

# 西部利得汇盈债券型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 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：浙商银行股份有限公司

送出日期：二〇二〇年八月三十一日

## § 1 重要提示及目录

### 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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 27 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 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b>                       | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b>                          | <b>6</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 6         |
| 2.2 基金产品说明                              | 6         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 7         |
| 2.4 信息披露方式                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料                              | 7         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>                 | <b>8</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 8         |
| 3.2 基金净值表现                              | 8         |
| 3.3 其他指标                                | 10        |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | <b>11</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 11        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 12        |
| 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             | 12        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 12        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 13        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 13        |
| 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       | 13        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>14</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 14        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 14        |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见      | 14        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>               | <b>15</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 15        |
| 6.2 利润表                                 | 16        |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....                    | 17        |
| 6.4 报表附注 .....                              | 18        |
| <b>§7 投资组合报告 .....</b>                      | <b>38</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况 .....                        | 38        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....                    | 38        |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....     | 38        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                   | 38        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                  | 39        |
| 7.6 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 .....    | 39        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 ..... | 39        |
| 7.8 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贵金属投资明细 ..... | 39        |
| 7.9 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 .....    | 39        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 39        |
| 7.11 投资组合报告附注 .....                         | 40        |
| <b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>                   | <b>41</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 41        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 41        |
| 8.3 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 .....     | 41        |
| <b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>                   | <b>42</b> |
| <b>§10 重大事件揭示 .....</b>                     | <b>43</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 43        |
| 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 .....      | 43        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 43        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 43        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 43        |
| 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 .....         | 43        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 43        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 44        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>             | <b>45</b> |
| 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 .....    | 45        |

---

|                           |           |
|---------------------------|-----------|
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 ..... | 45        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>    | <b>46</b> |
| 12.1 备查文件目录.....          | 46        |
| 12.2 存放地点.....            | 46        |
| 12.3 查阅方式.....            | 46        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                  |              |
|-----------------|------------------|--------------|
| 基金名称            | 西部利得汇盈债券型证券投资基金  |              |
| 基金简称            | 西部利得汇盈债券         |              |
| 场内简称            | —                |              |
| 基金主代码           | 675161           |              |
| 基金运作方式          | 契约型开放式           |              |
| 基金合同生效日         | 2018 年 3 月 26 日  |              |
| 基金管理人           | 西部利得基金管理有限公司     |              |
| 基金托管人           | 浙商银行股份有限公司       |              |
| 报告期末基金份额总额      | 329,758,618.16 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:    | 西部利得汇盈债券 A       | 西部利得汇盈债券 C   |
| 下属分级基金场内简称:     | —                | —            |
| 下属分级基金的交易代码:    | 675161           | 675163       |
| 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 | 329,587,615.85 份 | 171,002.31 份 |

### 2.2 基金产品说明

|               |                                                                                                                                                                                     |            |
|---------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|
| 投资目标          | 在控制风险和保持资产流动性的前提下，优化资产结构，追求基金资产的长期稳健增值。                                                                                                                                             |            |
| 投资策略          | 本基金以固定收益类金融工具为主要投资对象，投资逻辑整体立足于中长期利率趋势，结合宏观基本面和市场的短期变化调整进行综合分析，由投资团队制定相应的投资策略。通过久期管理、期限结构配置、债券品种选择、个券甄选等多环节完成债券投资组合的构建，并根据市场运行所呈现的特点，在保证流动性和风险可控的前提下，对基金组合内的资产进行适时积极的主动管理。（详见《基金合同》） |            |
| 业绩比较基准        | 中国债券综合全价（总值）指数收益率。                                                                                                                                                                  |            |
| 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收益、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。                                                                                                           |            |
|               | 西部利得汇盈债券 A                                                                                                                                                                          | 西部利得汇盈债券 C |
| 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                          | 浙商银行股份有限公司          |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 赵毅                                    | 朱巍                  |
|         | 联系电话 | 021-38572888                          | 0571-87659806       |
|         | 电子邮箱 | service@westleadfund.com              | zhuwei@czbank.com   |
| 客户服务电话  |      | 4007-007-818;021-38572666             | 95527               |
| 传真      |      | 021-38572750                          | 0571-88268688       |
| 注册地址    |      | 中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 11 层 02、03 单元 | 浙江省杭州市萧山区鸿宁路 1788 号 |
| 办公地址    |      | 上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 11 楼            | 浙江省杭州市下城区延安路 368 号  |
| 邮政编码    |      | 200127                                | 310006              |
| 法定代表人   |      | 何方                                    | 沈仁康                 |

