

西部利得得尊纯债债券型证券投资基金

招募说明书（更新）

（2019年12月）

（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7月29日证监许可【2016】1713号文准予注册。

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、技术风险等，也包括本基金的特定风险等。

本基金为债券型基金，在通常情况下其预期风险和预期收益高于货币市场基金，但低于股票型、混合型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种。

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、基金合同及基金产品资料概要。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。

本招募说明书关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

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 9 月 30 日，投资组合报告为 2019 年二季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为 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 楼

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，董事长，硕士研究生，毕业于上海财经大学经济专业。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，21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

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总经理。

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，21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. 基金经理

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。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、自2017年8月至2019年6月担任西部利得祥盈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的基金经理，自2019年7月西部利得聚利6个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。

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。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 月至 2018 年 11 月担任西部利得得尊纯债债券型证券投资基金的基金经理。

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学专业，获得经济学硕士学位。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，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、机构部副总经理，现任基金经理。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，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 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 12 月起担任西部利得沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理，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，自 2019 年 9 月起担任西部利得祥逸债券型证券投资基金的基金经理。

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，获得经济学硕士学位。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 月起担任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 月起担任西部利得聚享一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理，自 2019 年 7 月起担任西部利得聚利 6 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。

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. 编制季度报告、中期报告和年度报告；

7. 计算并公告基金净值信息，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、岗位职责及操作规程等；

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、基金托管人概况

1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：252.20亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755-83199084

传真：0755-83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

2、发展概况

招商银行成立于 1987 年 4 月 8 日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于 2002 年 3 月成功地发行了 15 亿 A 股，4 月 9 日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006 年 9 月又成功发行了 22 亿 H 股，9 月 22 日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10 月 5 日行使 H 股超额配售，共发行了 24.2 亿 H 股。截至 2019 年 6 月 30 日，本集团总资产 71,931.81 亿元人民币，高级法下资本充足率 15.09%，权重法下资本充足率 12.60%。

2002 年 8 月，招商银行成立基金托管部；2005 年 8 月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，现下设业务管理团队、产品管理团队、项目管理团队、稽核监察团队、基金外包业务团队、养老金团队、系统与数据团队 7 个职能团队，现有员工 83 人。2002 年 11 月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003 年 4 月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、合格境内机构投资者托管（QDII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管、存托凭证试点存托人等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S 托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6 心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，推出国内首个托管大数据平台，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只 FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金 T+1 到账、第一只境外银行 QDII 基金、第一只红利 ETF 基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大

小非解禁资产、第一单 TOT 保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升，四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016年6月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获得该奖项的托管银行；“托管通”获得国内《银行家》2016中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7月荣膺2016年中国资产管理“金贝奖”“最佳资产托管银行”。2017年6月招商银行再度荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”；“全功能网上托管银行2.0”荣获《银行家》2017中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；8月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”。2018年1月招商银行荣膺中央国债登记结算有限责任公司“2017年度优秀资产托管机构”奖项；同月，招商银行托管大数据平台风险管理系统荣获2016-2017年度银监会系统“金点子”方案一等奖，以及中央金融团工委、全国金融青联第五届“双提升”金点子方案二等奖；3月荣膺公募基金20年“最佳基金托管银行”奖；5月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”；12月荣膺2018东方财富风云榜“2018年度最佳托管银行”、“20年最值得信赖托管银行”奖。2019年3月招商银行荣获《中国基金报》“2018年度最佳基金托管银行”奖；6月荣获《财资》“中国最佳托管机构”“中国最佳养老金托管机构”“中国最佳零售基金行政外包”三项大奖。

二、主要人员情况

李建红先生，本行董事长、非执行董事，2014年7月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士，高级经济师。招商局集团有限公司董事长，兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生，本行行长、执行董事，2013年5月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于2003年7月至

2013年5月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

汪建中先生，本行副行长。1991年加入本行；2002年10月至2013年12月历任本行长沙分行行长，总行公司银行部副总经理，佛山分行筹备组组长，佛山分行行长，武汉分行行长；2013年12月至2016年10月任本行业务总监兼公司金融总部总裁，期间先后兼任公司金融综合管理部总经理、战略客户部总经理；2016年10月至2017年4月任本行业务总监兼北京分行行长；2017年4月起任本行党委委员兼北京分行行长。2019年4月起任本行副行长。

姜然女士，招商银行资产托管部总经理，大学本科毕业，具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行，华商银行，中国农业银行深圳市分行，从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今，历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一，具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

