

西部利得天添鑫货币市场基金 2017 年半年度报告 摘要

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：西部利得基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：二〇一七年八月二十九日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	西部利得天添鑫货币	
场内简称	-	
基金主代码	675031	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 6 月 23 日	
基金管理人	西部利得基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	272,407,246.28 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	-	
上市日期	-	
下属分级基金的基金简称:	西部利得天添鑫货币 A	西部利得天添鑫货币 B
下属分级基金场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	675031	675032
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	5,304,083.46 份	267,103,162.82 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在力求基金资产安全性和高流动性的基础上，为投资者提供资金的流动性储备，并追求高于业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	<p>本基金主要为投资人提供现金管理工具，通过积极的投资组合管理，同时充分把握市场短期失衡带来的套利机会，在安全性、流动性和收益性之间寻求最佳平衡点。</p> <p>1、收益率曲线分析策略 货币市场收益率曲线的形状反映当时短期利率水平之间的关系，反映市场对较短期限经济状况的判断及对未来短期经济走势的预期。本基金管理人将通过分析货币市场收益率曲线，适时调整基金的短期投资策略。当预期收益率曲线将变陡峭时，将买入期限相对较短并卖出期限相对较长的货币资产；当预期收益率曲线将变平坦时，则买入期限相对较长并卖出期限相对较短的货币资产。</p> <p>2、久期配置策略 久期是债券价格相对于利率水平正常变动的敏感度。通过对宏观经济的前瞻性研究，预期未来市场利率的变化趋势，可以有效地确定投资组合的最佳平均剩余期限。如果预测未来利率将上升，则可以缩短组合平均剩余期限的办法规避利率风险；如果预测未来利率下降，则延长组合平均剩余期</p>

下属分级基金的风险收益特征	-	-
---------------	---	---

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		西部利得基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵毅	张志永
	联系电话	021-38572888	021-62677777-212004
	电子邮箱	service@westleadfund.com	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		4007-007-818;021-38572666	95561
传真		021-38572750	021-62159217

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.westleadfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人处——上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 11 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	西部利得天添鑫货币 A	西部利得天添鑫货币 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	179,594.66	9,560,984.04
本期利润	179,594.66	9,560,984.04
本期净值收益率	1.5536%	1.6755%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
期末基金资产净值	5,304,083.46	267,103,162.82
期末基金份额净值	1	1