## 2.4 信息披露方式

|                      |                                    |
|----------------------|------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称       | 《证券时报》                             |
| 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 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称           | 办公地址                       |
|--------|--------------|----------------------------|
| 注册登记机构 | 西部利得基金管理有限公司 | 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          | 西部利得汇盈债券 A                            | 西部利得汇盈债券 C                            |
|---------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2020 年 1 月 1 日 – 2020 年 6 月 30 日) | 报告期(2020 年 1 月 1 日 – 2020 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益       | 1,187,662.32                          | 1,927,212.00                          |
| 本期利润          | -875,407.42                           | 1,540,867.45                          |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0173                               | 0.0157                                |
| 本期加权平均净值利润率   | -1.63%                                | 1.45%                                 |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.84%                                 | 2.78%                                 |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2020 年 6 月 30 日)                 |                                       |
| 期末可供分配利润      | 15,768,314.44                         | 6,907.59                              |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0478                                | 0.0404                                |
| 期末基金资产净值      | 349,146,864.81                        | 179,946.20                            |
| 期末基金份额净值      | 1.0593                                | 1.0523                                |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2020 年 6 月 30 日)                 |                                       |
| 基金份额累计净值增长率   | 10.08%                                | 9.74%                                 |

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 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

西部利得汇盈债券 A

| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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    |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去一个月 | -0.32%   | 0.06%       | -0.94%     | 0.12%         | 0.62% | -0.06% |
| 过去三个月 | 0.01%    | 0.19%       | -1.04%     | 0.12%         | 1.05% | 0.07%  |
| 过去六个月 | 2.84%    | 0.16%       | 0.79%      | 0.11%         | 2.05% | 0.05%  |
| 过去一年  | 4.74%    | 0.12%       | 1.87%      | 0.08%         | 2.87% | 0.04%  |
| 自基金合同 | 10.08%   | 0.09%       | 5.85%      | 0.07%         | 4.23% | 0.02%  |

|       |  |  |  |  |  |  |
|-------|--|--|--|--|--|--|
| 生效起至今 |  |  |  |  |  |  |
|-------|--|--|--|--|--|--|