三、基金托管业务经营情况

截至2019年6月30日，招商银行股份有限公司累计托管479只证券投资基金。

四、托管人的内部控制制度

1、 内部控制目标

招商银行确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管制度，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念；形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制，防范和化解经营风险，确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全；建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患，保证业务稳健运行的风险控制制度，确保托管业务信息真实、准确、完整、及时；确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

2、 内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内控风险防范体系：

一级风险防范是在招商银行总行风险管控层面对风险进行预防和控制；

二级风险防范是招商银行资产托管部设立稽核监察团队，负责部门内部风险预防和控制；

三级风险防范是招商银行资产托管部在设置专业岗位时，遵循内控制衡原则，视业务的风险程度制定相应监督制衡机制。

3、 内部控制原则

（1）全面性原则。内部控制覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有团队和岗位。

（2）审慎性原则。托管组织体系的构成、内部管理制度的建立均以防范风险、审慎经营为出发点，以有效防范各种风险作为内部控制的核心，体现“内控优先”的要求。

（3）独立性原则。招商银行资产托管部各团队、各岗位职责保持相对独立，不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间相互分离。内部控制的检查、评价部门独立于内部控制的建立和执行部门。

（4）有效性原则。内部控制具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权利，内部控制存在的问题能够得到及时的反馈和纠正。

（5）适应性原则。内部控制适应招商银行托管业务风险管理的需要，并能够随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行修订和完善。

（6）防火墙原则。招商银行资产托管部配备独立的托管业务技术系统，包括网络系统、应用系统、安全防护系统、数据备份系统。

（7）重要性原则。内部控制在实现全面控制的基础上，关注重要托管业务事项和高风险领域。

（8）制衡性原则。内部控制能够实现在托管组织体系、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率。

4、 内部控制措施

（1）完善的制度建设。招商银行资产托管部从资产托管业务内控管理、产品受理、会计核算、资金清算、岗位管理、档案管理和信息管理等方面制定一系列规章制度，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。

(2) 经营风险控制。招商银行资产托管部制定托管项目审批、资金清算与会计核算双人双岗、大额资金专人跟踪、凭证管理等一系列完整的操作规程，有效地控制业务运作过程中的风险。

(3) 业务信息风险控制。招商银行资产托管部在数据传输和保存方面有严格的加密和备份措施，采用加密、直连方式传输数据，数据执行异地实时备份，所有的业务信息须经过严格的授权方能进行访问。

(4) 客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务办理过程中形成的客户资料，视同会计资料保管。客户资料不得泄露，有关人员如需调用，须经总经理室成员审批，并做好调用登记。

(5) 信息技术系统风险控制。招商银行对信息技术系统管理实行双人双岗双责、机房 24 小时值班并设置门禁管理、电脑密码设置及权限管理、业务网和办公网、托管业务网与全行业务网双分离制度，与外部业务机构实行防火墙保护，对信息技术系统采取两地三中心的应急备份管理措施等，保证信息技术系统的安全。

(6) 人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激励机制、加强人力资源管理及建立人才梯队队伍及人才储备机制，有效的进行人力资源管理。

五、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

根据《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》等有关法律法规的规定及基金合同、托管协议的约定，对基金投资范围、投资比例、投资组合等情况的合法性、合规性进行监督和核查。

在为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，基金托管人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支付情况进行检查监督，对违反法律法规、基金合同的指令拒绝执行，并立即通知基金管理人。

基金托管人如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，及时以书面形式通知基金管理人进行整改，整改的时限应符合法律法规及基金合同允许的调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。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。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额销售机构

(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

联系电话: 021-38572888

网址: 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: 徐朝晖

联系人: 梁承华

客服热线: 95582

网址: 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

3. 招商银行股份有限公司

地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：李建红

联系人：黄国航

客服热线：95555

网址：www.cmbchina.com

4. 平安银行股份有限公司

地址：广东省深圳市罗湖区深南东路5047号

法定代表人：谢永林

联系人：鲁承文

客服热线：95511-3

网址：<http://bank.pingan.com/>

5. 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：周一涵

客服热线：95511-8

网址：stock.pingan.com

6. 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

7. 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

8. 广发证券股份有限公司

地址：广州市天河北路183号大都会广场43楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

客服热线：95575

网址：www.gf.com.cn

9. 联储证券有限责任公司

地址：广东省深圳市福田区华强北路圣廷苑酒店B座26楼

法定代表人：沙常明

联系人：丁倩云

客服热线：4006206868

网址：www.lczq.com

10. 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、

11. 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

12. 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

13. 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：姜昧军

联系人：王雯

客服热线：4008-323-000

网址：<http://www.csc.com.cn/>

14. 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/>

15. 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

16. 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

17. 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

18. 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：宫少林

联系人：黄婵君

客服热线：95565、4008888111

网址：www.newone.com.cn

19. 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

20. 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

21. 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>

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

23. 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

24. 中国中金财富证券有限公司

地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第4、18层至21层

法定代表人：高涛

联系人：张丹桥

客服热线：95532/4006008008

网址：<http://www.china-invs.cn/>

25. 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

26. 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

27. 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

28. 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

29. 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

30. 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>

31. 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/>

32. 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

33. 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

34. 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.snjijin.com

35. 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

36. 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/>

37. 奕丰基金销售有限公司

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

38. 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

39. 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公园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>