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

西部利得天添鑫货币 A

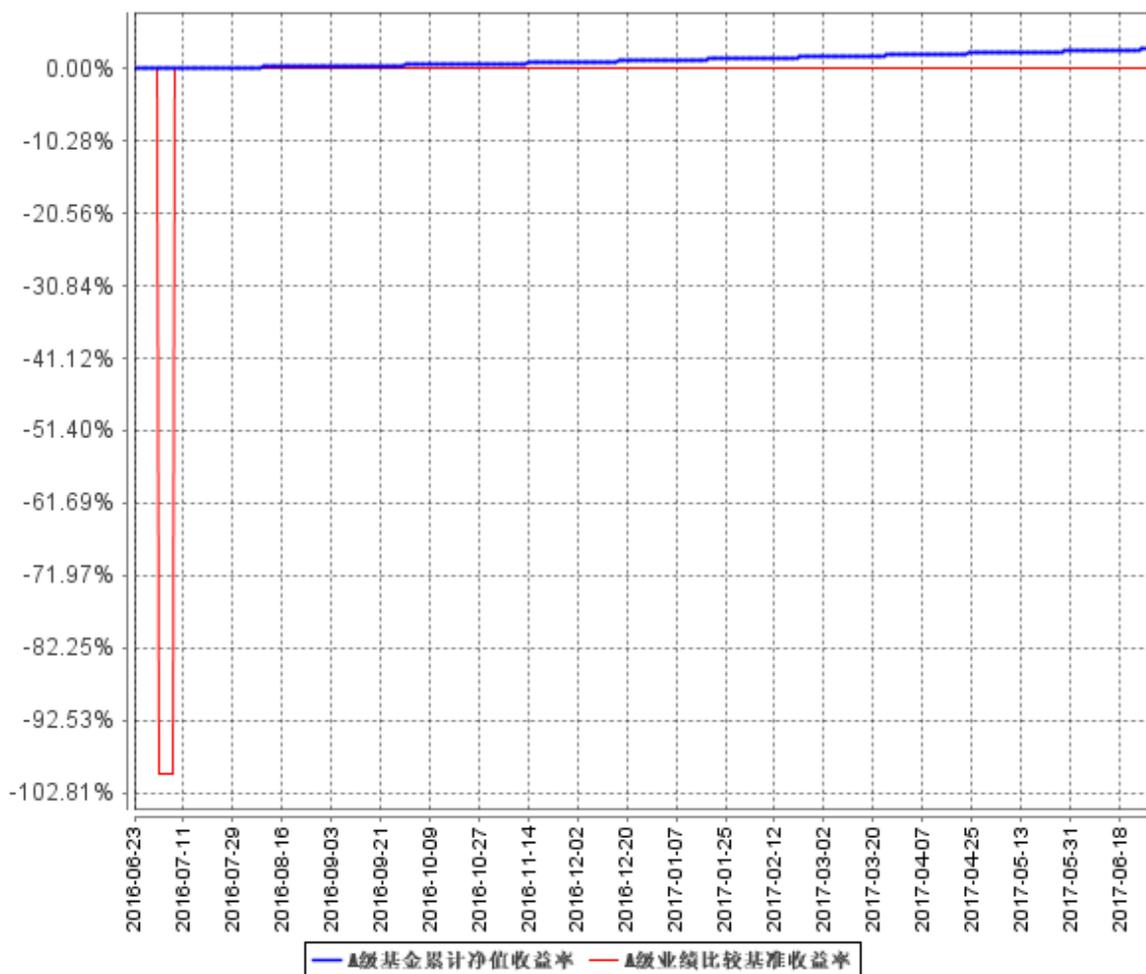
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2857%	0.0010%	0.0288%	0.0000%	0.2569%	0.0010%
过去三个月	0.7952%	0.0018%	0.0874%	0.0000%	0.7078%	0.0018%
过去六个月	1.5536%	0.0020%	0.1728%	0.0001%	1.3808%	0.0019%
过去一年	2.7607%	0.0048%	0.1728%	7.4126%	2.5879%	-7.4078%
自基金合同 生效起至今	2.8112%	0.0048%	0.1737%	7.3324%	2.6375%	-7.3276%

