001 室

法定代表人：周斌

联系人：陈霞

客服热线：400-8980-618

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

51.北京蛋卷基金销售有限公司

地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

法定代表人：钟斐斐

联系人：戚晓强

客服热线：4000-618-518

网址：<https://danjuanapp.com>

#### 52.沈阳麟龙投资顾问有限公司

地址：辽宁省沈阳市东陵区白塔二南街18-2号b座601

法定代表人：朱荣晖

联系人：庞园

客服热线：400—003—5811

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

#### 53.南京苏宁基金销售有限公司

地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号

法定代表人：钱燕飞

联系人：喻明明

客服热线：95177

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

#### 54.阳光人寿保险股份有限公司

地址：北京市朝阳区朝阳门外大街乙12号院1号昆泰国际大厦12层

法定代表人：李科

联系人：王超

客服热线：95510

网址：<http://fund.sinosig.com/>

#### 55.深圳众禄基金销售有限公司

地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

客服热线：400—6788—887

网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)、[www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

#### 56.上海凯石财富基金销售有限公司

地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人：陈继武

联系人：冯强

客服热线：400-643-3389

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

57. 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层

法定代表人：钱昊旻

联系人：孙雯

客服热线：4008-909-998

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

58. 北京肯特瑞基金销售有限公司

地址：北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部

法定代表人：陈超

联系人：赵德赛

客服热线：95118

网址：<http://fund.jd.com/>

59. 上海天天基金销售有限公司

地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座

法定代表人：其实

联系人：朱钰

客服热线：95021、4001818188

网址：<http://www.1234567.com.cn>

60. 上海联泰资产管理有限公司

地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：燕斌

联系人：兰敏

客服热线：400-166-6788

网址：[www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

61. 民商基金销售(上海)有限公司

地址：上海市浦东新区张杨路 707 号生命人寿大厦 32 楼

法定代表人：贲惠琴

联系人：杨一新

客服热线：021-50206002

网址：www.msftec.com

## 二、登记机构

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 楼

法定代表人：何方

电话：（021）38572888

传真：（021）38572750

联系人：张皞骏

客户服务电话：400-700-7818；（021）38572666

## 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：刘佳

经办律师：廖海、刘佳

## 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层

办公地址：上海市南京西路 1266 号恒隆广场 50 楼

法定代表人：邹俊

联系电话：（021）2212 2888

传真：（021）6288 1889

联系人：黄小熠

经办注册会计师：黄小熠、张楠

## 第四部分 基金的名称

西部利得个股精选股票型证券投资基金

## 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

本基金通过构建有效的投资组合，在严格控制风险的前提下，力求获得长期稳定的收益。

## 第七部分 基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、中期票据、短期融资券、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货、债券回购、银行存款、资产支持证券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（但须符合中国证监会相关规定）。

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。

基金的投资组合比例为：

股票资产占基金资产的 80%-95%。其中，基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易



保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

## 第八部分 基金的投资策略

本基金采取精选个股策略为主，资产配置策略为辅的综合投资策略。本基金将综合考虑主题，成长，价值，趋势几个主要方面，在自上而下的投资主题分析框架下，结合对行业和企业成长性的基本面研究，追求有远见地、准确地把握经济发展和变更中的个股投资机会；既考虑价值被市场低估的个股，也考虑具有潜在高成长性和盈利模式稳健的上市公司。力争甄选具有长期投资价值的个股，实现基金资产的长期稳健持续的收益。

### 1. 资产配置策略

本基金贯彻“自上而下”的资产配置策略，通过对宏观经济周期、国家经济政策、证券市场流动性和大类资产相对收益特征等因素的综合分析，在遵守大类资产投资比例限制的前提下进行积极的资产配置，对基金组合中股票、债券、短期金融工具的配置比例进行调整和优化，平衡投资组合的风险与收益。本基金在进行资产配置时，重点考察宏观经济状况、资金流动性、资产估值水平和市场因素这四个方面。