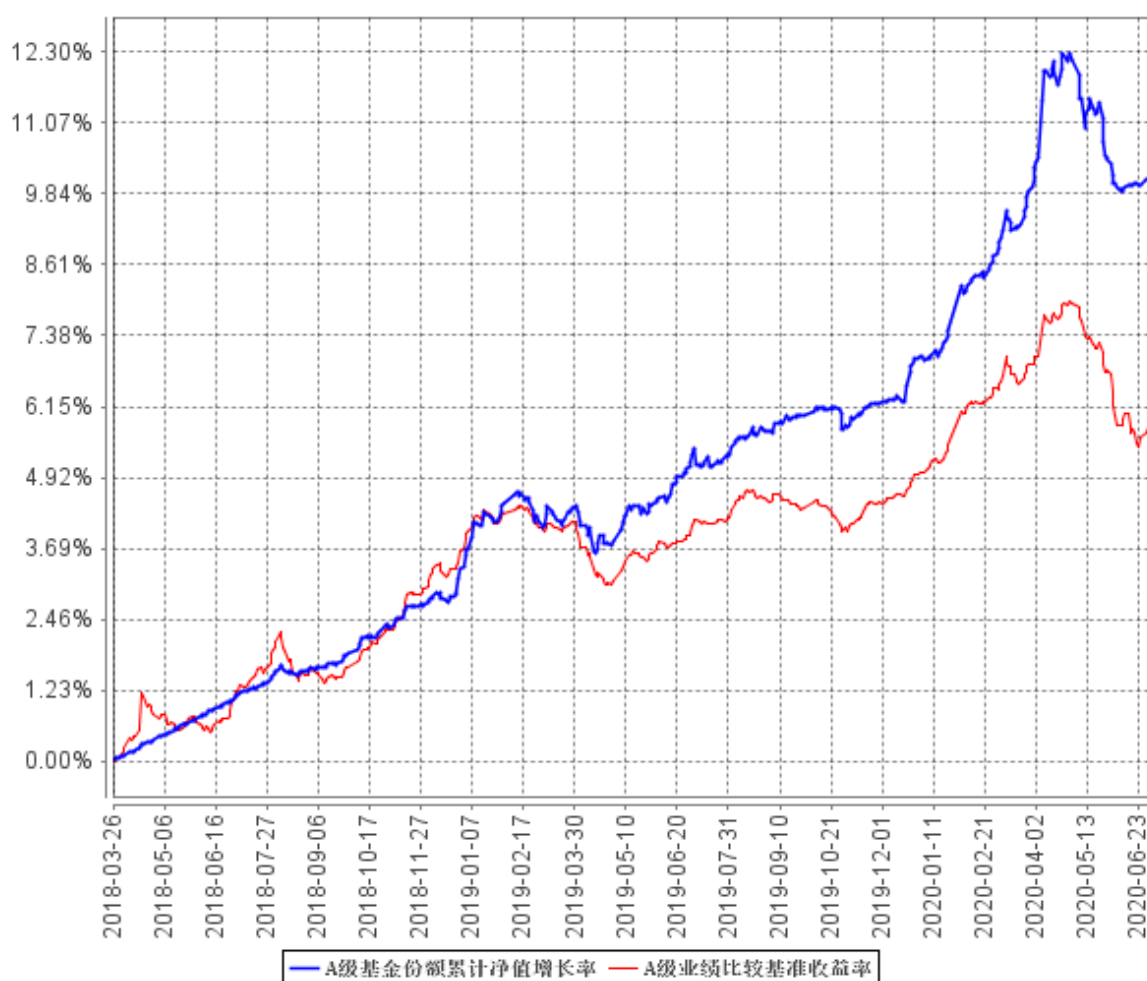
西部利得汇盈债券 C

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去一个月      | -0.36%   | 0.06%       | -0.94%     | 0.12%         | 0.58% | -0.06% |
| 过去三个月      | -0.03%   | 0.19%       | -1.04%     | 0.12%         | 1.01% | 0.07%  |
| 过去六个月      | 2.78%    | 0.16%       | 0.79%      | 0.11%         | 1.99% | 0.05%  |
| 过去一年       | 4.50%    | 0.12%       | 1.87%      | 0.08%         | 2.63% | 0.04%  |
| 自基金合同生效起至今 | 9.74%    | 0.09%       | 5.85%      | 0.07%         | 3.89% | 0.02%  |