西部利得天添鑫货币 B

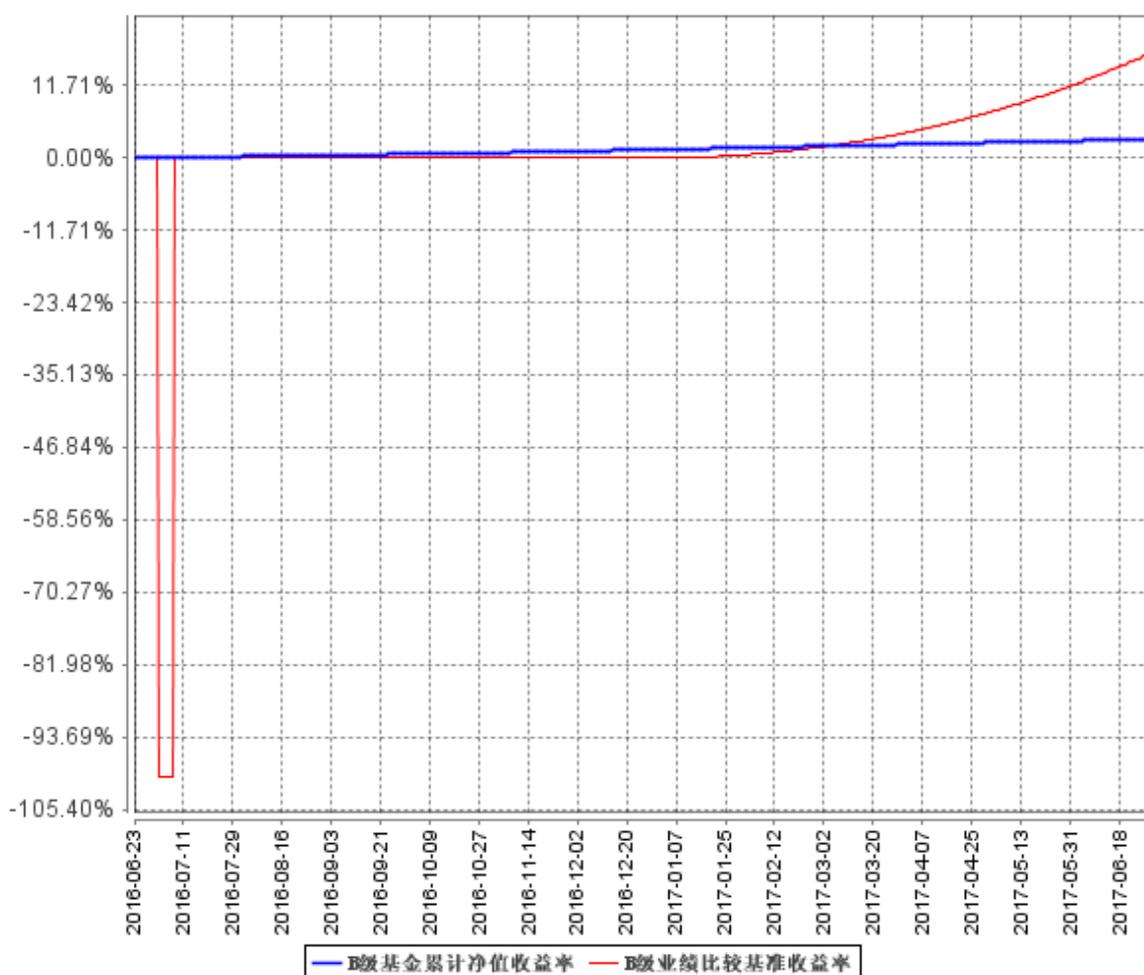
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3058%	0.0010%	5.4770%	0.0122%	-5.1712%	-0.0112%
过去三个月	0.8562%	0.0018%	13.1048%	0.0328%	-12.2486%	-0.0310%
过去六个月	1.6755%	0.0020%	17.1087%	0.0580%	-15.4332%	-0.0560%
过去一年	3.0112%	0.0048%	17.1087%	7.4128%	-14.0975%	-7.4080%
自基金合同 生效起至今	3.0666%	0.0048%	17.1096%	7.3327%	-14.0430%	-7.3279%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

西部利得基金管理有限公司（简称“西部利得基金”，下同）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2010]864号）批准成立于2010年7月20日，公司由西部证券股份有限公司和上海利得财富资产管理有限公司合资设立，注册资本3.5亿元人民币，其中西部证券股份有限公司出资51%，上海利得财富资产管理有限公司出资49%，注册地上海。

截至2017年6月30日，本基金管理人共管理二十四只开放式基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从业年	说明
----	----	-----------------	-------	----

		任职日期	离任日期	限	
张维文	本基金基金经理	2016 年 6 月 23 日	-	八年	上海财经大学金融学硕士；曾任交银施罗德基金管理有限公司信用分析师、国民信托有限公司研究部固定收益研究员。2013 年 11 月加入本公司，具有基金从业资格，中国国籍。
刘心峰	本基金基金经理助理	2017 年 2 月 17 日	-	四年	英国曼彻斯特大学理学硕士。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，具有基金从业资格，中国国籍。

注：1. 基金经理的任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日；

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》、本基金《基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

对于场内交易，本基金管理人按照时间优先、价格优先的原则，对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金，采用了系统中的公平交易模块进行操作，实现了公平交易；对于场外交易，本基金管理人按照公司制度和流程执行。

本基金管理人风险管理部负责对各账户公平交易进行事后监察，在每日公平交易报表中记录不同投资组合当天整体收益率、分投资类别（股票、债券）同向（1日、3日、5日）交易价差分析、银行间交易价格偏离度分析；并分别于季度和年度末编制公平交易季度及年度收益率差异分

析报告，对本基金管理人管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）不同时间窗口同向（1 日、3 日、5 日）交易的交易价差以及 T 检验、银行间交易价格偏离度进行了分析。

