西部利得得尊纯债债券型证券投资基金招募说明书(更新)(摘要)

（2017年第1期）

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2017年9月1日,投资组合报告为2017年二季度报告,有关财务数据和净值表现截止日为2017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:徐剑钧
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

徐剑钧先生:董事长

徐剑钧先生,董事长,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,22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起任西部证券股份有限公司副总经理。历任公司督察长,2016年9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,19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。

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,获经济管理学博士学位。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,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

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。现任利得科技有限公司副总裁。

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,代为履行西部证券总经理职务。

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。

张喆先生:监事

张喆先生,监事。毕业于浙江大学检测技术及仪器专业,获工学学士学位。曾就职于中兵勘察研究院、北京证券有限公司、中国证券业协会、中证机构间报价系统股份有限公司、中国证券投资基金业协会等机构,长期从事信息技术领域的工作。现任公司首席信息官、总经理助理。

3、公司高级管理人员

徐剑钧先生:董事长

徐剑钧先生,董事长,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,22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起任西部证券股份有限公司副总经理。历任公司督察长,2016年9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,19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。

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,21年证券从业经历。1988年起任北京大学社会科学处职员。1993年起任北京市波姆红外技术公司总经理助理。1996年起任华夏证券有限责任公司高级投资经理。2007年起在华夏基金管理有限公司工作,历任股票分析师、风险管理部总经理助理。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

张维文先生,基金经理,硕士研究生,毕业于上海财经大学金融学专业,获经济学硕士学位。9年证券从业年限。曾任交银施罗德基金公司信用分析师、国民信托有限公司固定收益研究员。2013年11月加入西部利得基金管理有限公司,曾任固定收益高级研究员。自2016年9月起担任西部利得天添富货币市场基金,自2016年11月起担任西部利得合赢债券型证券投资基金、西部利得祥盈债券型证券投资基金的基金经理,自2017年2月起担任西部利得汇逸债券型证券投资基金的基金经理,自2017年3月起担任西部利得得尊纯债债券型证券投资基金、西部利得祥逸债券型证券投资基金的基金经理,自2017年6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,自2017年8月起担任西部利得新润灵活配置混合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,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。11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,自2017年3月起担任西部利得天添富货币市场基金的基金经理,自2017年4月起担任西部利得汇享债券型证券投资基金的基金经理。

投资决策委员会副主任委员,刘荟女士,公募投资部副总经理,硕士毕业于辽宁大学应用数学专业。9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,现任公募投资部副总经理。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月起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1月起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。

投资决策委员会委员,周平先生,总经理助理兼机构三部总经理兼联席投资总监,硕士毕业于复旦大学国际政治专业。11年证券从业年限。曾任普华永道中天会计师事务所审计师、中信资本资产管理有限公司分析师、国联安基金管理有限公司研究员/基金经理。2015年6月加入本公司,现任总经理助理兼机构三部总经理兼联席投资总监。

投资决策委员会委员,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。12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,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8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2016年9月起担任西部利得合赢债券型证券投资基金的基金经理,自2016年12月起担任西部利得天添金货币市场基金、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月起担任西部利得汇逸债券型证券投资基金、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3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。

投资决策委员会委员,陈保国先生,研究部副总经理,硕士毕业于上海理工大学系统理论专业,获理学硕士学位。7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,现任研究部副总经理。

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。4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。

投资决策委员会委员,刘心峰先生,基金经理,硕士毕业于英国曼彻斯特大学数量金融专业。4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,曾任基金经理助理。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。

投资决策委员会委员,冷文鹏先生,基金经理,硕士毕业于中国人民银行研究生部金融学专业。12年证券从业年限。曾任中国经济技术投资担保有限公司产品经理、华夏基金管理有限公司高级经理、新华基金管理有限公司研究员、华泰柏瑞基金管理有限公司高级研究员。2016年4月加入本公司,自2016年6月起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,自2017年2月起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4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。

投资决策委员会委员,朱朝华先生,基金经理,硕士毕业于法国高等商业管理学院工商管理硕士专业。12年证券从业年限。曾任广东省高速公路公司项目经理助理、百德能证券有限公司上海代表处研究员、荷兰银行港汇支行理财经理、安信资产管理有限公司研究分析经理、上海日升昌行股权投资基金管理有限公司研究副总监、前海投资控股有限公司投资经理、北大方正人寿保险有限公司投资经理。2016年8月加入本公司,自2016年9月起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。

投资决策委员会委员,严志勇先生,基金经理,硕士毕业于复旦大学数量经济学专业。6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,自2017年8月起担任西部利得汇享债券型证券投资基金、西部利得祥盈债券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)内部控制的制度体系