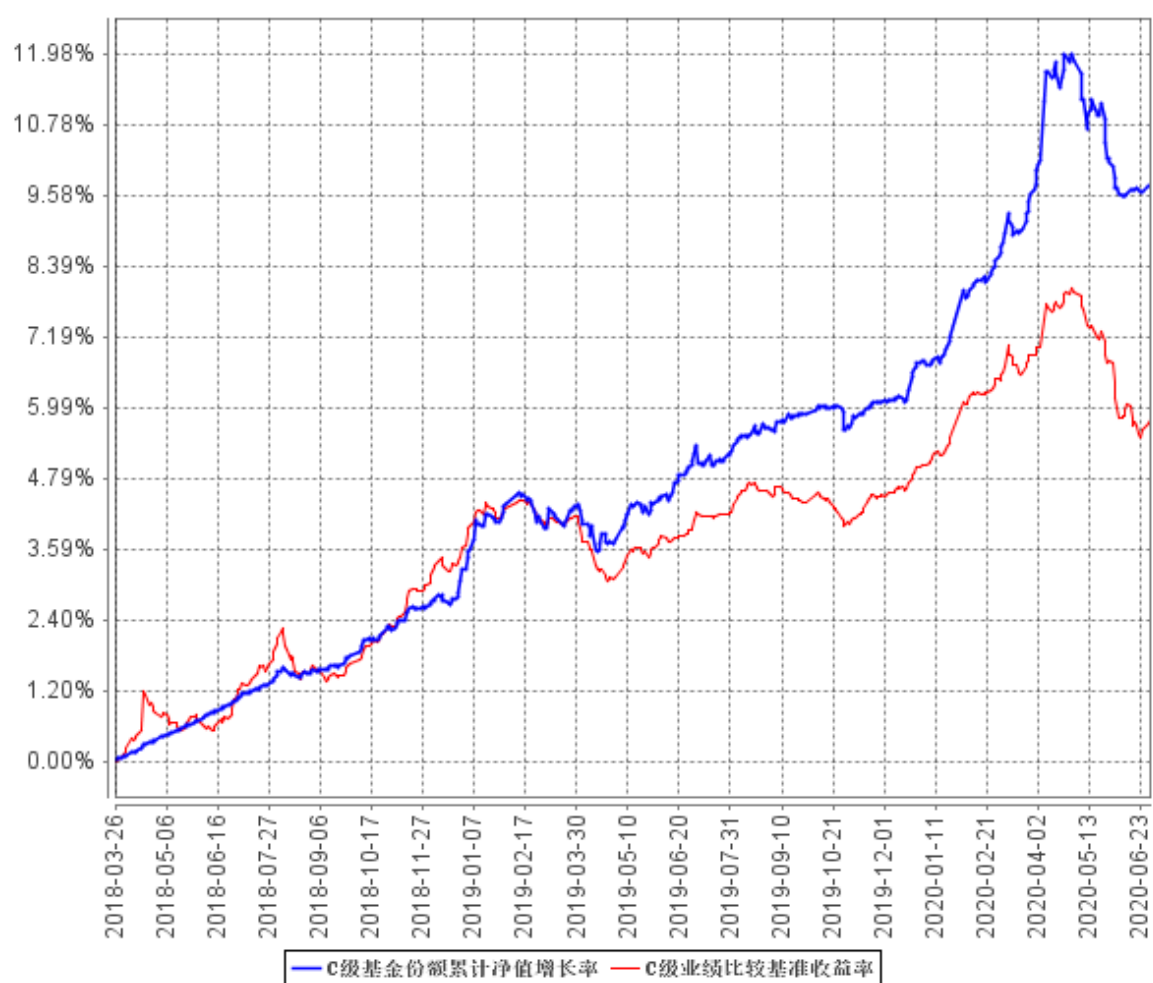
本基金的业绩基准指数=中国债券综合全价（总值）指数收益率

### 3.2.2 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

A级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



C级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



### 3.3 其他指标

无。

## § 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利得科技有限公司合资控股，注册资本3.5亿元人民币，其中西部证券股份有限公司占比51%，利得科技有限公司占比49%，注册地上海。

截至2020年6月30日，本基金管理人旗下共管理39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 |            | 证券从业年限 | 说明                                                                                         |
|-----|------|-----------------|------------|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |      | 任职日期            | 离任日期       |        |                                                                                            |
| 唐煜  | 基金经理 | 2020年3月13日      | —          | 5年     | 南开大学经济学硕士，曾任广发银行总行资产管理部固定收益处投资经理，太平洋资产管理有限公司固定收益经理。2018年11月加入本公司，具有基金从业资格，中国国籍。            |
| 韩丽楠 | 基金经理 | 2018年5月2日       | 2020年3月16日 | 15年    | 英国约克大学经济与金融硕士，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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

本报告期内，两两组合间单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为 0 的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

#### 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

2020 年上半年，我国经济经历了先降后升、逐步复苏的过程。一季度伴随疫情的快速爆发国内经济面临较大下行压力，投资、消费均出现大幅下滑。疫情的扩散导致全球金融市场动荡加剧，因而全球央行开启降息模式。二季度随着复工复产快速推进，前期积极的财政政策加上宽松的货币政策效果显现，在基建和地产投资的推动下，二季度 GDP 同比上涨 3.2%。但与此同时也出现宏观杠杆率快速提升，因此，五月份开始，央行货币政策逐步从最宽松阶段回归至稳健中性。

在此基础上，利率债方面，基本面和货币政策双重影响下，上半年债券收益率先下后上，大幅震荡，呈现深 V 走势。

结合对经济基本面和流动性情况的判断，本基金在报告期内采取稳健的投资策略，前五月主要投资中短期限的利率债，保持合适的组合久期和流动性。五月底组合卖出中短久期利率债，买入短久期信用债，挖掘信用债配置价值。

#### 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

债市上半年核心主线是疫情，展望 2020 年下半年，疫情影响逐步消退，经济和政策逐步回归正常化。货币政策强调直达实体，财政政策专项债和财政赤字发力。基本面向疫情前常态回归，基建为托底经济关键。基于这样的判断，整体认为后续债券市场或将出现一定的震荡调整，信用债的配置价值较此前有一定提升。

#### 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

可参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

#### 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资产净值低于五千万元的情形。

本报告期内，本基金出现连续六十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形，管理人已经向中国证券监督管理委员会报告并提出解决方案，截至本报告期末，该情况已消除。

## § 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

本报告期内，本基金托管人在对西部利得汇盈债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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

西部利得汇盈债券型证券投资基金的管理人——西部利得基金管理有限公司在西部利得汇盈债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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信息的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对西部利得基金管理有限公司编制和披露的西部利得汇盈债券型证券投资基金 2020 年中期报告中财务指标、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进行了复核，以上内容真实、准确和完整。