当监控到疑似异常交易时，本基金管理人风险管理部及时要求相关投资组合经理给予解释，该解释经风险管理部辨认后确认该交易无异常情况后留档备查，公平交易季报及年报由投资组合经理、督察长、总经理签署后，由风险管理部妥善保存分析报告备查。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析，公司未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年 2 季度，经济基本面继续好转，但强度出现较为明显的减弱。金融强监管压倒了基本面，大量债券取消发行和非标受限直接导致社融数据出现快速下滑，但表内信贷增速仍在高位保持稳定，体现了宏观经济的韧性。在稳健偏紧的货币政策下，以同业存单为代表的短期实际利率水平居高不下，收益率曲线异常平坦，我们坚持短久期以获得绝对收益的策略收到了很好的效果。

本基金将在管理好自身流动性基础上，抓住流动性紧张带来的阶段性利率快速上行的机会，配置高收益资产，获取超额收益。

衷心感谢持有人的支持，我们将继续以诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金，努力为持有人带来优异回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内基金业绩表现参见本报告第三部分“主要财务指标和基金净值表现”。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，债市需在震荡中寻找机会。经济基本面大概率略弱于上半年，随着金融监管的具体政策出台的靴子落地，货币政策很难比当前更紧，海外债市走强，美元走弱，未来收益率曲线有重新走陡的可能，国内债市蕴含的机会正逐渐大于潜藏的风险，投资心态应更为积极，主动

把握一些短期的波段机会，但仍需提防金融监管方面的黑天鹅事件。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据相关法律法规的规定，本基金管理人制订了证券投资基金估值政策和程序，并经本基金管理人总经理办公会议审议通过成立了估值委员会。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。具体职责包括对本基金管理人估值政策和程序的制订和解释；在发生影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况，以及在采用新投资策略或投资新品种时，估值委员会负责对所采用的估值模型、假设及参数的适当性进行重新评估或修订，必要时聘请会计师事务所进行审核并出具意见。针对个别投资品种的估值方法调整，均须通过托管银行复核。

估值委员会的成员包括投资部、研究部、风险管理部、基金运营部等有关人员组成。各成员平均具有 8 年以上的基金相关从业经验，且具有风控、证券研究、会计方面的专业经验并具备必要的专业知识和独立性，参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突，并按照制度规定的专业职责分工和估值流程履行估值程序。

基金经理如认为持仓品种的估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议，通过参与对估值问题的讨论和与估值委员会共同商定估值原则和政策等方式，对估值议案提出反馈意见。作为公司估值委员会委员，基金经理有权投票表决有关议案。

本基金管理人尚未签订任何与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金相关法律法规和基金合同的要求，结合本基金实际运作情况，本报告期内，本基金暂未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：西部利得天添鑫货币市场基金
报告截止日：2017年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
资产：			
银行存款		89,780,770.42	138,886,434.70
结算备付金		-	168,181.82
存出保证金		-	-

交易性金融资产		119,769,534.23	266,882,116.95
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		119,769,534.23	266,882,116.95
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		79,400,000.00	580,240,820.00
应收证券清算款		-	-
应收利息		1,697,985.48	2,083,045.33
应收股利		-	-
应收申购款		91,200.00	569,181.00
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		290,739,490.13	988,829,779.80
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		17,999,853.00	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		88,826.84	309,400.13
应付托管费		13,458.61	46,878.79
应付销售服务费		3,886.60	14,381.97
应付交易费用		14,245.05	18,184.74
应交税费		-	-
应付利息		2,132.64	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		209,841.11	182,721.84
负债合计		18,332,243.85	571,567.47
所有者权益：			
实收基金		272,407,246.28	988,258,212.33
未分配利润		-	-
所有者权益合计		272,407,246.28	988,258,212.33
负债和所有者权益总计		290,739,490.13	988,829,779.80

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.008 元，基金份额总额 1,346,374,300.20 份。