### 3、债券投资策略

本基金可投资于国债、金融债、企业债和可转换债券（含可交换债券）等债券品种，通过对收益率、流动性、信用风险和风险溢价等因素的综合评估，确定国债、金融债、企业债、短期金融工具等产品的投资比例，构建债券投资组合并不断调整。本基金对国债的投资侧重于利率风险和流动性风险分析，对金融债、企业债的投资侧重于信用风险分析。本基金还将关注可转债价格与其所对应股票价格的相对变化，综合考虑可转债的市场流动性等因素，确定投资可转债的投资品种和投资比例。

### 4、资产支持证券的投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

## 5、股指期货投资策略

在股指期货投资上，本基金以避险保值、管理投资组合的系统性风险、改善投资组合的风险收益特性为主。在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资。

## 第九部分 基金的业绩比较标准

本基金的业绩比较基准：沪深 300 指数收益率\*80%+中证全债指数收益率\*20%。

## 第十部分 基金的风险收益特征

本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，属于证券投资基金中的高风险水平投资品种。

## 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2019年6月30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	5,451,118.86	9.81
	其中：股票	5,451,118.86	9.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-

	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	49,575,113.03	89.19
8	其他资产	558,183.82	1.00
9	合计	55,584,415.71	100.00

## 2. 报告期末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	56,472.00	0.95
B	采矿业	63,740.25	1.07
C	制造业	4,150,027.76	69.51
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	101,079.00	1.69
G	交通运输、仓储和邮政业	270,211.00	4.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,118.16	0.47
J	金融业	426,050.94	7.14
K	房地产业	91,872.00	1.54
L	租赁和商务服务业	240,441.15	4.03
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	23,106.60	0.39
S	综合	-	-
	合计	5,451,118.86	91.31

## 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

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	603288	海天味业	1,938	203,490.00	3.41
2	600519	贵州茅台	200	196,800.00	3.30
3	601888	中国国旅	2,211	196,005.15	3.28
4	600009	上海机场	2,300	192,694.00	3.23
5	002032	苏泊尔	2,509	190,257.47	3.19
6	000333	美的集团	3,522	182,650.92	3.06
7	600436	片仔癀	1,570	180,864.00	3.03
8	603899	晨光文具	4,090	179,837.30	3.01
9	601100	恒立液压	5,100	160,038.00	2.68
10	000858	五粮液	1,300	153,335.00	2.57

#### 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序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序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序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

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(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。

(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) 本期国债期货投资评价

国债期货不在本基金投资范围内。

11. 投资组合报告附注

本基金投资的前十大证券中，除广发证券（000776.SZ）因披露涉嫌违反《证券登记结算管理办法》和《证券公司监督管理条例》于2016年11月25日收到中国证券监督管理委员会公开处罚外，其余证券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。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	50,117.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,269.30
5	应收申购款	496,797.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	558,183.82

(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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

(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
2017年1月23日- 2017年12月31日	15.97%	0.64%	15.57%	0.52%	0.40%	0.12%
2018年1月1日- 2018年12月31日	-23.16%	1.34%	-19.17%	1.07%	-3.99%	-0.27%
2017年1月23日-	-10.88%	1.06%	-6.37%	0.88%	-4.51%	0.18%

2018年 12月31 日						
2019年1 月1日- 2019年6 月30日	30.94%	1.47%	21.91%	1.24%	9.03%	0.23%
2017年1 月23日- 2019年6 月30日	16.69%	1.16%	14.15%	0.97%	2.54%	0.19%