## § 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：西部利得汇盈债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产             | 附注号        | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 489,159.52                     | 3,466,392.37                     |
| 结算备付金           |            | -                              | 453,550.58                       |
| 存出保证金           |            | 11,205.91                      | 14,223.33                        |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 347,836,071.00                 | 142,832,955.00                   |
| 其中：股票投资         |            | -                              | -                                |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 347,836,071.00                 | 142,832,955.00                   |
| 资产支持证券投资        |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | -                              | -                                |
| 应收证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 10,670,646.59                  | 4,508,145.42                     |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 40.00                          | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 359,007,123.02                 | 151,275,266.70                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2020 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2019 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                                |                                  |
| 短期借款            |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | 9,309,866.03                   | 39,983,820.02                    |
| 应付证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款           |            | 20.14                          | 5,047.67                         |
| 应付管理人报酬         |            | 84,469.04                      | 38,515.70                        |
| 应付托管费           |            | 28,156.35                      | 9,628.94                         |
| 应付销售服务费         |            | 1,466.54                       | 4,182.79                         |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 12,389.08                      | 3,767.94                         |
| 应交税费            |            | 36,411.24                      | -                                |

|               |          |                |                |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应付利息          |          | 959.73         | 3,376.35       |
| 应付利润          |          | -              | -              |
| 递延所得税负债       |          | -              | -              |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 206,573.86     | 165,000.00     |
| 负债合计          |          | 9,680,312.01   | 40,213,339.41  |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |                |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 329,758,618.16 | 104,849,655.96 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 19,568,192.85  | 6,212,271.33   |
| 所有者权益合计       |          | 349,326,811.01 | 111,061,927.29 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 359,007,123.02 | 151,275,266.70 |

报告截止日 2020 年 6 月 30 日，西部利得汇盈债券 A 基金份额净值 1.0593 元，基金份额总额 329,587,615.85 份；西部利得汇盈债券 C 基金份额净值 1.0523 元，基金份额总额 171,002.31 份。西部利得汇盈债券份额总额合计为 329,758,618.16 份。

## 6.2 利润表

会计主体：西部利得汇盈债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                   | 附注号        | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019<br>年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           |            | 1,418,487.03                             | 4,433,944.78                                  |
| 1.利息收入                |            | 3,866,731.00                             | 4,419,414.09                                  |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 36,925.16                                | 30,221.07                                     |
| 债券利息收入                |            | 3,759,240.94                             | 4,347,376.80                                  |
| 资产支持证券利息收入            |            | -                                        | -                                             |
| 买入返售金融资产收入            |            | 70,564.90                                | 41,816.22                                     |
| 其他利息收入                |            | -                                        | -                                             |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | -11,080.00                               | 302,840.40                                    |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12   | -                                        | -                                             |
| 基金投资收益                |            | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13   | -11,080.00                               | 302,840.40                                    |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.13.5 | -                                        | -                                             |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.14   | -                                        | -                                             |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.15   | -                                        | -                                             |
| 股利收益                  | 6.4.7.16   | -                                        | -                                             |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | -2,449,414.29                            | -288,647.70                                   |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -                                        | -                                             |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.18   | 12,250.32                                | 337.99                                        |

|                            |            |            |              |
|----------------------------|------------|------------|--------------|
| 列)                         |            |            |              |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 753,027.00 | 869,834.35   |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 278,742.56 | 470,497.72   |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 79,820.20  | 117,624.41   |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 53,118.44  | 67,346.43    |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | 5,153.17   | 3,888.83     |
| 5. 利息支出                    |            | 236,117.57 | 106,748.55   |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 236,117.57 | 106,748.55   |
| 6. 税金及附加                   |            | 3,901.20   | -            |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 96,173.86  | 103,728.41   |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 665,460.03 | 3,564,110.43 |
| 减：所得税费用                    |            | -          | -            |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 665,460.03 | 3,564,110.43 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：西部利得汇盈债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 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）                   | 104,849,655.96                        | 6,212,271.33   | 111,061,927.29  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）          | -                                     | 665,460.03     | 665,460.03      |
| 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） | 224,908,962.20                        | 19,890,974.28  | 244,799,936.48  |
| 其中：1.基金申购款                        | 429,894,333.09                        | 31,277,635.34  | 461,171,968.43  |
| 2. 基金赎回款                          | -204,985,370.89                       | -11,386,661.06 | -216,372,031.95 |
| 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     | -                                     | -7,200,512.79  | -7,200,512.79   |