6.2 利润表

会计主体：西部利得天添鑫货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 6 月 23 日(基金 合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		11,066,765.91	662,991.86
1.利息收入		11,745,280.03	662,991.86
其中：存款利息收入		2,450,222.62	653,955.29
债券利息收入		2,589,704.77	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		6,705,352.64	9,036.57
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-682,696.84	-
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-682,696.84	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		4,182.72	-
减：二、费用		1,318,404.49	95,828.21
1. 管理人报酬		975,828.06	61,265.78
2. 托管费		147,852.72	9,282.68
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	43,657.39	16,682.88
4. 交易费用		-	-
5. 利息支出		37,443.66	-
其中：卖出回购金融资产支出		37,443.66	-
6. 其他费用		113,622.66	8,596.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,748,361.42	567,163.65
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,748,361.42	567,163.65

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：西部利得天添鑫货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	988,258,212.33	-	988,258,212.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	9,740,578.70	9,740,578.70
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-715,850,966.05	-	-715,850,966.05
其中：1.基金申购款	1,201,275,341.22	-	1,201,275,341.22
2.基金赎回款	-1,917,126,307.27	-	-1,917,126,307.27
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-9,740,578.70	-9,740,578.70
五、期末所有者权益（基金净值）	272,407,246.28	-	272,407,246.28
项目	上年度可比期间 2016 年 6 月 23 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	583,846.53	583,846.53
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,966,827,088.16	-	1,966,827,088.16

其中：1.基金申购款	2,306,248,870.31	-	2,306,248,870.31
2.基金赎回款	-339,421,782.15	-	-339,421,782.15
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-567,163.65	-567,163.65
五、期末所有者权益（基金净值）	1,966,827,088.16	16,682.88	1,966,843,771.04

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 - 至 - 财务报表由下列负责人签署：

<u>贺燕萍</u>	<u>贺燕萍</u>	<u>张峰骏</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

西部利得天添鑫货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]853号批复核准,由西部利得基金管理有限公司依照《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》、《西部利得天添鑫货币市场基金基金合同》和《西部利得天添鑫货币市场基金招募说明书》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币984,218,808.31元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)予以验资。经向中国证监会备案,《西部利得天添鑫货币市场基金基金合同》于2016年6月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为984,267,758.66份基金份额,其中认购资金利息折合48,950.35份基金份额。本基金的基金管理人为西部利得基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金的投资范围等符合《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》、《西部利得天添鑫货币市场基金基金合同》和最新公布的《西部利得天添鑫货币市场基金招募说明书》的有关规定,基本情况可见报告第二部分“基金简介”。

本财务报表由本基金的基金管理人西部利得基金管理有限公司批准于2017年8月29日报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证

券投资基金会计核算业务指引》、《西部利得策略优选股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则-基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)的要求,真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况。

此外本财务报表同时符合如财务报表附注 6.4.2 所列示的其他有关规定的要求。

6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.4.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.4.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

6.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂减按 25%计入应纳税所得

额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
西部利得基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
西部证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
利得科技有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
兴业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年6月23日(基金合同生效日)至2016 年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.7.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年6月23日(基金合同生效日)至 2016年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.7.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年6月23日(基金合同生效日)至 2016年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.7.1.4 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年6月23日(基金合同生效日)至 2016年6月30日	
	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
关联方名称	上年度可比期间 2016年6月23日(基金合同生效日)至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例

注：本基金本报告期及上年度可比期间应支付关联方的佣金均为零。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年	上年度可比期间 2016年6月23日(基金合同

	6 月 30 日	生效日)至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	975,828.06	61,265.78
其中：支付销售机构的客户维护费	4,232.41	-

注：支付基金管理人西部利得基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.33% / 当年天数。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 6 月 23 日(基金合同 生效日)至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	147,852.72	9,282.68

注：支付基金托管人中国兴业银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

6.4.7.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	西部利得天添鑫货币 A	西部利得天添鑫货币 B	合计
西部利得基金	3,131.67	28,983.56	32,115.23
利得科技	912.11	-	912.11
西部证券	250.82	-	250.82
兴业银行	21.06	-	21.06
合计	4,315.66	28,983.56	33,299.22
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016 年 6 月 23 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	西部利得天添鑫货币 A	西部利得天添鑫货币 B	合计
合计	-	-	-

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2017年1月1日至2017年6月30日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
上年度可比期间 2016年6月23日(基金合同生效日)至2016年6月30日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	西部利得天添鑫货币 A	西部利得天添鑫货币 B
基金合同生效日（2016年6月23日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