40. 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

41. 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

42. 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/>

43. 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

44. 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

45. 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11层1108号

法定代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

客服热线：400-619-9059

网址：www.fundzone.cn

46. 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

47. 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

48. 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

49. 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

50. 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>

51. 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>

52. 阳光人寿保险股份有限公司

地址：北京市朝阳区朝外大街20号联合大厦701A室

法定代表人：李科

联系人：王超

客服热线：95510

网址：<http://fund.sinosig.com/>

53. 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

54. 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、www.jjmmw.com

55. 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

56. 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

57. 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

58. 浦领基金销售有限公司

地址：北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室

法定代表人：聂婉君

联系人：徐微

客服热线：400-012-5899

网址：<http://www.zscffund.com/>

59. 江苏汇林保大基金销售有限公司

地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道47号

法定代表人：吴言林

联系人：孙平

客服热线：025-66046166

网址：www.huilinbd.com

60. 诺亚正行基金销售有限公司

地址：上海市杨浦区长阳路1687号2号楼

法定代表人：汪静波

联系人：李娟

客服热线：400-821-5399

网址：www.noah-fund.com

61. 华瑞保险销售有限公司

地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路399号运通星财富广场1号楼B座13、14层

法定代表人：路昊

联系人：张爽爽

客服热线：952303

网址：<https://www.huaruisales.com/>

62. 和耕传承基金销售有限公司

地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北6号楼5楼503

法定代表人：王旋

联系人：董亚芳

客服热线：400-0555-671

网址：www.hgccpb.com

63. 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：何昞

客服热线：400-820-2899

网址：www.erichfund.com

64. 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

65. 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/>

（三）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，并在基金管理人网站公示。

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

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

西部利得得尊纯债债券型证券投资基金

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

在控制风险和保持资产流动性的前提下，对固定收益类资产进行投资，优化资产结构，在有效控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。

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固定收益类金融工具，包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、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、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据、资产支持证券、公开发行次级债券、中小企业私募债券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具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。本基金不直接购买股票、权证，但可持有因可转换债券转股所形成的股票和因投资分离交易可转债所形成的权证。因上述原因持有的股票和权证等资产，基金将在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，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：

本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；对中小企业私募债券的投资比例不高于基金资产的 20%；现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

第八部分 基金的投资策略

1、资产配置策略

本基金在充分研究债券市场宏观环境和仔细分析利率走势基础上，通过久期管理、期限结构配置、类属资产配置、个券选择等策略依次完成组合构建。

2、债券投资策略

债券投资组合的回报主要来自于组合的久期管理，识别收益率曲线中价值低估的部分以及各类债券中价值低估的种类。在投资过程中，以中长期利率趋势分析为主，结合经济周期、宏观经济运行中的价格指数、资金供求分析、货币政策、

财政政策研判及收益率曲线分析，在保证流动性和风险可控的前提下，实施积极的债券投资组合管理。

（1）债券久期管理

本基金将分析中长期利率趋势，结合经济周期、宏观经济运行中的价格指数、资金供求分析、货币政策、财政政策研判密切跟踪 CPI、PPI、M2、M1、汇率等利率敏感指标，对未来中国债券市场利率走势进行分析与判断，并由此确定合理的债券组合久期。

（2）期限结构配置

本基金在确定组合目标久期后，分析债券市场收益率期限结构，基于收益率曲线变化对各期限段债券风险收益特征进行评估，将预期收益率与波动率匹配度最高的期限段进行配比，构建风险收益特征最优的债券组合。

（3）类属资产配置策略

不同类型的债券在收益率、流动性和信用风险上存在差异，本基金将债券资产配置于不同类型的债券品种以及在不同市场间进行配置，以寻求收益性、流动性和信用风险补偿间的最佳平衡点。

在综合信用分析、流动性分析、税收及市场结构等因素分析的基础上，本基金根据对金融债、企业债等债券品种与同期限国债之间收益率利差的扩大和收窄的预期，主动地增加预期利差将收窄的债券类属品种的投资比例，降低预期利差将扩大的债券类属品种的投资比例，获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