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、监督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

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2017年6月30日,本集团总资产61,996.90亿元人民币,高级法下资本充足率14.59%,权重法下资本充足率11.85%。

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,下设业务管理室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务室5个职能处室,现有员工74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)、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

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,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”,成为国内唯一获奖项国内托管银行;“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”。

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。

王良先生,本行副行长,货币银行学硕士,高级经济师。1991年至1995年,在中国科技国际信托投资公司工作;1995年6月至2001年10月,历任招商银行北京分行展览路支行、东三环支行行长助理、副行长、行长、北京分行风险控制部总经理;2001年10月至2006年3月,历任北京分行行长助理、副行长;2006年3月至2008年6月,任北京分行党委书记、副行长(主持工作);2008年6月至2012年6月,任北京分行行长、党委书记;2012年6月至2013年11月,任招商银行总行行长助理兼北京分行行长、党委书记;2013年11月至2014年12月,任招商银行总行行长助理;2015年1月起担任本行副行长;2016年11月起兼任本行董事会秘书。

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2017年6月30日,招商银行股份有限公司累计托管301只开放式基金。

四、托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则,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完整;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:

一级风险防范是在总行层面对风险进行预防和控制。

二级防范是总行资产托管部设立稽核监察室,负责部门内部风险预防和控制。稽核监察室在总经理室直接领导下,独立于部门内其他业务室和托管分部、分行资产托管业务主管部门,对各岗位、各业务室、各分部、各项业务中的风险控制情况实施监督,及时发现内部控制缺陷,提出整改方案,跟踪整改情况。

三级风险防范是总行资产托管部在专业岗位设置时,必须遵循内控制衡原则,监督制衡的形式和方式视业务的风险程度决定。

3、内部控制原则

(1)全面性原则。内部控制应覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有室和岗位,并由全部人员参与。

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

(3)独立性原则。各室、各岗位职责应当保持相对独立,不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间应当分离。内部控制的检查、评价部门应当独立于内部控制的建立和执行部门,稽核监察室应保持高度的独立性和权威性,负责对部门内部控制工作进行评价和检查。

(4)有效性原则。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利,内部控制存在的问题应当能够得到及时的反馈和纠正。

(5)适应性原则。内部控制应适应我行托管业务风险管理的需要,并能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。内部控制应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相应的修订和完善。

(6)防火墙原则。业务营运、稽核监察等相关室,应当在制度上和人员上适当分离,办公网和业务网分离,部门业务网和全行业务网分离,以达到风险防范的目的。

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

(8)制衡性原则。内部控制应当在托管组织体系、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。

(9)成本效益原则。内部控制应当权衡托管业务的实施成本与预期效益,以适当的成本实现有效控制。

4、内部控制措施

(1)完善的制度建设。招商银行资产托管部制定了《招商银行证券投资基金托管业务管理办法》、《招商银行资产托管业务内控管理办法》、《招商银行基金托管业务操作规程》和等一系列规章制度,从资产托管业务操作流程、会计核算、岗位管理、档案管理、保密管理和信息管理等方面,保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。为保障托管资产安全和托管业务正常运作,切实维护托管业务各当事人的利益,避免托管业务危机事件发生或确保危机事件发生后能够及时、准确、有效地处理,招商银行还制定了《招商银行托管业务危机事件应急处理办法》,并建立了灾难备份中心,各种业务数据能及时在灾难备份中心进行备份,确保灾难发生时,托管业务能迅速恢复和不间断运行。

(2)经营风险控制。招商银行资产托管部托管项目审批、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、差错处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采用加密方式传输数据。数据执行异地同步灾备,同时,每日实时对托管业务数据库进行备份,托管业务数据每日进行备份,所有的业务信息须经过严格的授权才能进行访问。

(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、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级队伍及人才储备机制,有效的进行人力资源控制。

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》等有关证券法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资范围、投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金管理人参与银行间债券市场、基金管理人选择存款银行、基金资产净值计算、基金份额净值计算、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人对上述事项的监督与核查中发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述监督内容的约定和其他有关法律法规的规定,应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规允许的投资比例调整期限。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。在规定时间内,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的投资指令违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定,应当拒绝执行,立即通知基金管理人限期改正,如基金管理人未能在通知期限内纠正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金管理人有义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示,基金管理人应在规定时间内答复并改正,或就基金托管人的疑义进行解释或举证;对基金托管人按照法律法规、基金合同和托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,应及时报告中国证监会,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。基金管理人无正当理由,拒绝、阻挠对方根据托管协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督,情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的,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