项目	上年度可比期间 2016年6月23日(基金合同生效日)至2016年6月30日	
	西部利得天添鑫货币 A	西部利得天添鑫货币 B
基金合同生效日（2016年6月23日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-

减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

本基金本报告期基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

西部利得天添鑫货币 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例

西部利得天添鑫货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金的情况。

6.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 6 月 23 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有 限公司	1,780,770.42	116,944.59	563,421,678.16	96,837.94

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位：份)	总金额
上年度可比期间 2016 年 6 月 23 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日					

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:份)	总金额

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.8 期末(2017年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.10.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

6.4.10.1.2 受限证券类别:债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注

6.4.10.1.3 受限证券类别:权证										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:份)	期末成本总额	期末估值总额	备注

本基金于本报告期末未因认购新发/增发而持有流通受限证券。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持暂时停牌股票。

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的
----	----	----	---------

			比例 (%)
1	固定收益投资	119,769,534.23	41.19
	其中：债券	119,769,534.23	41.19
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	79,400,000.00	27.31
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	89,780,770.42	30.88
4	其他各项资产	1,789,185.48	0.62
5	合计	290,739,490.13	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.47	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	17,999,853.00	6.61
	其中：买断式回购融资	-	-

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	39
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	81
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	26

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限 (天数)	原因	调整期
----	------	-------------	----	-----

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	45.59	6.61
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	32.95	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	32.30	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	106.07	6.61

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：报告期内投资组合平均剩余期限无超过 240 天情况。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,015,197.34	11.02
	其中：政策性金融债	30,015,197.34	11.02
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	89,754,336.89	32.95
8	其他	-	-
9	合计	119,769,534.23	43.97
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	111695908	16 包商银行 CD047	500,000	49,862,519.29	18.30
2	111619120	16 恒丰银行 CD120	400,000	39,891,817.60	14.64
3	150417	15 农发 17	300,000	30,015,197.34	11.02

7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	-0.0475%
报告期内偏离度的最低值	-0.2243%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1355%

7.8 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	------	--------------

注：本基金本报告期末未持有资产支持债券。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1

本基金估值采用摊余成本法计价，即估值对象已买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销。

7.9.2

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。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,697,985.48
4	应收申购款	91,200.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,789,185.48

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
西部利得天添鑫货币 A	2,927	1,812.12	414,935.31	7.82%	4,889,148.15	92.18%
西部利得天添鑫货币 B	8	33,387,895.35	267,103,162.82	100.00%	0.00	0.00%
合计	2,935	92,813.37	267,518,098.13	98.21%	4,889,148.15	1.79%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	西部利得天添鑫货币 A	87.72	0.0017%

	西部利得天添鑫货币 B	0.00	0.0000%
	合计	87.72	0.0000%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	西部利得天添鑫货币 A	0
	西部利得天添鑫货币 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	西部利得天添鑫货币 A	0
	西部利得天添鑫货币 B	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	西部利得天添鑫货币 A	西部利得天添鑫货币 B
基金合同生效日（2016 年 6 月 23 日）基金份额总额	351,151,689.16	633,116,069.50
本报告期期初基金份额总额	17,122,168.53	971,136,043.80
本报告期基金总申购份额	90,222,944.94	1,111,052,396.28
减：本报告期基金总赎回份额	102,041,030.01	1,815,085,277.26
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	5,304,083.46	267,103,162.82

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开本基金份额持有人大会，无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金进行审计。

本报告期内，经公司第一届董事会第三十次会议决议，自 2017 年 1 月 9 日起由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）正式改聘为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。详细信息可参见本基金管理人于 2017 年 1 月 10 日披露的《关于旗下基金改聘会计师事务所公告》。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	股票交易		应支付该券商的佣金	
		成交金额	占当期股票	佣金	占当期佣金

	数量		成交总额的比例		总量的比例	备注
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申万宏源	-	-	30,000,000.00	100.00%	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

广发证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	1-3 个月	0.00	107,757,443.70	-	107,757,443.70	39.56%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金为货币市场基金，其主要风险包括但不限于：利率风险、信用风险、流动性风险、操作风险等。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

西部利得基金管理有限公司
2017 年 8 月 29 日