（4）个券选择策略

在以上债券资产久期、期限和类属配置的基础上，本基金根据债券市场收益率数据，运用利率模型对单个债券进行估值分析，并结合债券的信用评级、流动性、息票率、税赋、提前偿还和赎回等因素，选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。为控制基金债券投资的信用风险，本基金投资的企业债券需经国内评估机构进行信用评估，要求其信用评级为投资级以上。如果债券获得主管机构的豁免评级，本基金根据对债券发行人的内部信用风险分析，决定是否将该债券纳入基金的投资范围。

（5）中小企业私募债投资策略

在中小企业私募债个券分析选择上，本基金综合考量发行主体所处行业发展前景、公司成长速度、市场竞争力等综合因素，以及运用利率走势预期、信用利差走势、担保价值评估、隐含期权价值评估等方法来评估个券的投资价值。在合理估值模型下，选择资信状况良好且能获得较高风险—收益补偿的中小企业私募债券进行投资。

基金投资中小企业私募债券，基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

（6）可转换债券投资策略

本基金管理人将认真考量可转换债券的股权价值、债券价值以及其转换期权价值，将选择具有较高投资价值的可转换债券。

针对可转换债券的发行主体，本基金管理人将考量所处行业景气程度、公司成长性、市场竞争力等因素，参考同类公司估值水平评价其股权投资价值；重点关注公司基本面良好、具备良好的成长空间与潜力、转股溢价率和投资溢价率合理并有一定下行保护的可转债。

3、回购放大策略

本基金在基础组合基础上，使用基础组合持有的债券进行回购放大融资买入收益率高于回购成本的债券，获得杠杆放大收益。

对于因投资分离交易可转债所形成的权证，在权证上市后，本基金将根据权证估值模型的分析结果，在权证价值高估时，选择适当的时机卖出。

4、资产支持证券投资策略

本基金将综合运用定性方法和定量方法，基本面分析和数量化模型相结合，对资产证券化产品的基础资产质量及未来现金流进行分析，并结合发行条款、提前偿还率、风险补偿收益等个券因素以及市场利率、流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析和价值评估后进行投资。本基金将严格遵守法律法规和基金合同的约定，严格控制资产支持证券的投资比例、信用等级并密切跟踪评级变化，采用分散投资方式以降低流动性风险，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。

第九部分 基金的业绩比较标准

本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率。

第十部分 基金的风险收益特征

本基金属债券型证券投资基金，为证券投资基金中的较低风险品种。本基金长期平均的风险和预期收益低于混合型基金和股票型基金，高于货币市场基金。

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。

基金托管人招商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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	279,723,860.00	97.51
	其中：债券	279,723,860.00	97.51
	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	2,114,746.00	0.74
8	其他资产	5,028,762.89	1.75
9	合计	286,867,368.89	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

股票不在本基金投资范围内。

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

股票不在本基金投资范围内。

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,629,200.00	8.58
	其中：政策性金融债	20,629,200.00	8.58
4	企业债券	53,879,760.00	22.40
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	205,214,900.00	85.30
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	279,723,860.00	116.28

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	101900795	19 闽投 MTN003	150,000	15,114,000.00	6.28
2	101900745	19 福新能源 MTN001	150,000	15,055,500.00	6.26
3	155927	19 远发 Y6	150,000	15,039,000.00	6.25
4	108602	国开 1704	140,000	14,141,400.00	5.88
5	101900767	19 中建二局 MTN001	120,000	12,008,400.00	4.99

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

(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。

(2) 股票不在本基金投资范围内，不存在基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	9,062.71
2	应收证券清算款	493,515.89
3	应收股利	-
4	应收利息	4,494,771.99
5	应收申购款	31,412.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,028,762.89

(4) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

股票不在本基金投资范围内。

(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。

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3月1日-2017年	2.70%	0.07%	-2.53%	0.06%	5.23%	0.01%

12月31日						
2018年1月1日 -2018年12月31日	3.73%	0.04%	4.79%	0.07%	-1.06%	-0.03%
2019年1月1日 -2019年6月30日	3.84%	0.07%	0.24%	0.06%	3.60%	0.01%
2017年3月1日 -2019年6月30日	10.62%	0.06%	2.37%	0.06%	8.25%	0.00%