|                                                    |                                            |               |                 |
|----------------------------------------------------|--------------------------------------------|---------------|-----------------|
| 少以“-”号填列)                                          |                                            |               |                 |
| 五、期末所有者权益<br>(基金净值)                                | 329,758,618.16                             | 19,568,192.85 | 349,326,811.01  |
| 项目                                                 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 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<br>(基金净值)                                | 304,843,219.14                             | 8,347,855.72  | 313,191,074.86  |
| 二、本期经营活动产生的<br>基金净值变动数(本<br>期利润)                   | -                                          | 3,564,110.43  | 3,564,110.43    |
| 三、本期基金份额交易<br>产生的基金净值变动<br>数<br>(净值减少以“-”号<br>填列)  | -186,789,285.91                            | -6,080,466.85 | -192,869,752.76 |
| 其中：1.基金申购款                                         | 110,693,801.29                             | 3,588,950.90  | 114,282,752.19  |
| 2.基金赎回款                                            | -297,483,087.20                            | -9,669,417.75 | -307,152,504.95 |
| 四、本期向基金份额持<br>有人分配利润产生的<br>基金净值变动(净值减<br>少以“-”号填列) | -                                          | -             | -               |
| 五、期末所有者权益<br>(基金净值)                                | 118,053,933.23                             | 5,831,499.30  | 123,885,432.53  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

|              |              |              |
|--------------|--------------|--------------|
| _____<br>贺燕萍 | _____<br>贺燕萍 | _____<br>张峰骏 |
| 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

西部利得汇盈债券型证券投资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[2017]2108 号《关于准予西部利得汇盈债券型证券投资基金注册的批复》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》和《西部利得汇盈债券型证券投资基金基金合同》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 212,068,997.48 元，业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕

马威华振验字第 1800014 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《西部利得汇盈债券型证券投资基金基金合同》于 2018 年 3 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 212,078,550.87 份基金份额,其中认购资金利息折合 9,553.39 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,基金托管人为浙商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《西部利得汇盈债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、可转换债券(仅投资可分离交易可转换债券的纯债部分)、短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、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。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。

本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%;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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为:中国债券综合全价(总值)指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期未发生会计政策和会计估计变更。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 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。

##### 6.4.5.2 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。

### 6.4.5.3 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。

### 6.4.6 税项

#### (1) 主要税项说明

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[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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》、财税[2015]101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于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》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，

暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，暂免征收个人所得税。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% 计入个人所得税应纳税所得额。

(e) 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。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 489,159.52             |
| 定期存款           | —                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | —                      |
| 存款期限 1-3 个月    | —                      |
| 存款期限 3 个月以上    | —                      |
| 其他存款           | —                      |
| 合计：            | 489,159.52             |

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |                |               |
|---------------|------------------------|----------------|---------------|
|               | 成本                     | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            | —                      | —              | —             |
| 贵金属投资—金交所黄金合约 | —                      | —              | —             |
| 债券            |                        |                |               |
| 交易所市场         | 123,847,144.48         | 122,298,371.00 | -1,548,773.48 |

|        |       |                |                |               |
|--------|-------|----------------|----------------|---------------|
|        | 银行间市场 | 225,976,359.20 | 225,537,700.00 | -438,659.20   |
|        | 合计    | 349,823,503.68 | 347,836,071.00 | -1,987,432.68 |
| 资产支持证券 |       | -              | -              | -             |
| 基金     |       | -              | -              | -             |
| 其他     |       | -              | -              | -             |
| 合计     |       | 349,823,503.68 | 347,836,071.00 | -1,987,432.68 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末及上年度期末均未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 335.64                 |
| 应收定期存款利息   | -                      |
| 应收其他存款利息   | -                      |
| 应收结算备付金利息  | -                      |
| 应收债券利息     | 10,670,305.95          |
| 应收资产支持证券利息 | -                      |
| 应收买入返售证券利息 | -                      |
| 应收申购款利息    | -                      |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                      |
| 其他         | 5.00                   |
| 合计         | 10,670,646.59          |

### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -                      |
| 银行间市场应付交易费用 | 12,389.08              |
| 合计          | 12,389.08              |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | -                      |
| 预提费用        | 206,573.86             |
| 合计          | 206,573.86             |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 西部利得汇盈债券 A    |                                       |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
| 项目            | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                |
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 上年度末          | 30,006.10                             | 30,006.10      |
| 本期申购          | 329,643,280.74                        | 329,643,280.74 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -85,670.99                            | -85,670.99     |
| - 基金拆分/份额折算前  | -                                     | -              |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | -                                     | -              |
| 本期申购          | -                                     | -              |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -                                     | -              |
| 本期末           | 329,587,615.85                        | 329,587,615.85 |