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楼
法定代表人:徐剑钧
联系人:陈眉媚
联系电话:021-38572888
网址:www.westleadfund.com

2.代销机构:

1.西部证券股份有限公司
公司地址:西安市新城区东新街232号陕西信托大厦
法定代表人:刘建武
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
公司地址:上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼14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.上海陆金所资产管理有限公司
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

4.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

5.北京钱景财富投资管理有限公司
公司地址:北京市海淀区中关村丹棱SOHO10楼
法定代表人:赵荣春
联系人:陈剑炜
客服热线:400-893-6885
网址:www.qianjing.com

6.浙江同花顺基金销售有限公司
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

7.平安证券股份有限公司
公司地址:深圳市福田中心区金田路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

8.上海长量基金销售投资顾问有限公司
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:何昳
客服热线:400-820-2899
网址:www.erichfund.com

9.东海证券股份有限公司
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
客服电话:95531;400-8888-588
网址:www.longone.com.cn

10.上海华信证券有限责任公司
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

11.中泰证券股份有限公司
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

12.大泰金石基金销售有限公司
地址:南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室
法定代表人:袁顾明
联系人:朱海涛
客服热线:4009282266
网址:www.dtfunds.com

13.上海联泰资产管理有限公司
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

14.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
客服电话:4001661188
网址:http://www.new-rand.cn/

15.奕丰金融服务(深圳)有限公司
地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入住深圳市前海商务秘书有限公司)
法定代表人:TAN YIK KUAN
联系人:叶健
客服电话:400-684-0500
网址:www.ifastps.com.cn

16.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

17.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:王诗玙
客服热线:400-700-9665
网址:www.ehowbuy.com

18.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

19.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

20.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

21.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/

22.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

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、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:徐剑钧
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2017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	50,435,500.00	83.67
	其中:债券	50,435,500.00	83.67
	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	9,445,639.51	15.67
8	其他资产	401,023.36	0.67
9	合计	60,282,162.87	100

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	19,916,000.00	33.08
	其中:政策性金融债	19,916,000.00	33.08
4	企业债券	965,500.00	1.60
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	29,554,000.00	49.09
9	其他	–	–
10	合计	50,435,500.00	83.77

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)
1	018005	国开1701	200,000
2	111719147	17恒丰银行CD147	100,000
3	111797656	17宁波银行CD092	100,000
4	111714148	17江苏银行CD148	100,000
5	112423	16株国投	10,000

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	4,987.73
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	393,037.13
5	应收申购款	2,998.50
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	401,023.36

(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

股票不在本基金投资范围内。

(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

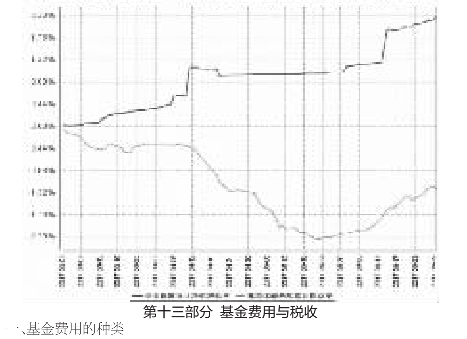
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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3月1日–2017年6月30日	2.16%	0.08%	–1.25%	0.07%	3.41%	0.01%

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2017年6月30日)



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、诉讼费和仲裁费;
5、基金份额持有人大会费用;
6、基金的证券交易费用;
7、基金的银行汇划费用;
8、基金的账户开户费用、账户维护费用;
9、货币经纪服务费(若有);
10、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:

$H=E\times 0.50\%\div$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:

$H=E\times 0.20\%\div$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。

上述“一、基金费用的种类”中第3—10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、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》、《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2017年3月1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》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“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”。
3.根据最新资料,更新了“第四部分 基金托管人”。
4.根据最新资料,更新了“第五部分 相关服务机构”。
5.根据最新资料,更新了“第六部分 基金的募集”。
6.根据最新资料,更新了“第七部分 基金合同的生效”。
7.根据最新资料,更新了“第八部分 基金份额的申购与赎回”。
8.根据最新资料,更新了“第十部分 基金的非交易过户与转托管”。
9.根据最新资料,更新了“第十一部分 基金份额的冻结、解冻”。
10.根据最新资料,更新了“第十二部分 基金的托管”。
11.根据最新资料,更新了“第十三部分 基金的销售”。
12.根据最新资料,更新了“第十四部分 基金份额的注册登记”。
13.根据最新资料,更新了“第十五部分 基金的投资”。
14.根据最新资料,更新了“第二十六部分 对基金份额持有人的服务”。
15.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
二零一七年十月十三日