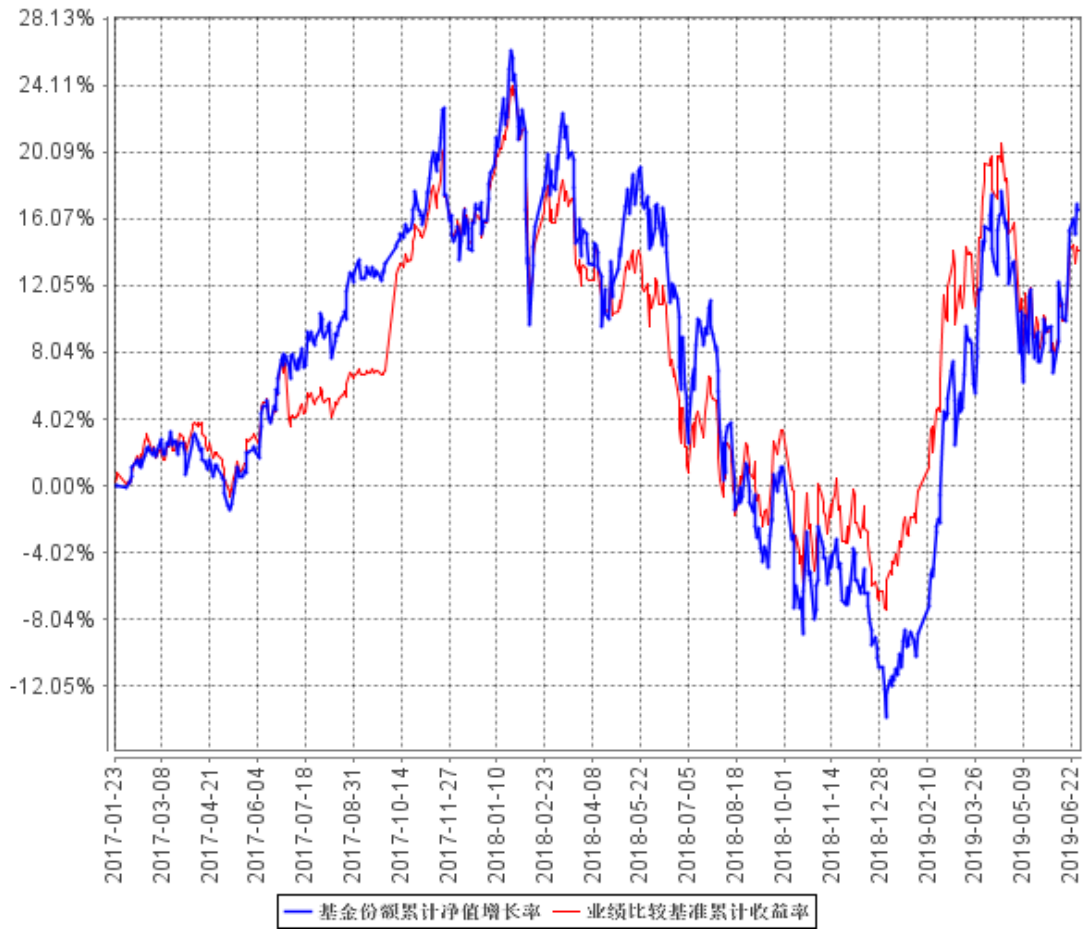
2. 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

西部利得个股精选股票型证券投资基金

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

(2017年1月23日至2019年6月30日)

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 基金费用与税收

### 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》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券/期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、证券/期货账户开户费用、账户维护费用；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第 3—9 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 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；
- 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、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

五、在法律法规规定的范围内，基金管理人和基金托管人可协商并履行适当程序后调整基金管理费、基金托管费等相关费率。基金管理人必须依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介和基金管理人网站上刊登公告。

## 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2019年3月9日公布的《西部利得个股精选股票型证券投资基金基金更新招募说明书（2019年第一期）》进行了更新，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“标题”部分。
2. 根据最新资料，更新了“重要提示”部分。
3. 根据最新资料，更新了“第三部分 基金管理人”部分。
4. 根据最新资料，更新了“第四部分 基金托管人”部分。
5. 根据最新资料，更新了“第五部分 相关服务机构”部分。
6. 根据最新资料，更新了“第十五部分 基金的投资”部分。
7. 根据最新资料，更新了“第二十二部分 风险揭示”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”部分。

西部利得基金管理有限公司

二零一九年九月六日