金额单位：人民币元

| 西部利得汇盈债券 C    |                                       |                 |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
| 项目            | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                 |
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额            |
| 上年度末          | 104,819,649.86                        | 104,819,649.86  |
| 本期申购          | 100,251,052.35                        | 100,251,052.35  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -204,899,699.90                       | -204,899,699.90 |

|               |            |            |
|---------------|------------|------------|
| - 基金拆分/份额折算前  | -          | -          |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | -          | -          |
| 本期申购          | -          | -          |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -          | -          |
| 本期末           | 171,002.31 | 171,002.31 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 西部利得汇盈债券 A     |               |               |               |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
| 上年度末           | 772.28        | 127.77        | 900.05        |
| 本期利润           | 1,187,662.32  | -2,063,069.74 | -875,407.42   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 14,579,879.84 | 5,853,876.49  | 20,433,756.33 |
| 其中：基金申购款       | 14,583,222.66 | 5,855,906.83  | 20,439,129.49 |
| 基金赎回款          | -3,342.82     | -2,030.34     | -5,373.16     |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 15,768,314.44 | 3,790,934.52  | 19,559,248.96 |

单位：人民币元

| 西部利得汇盈债券 C     |               |               |                |
|----------------|---------------|---------------|----------------|
| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
| 上年度末           | 5,785,365.02  | 426,006.26    | 6,211,371.28   |
| 本期利润           | 1,927,212.00  | -386,344.55   | 1,540,867.45   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -505,156.64   | -37,625.41    | -542,782.05    |
| 其中：基金申购款       | 7,314,418.08  | 3,524,087.77  | 10,838,505.85  |
| 基金赎回款          | -7,819,574.72 | -3,561,713.18 | -11,381,287.90 |
| 本期已分配利润        | -7,200,512.79 | -             | -7,200,512.79  |
| 本期末            | 6,907.59      | 2,036.30      | 8,943.89       |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 26,439.69                             |
| 定期存款利息收入 | -                                     |
| 其他存款利息收入 | -                                     |

|           |           |
|-----------|-----------|
| 结算备付金利息收入 | 1,101.86  |
| 其他        | 9,383.61  |
| 合计        | 36,925.16 |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金于本报告期末有股票投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | -11,080.00                 |
| 债券投资收益——赎回差价收入                | -                          |
| 债券投资收益——申购差价收入                | -                          |
| 合计                            | -11,080.00                 |

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 225,487,266.09             |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 223,134,070.00             |
| 减：应收利息总额                | 2,364,276.09               |
| 买卖债券差价收入                | -11,080.00                 |

##### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末有债券赎回差价收入。

##### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末有债券申购差价收入。

**6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

本基金于本报告期内未持有资产支持证券。

**6.4.7.14 贵金属投资收益****6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金在本报告期内未持有贵金属。

**6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金在本报告期内未持有贵金属。

**6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金在本报告期内未持有贵金属。

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金在本报告期内未持有贵金属。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内未持有衍生工具。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期内未持有衍生工具。

**6.4.7.16 股利收益**

本基金于本报告期末持有股票，未发生股利收益。

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -2,449,414.29                         |
| ——股票投资     | -                                     |
| ——债券投资     | -2,449,414.29                         |
| ——资产支持证券投资 | -                                     |
| ——贵金属投资    | -                                     |
| ——其他       | -                                     |
| 2. 衍生工具    | -                                     |
| ——权证投资     | -                                     |

|                            |                  |
|----------------------------|------------------|
| 3. 其他                      | -                |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估<br>增值税 | -                |
| 合计                         | -2, 449, 414. 29 |

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 12, 250. 32                           |
| 合计      | 12, 250. 32                           |

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额不低于 25% 的部分归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费不低于 25% 的部分归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 125. 67                               |
| 银行间市场交易费用 | 5, 027. 50                            |
| 交易基金产生的费用 | -                                     |
| 其中：申购费    | -                                     |
| 赎回费       | -                                     |
| 合计        | 5, 153. 17                            |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|-------|---------------------------------------|
| 审计费用  | 17, 901. 52                           |
| 信息披露费 | 59, 672. 34                           |
| 账户维护费 | 18, 600. 00                           |
| 合计    | 96, 173. 86                           |

### 6.4.7.21 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 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。

#### 6.4.9.2 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   |
| 西部证券股份有限公司        | 基金管理人的股东       |
| 利得科技有限公司          | 基金管理人的股东       |
| 浙商银行股份有限公司        | 基金托管人          |
| 西部利得-安瑞 6 号资产管理计划 | 基金管理人管理的资产管理计划 |

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。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

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。

##### 6.4.10.1.2 债券交易

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。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

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。

**6.4.10.1.4 权证交易**

本基金于本报告期内及上年度期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|-----------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 278,742.56                            | 470,497.72                                 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 254.12                                | —                                          |