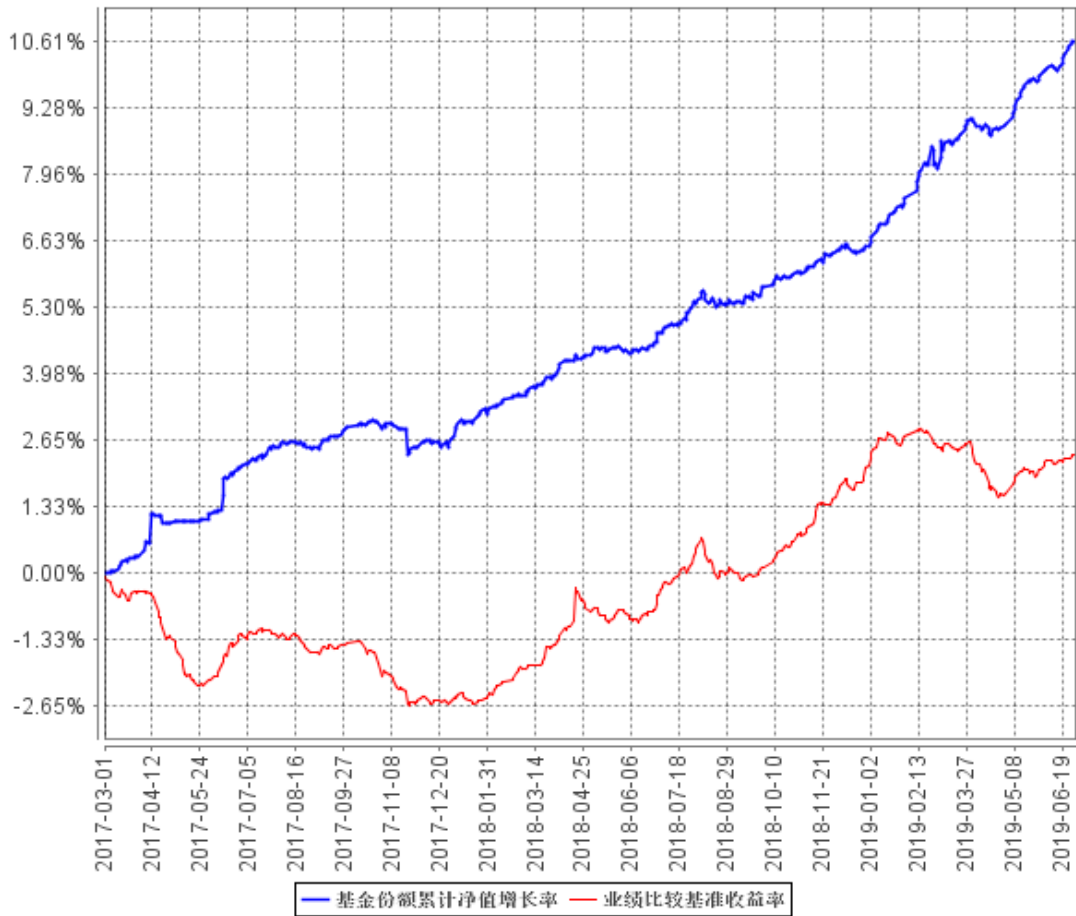
2. 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

西部利得得尊纯债债券型证券投资基金

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3月1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、C类基金份额的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的账户开户费用、账户维护费用；
- 10、货币经纪服务费（若有）；
- 11、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 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 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。

3、C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.25% 年费率计提。C 类基金份额的销售服务费计算方法如下：

$$H=E\times 0.25\%\div\text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取并付给基金管理人，由基金管理人代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

上述“一、基金费用的种类”中第 4—11 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项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

五、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致，待履行相关程序后可降低基金管理费和基金托管费。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 个工作日前予以刊登公告。

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》、《公开募集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9月20日公布的《西部利得得尊纯债债券型证券投资基金基金招募说明书（更新）（2019年第2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“第一部分 绪言”部分。
4. 根据最新资料，更新了“第二部分 释义”部分。
5. 根据最新资料，更新了“第三部分 基金管理人”部分。
6. 根据最新资料，更新了“第四部分 基金托管人”部分。
7. 根据最新资料，更新了“第五部分 相关服务机构”部分。
8. 根据最新资料，更新了“第八部分 基金份额的申购与赎回”部分。
9. 根据最新资料，更新了“第十二部分 基金的投资”部分。
10. 根据最新资料，更新了“第十五部分 基金的收益与分配”部分。
11. 根据最新资料，更新了“第十七部分 基金的会计与审计”部分。
12. 根据最新资料，更新了“第十八部分 基金的信息披露”部分。
13. 根据最新资料，更新了“第二十一部分 基金合同摘要”部分。
14. 根据最新资料，更新了“第二十二部分 托管协议摘要”部分。
15. 根据最新公告，更新了“第二十四部分 其他应披露事项”部分。

西部利得基金管理有限公司

二〇一九年十二月