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 0.30% 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 × 0.30% / 当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 79,820.20                             | 117,624.41                                 |

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.1% 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 × 0.1% / 当年天数。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

|          |    |
|----------|----|
| 获得销售服务费的 | 本期 |
|----------|----|

| 各关联方名称         | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |            |           |
|----------------|---------------------------------|------------|-----------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |            |           |
|                | 西部利得汇盈债券 A                      | 西部利得汇盈债券 C | 合计        |
| 西部利得基金         | 0.00                            | 5,303.90   | 5,303.90  |
| 西部证券           | 0.00                            | 1.45       | 1.45      |
| 浙商银行           | 0.00                            | 0.00       | 0.00      |
| 合计             | 0.00                            | 5,305.35   | 5,305.35  |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间                         |            |           |
|                | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |            |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |            |           |
|                | 西部利得汇盈债券 A                      | 西部利得汇盈债券 C | 合计        |
| 西部利得基金         | 0.00                            | 67,262.95  | 67,262.95 |
| 西部证券           | 0.00                            | 0.00       | 0.00      |
| 浙商银行           | 0.00                            | 0.00       | 0.00      |
| 合计             | 0.00                            | 67,262.95  | 67,262.95 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给西部利得基金，再由西部利得基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 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

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。

#### 6.4.10.5 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                              |           | 上年度可比期间                         |           |
|---------|---------------------------------|-----------|---------------------------------|-----------|
|         | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |           | 2019 年 1 月 1 日至 2019 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    |
| 浙商银行股份有 | 489,159.52                      | 26,439.69 | 2,434,968.18                    | 19,267.03 |

|     |  |  |  |  |
|-----|--|--|--|--|
| 限公司 |  |  |  |  |
|-----|--|--|--|--|

1. 本基金的银行存款由基金托管人浙商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息，于 2020 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 489,159.52 元。

2. 本基金通过“浙商银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2020 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 0.00 元。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

西部利得汇盈债券 C

金额单位：人民币元

| 序号 | 权益<br>登记日          | 除息日 |                    | 每 10 份<br>基金份额分红<br>数 | 现金形式<br>发放总额 | 再投资形式<br>发放总额 | 本期利润分配<br>合计 | 备注 |
|----|--------------------|-----|--------------------|-----------------------|--------------|---------------|--------------|----|
|    |                    | 场内  | 场外                 |                       |              |               |              |    |
| 1  | 2020 年 5<br>月 11 日 | -   | 2020 年 5<br>月 11 日 | 0.3690                | 7,200,485.42 | 27.37         | 7,200,512.79 |    |
| 合计 | -                  | -   | -                  | 0.3690                | 7,200,485.42 | 27.37         | 7,200,512.79 |    |

本基金本报告期内 A 类未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

##### 6.4.12.2 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。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

金额单位：人民币元

| 债券代码   | 债券名称     | 回购到期<br>日  | 期末估值单价 | 数量（张）  | 期末估值总额       |
|--------|----------|------------|--------|--------|--------------|
| 170212 | 17 国开 12 | 2020 年 7 月 | 103.99 | 95,000 | 9,879,050.00 |

|    |  |     |  |        |              |
|----|--|-----|--|--------|--------------|
|    |  | 2 日 |  |        |              |
| 合计 |  |     |  | 95,000 | 9,879,050.00 |

#### 6.4.12.3.2 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金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（含创业板、中小板）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货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。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人力争在严格控制风险的情况下实现基金资产长期增值，对以上风险采取的风险管理政策如下所述：

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括信用风险、流动性风险、市场风险等。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人实行全员参与的全面风险管理，董事会及其下设合规审核委员会、监事会、经营管理层及其下设合规及风险管理委员会、督察长、风险管理部、监察稽核部、各业务部门和分支机构均根据公司制度规定履行各自的风险管理职责。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金均投资于具有良好信用等级的证券；银行存款均存放于信用良好的银行；在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

**6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | —                      | —                        |
| A-1 以下 | —                      | —                        |
| 未评级    | 20,028,000.00          | 3,103,100.00             |
| 合计     | 20,028,000.00          | 3,103,100.00             |

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债、超短期融资券等无信用评级的债券。

**6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | 61,008,000.00          | —                        |
| AAA 以下 | 245,086,700.00         | —                        |
| 未评级    | 21,713,371.00          | 139,729,855.00           |
| 合计     | 327,808,071.00         | 139,729,855.00           |

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债等无信用评级的债券。

**6.4.13.3 流动性风险**

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

**6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内

部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 | 1 年以内          | 1-5 年          | 5 年<br>以上 | 不计息           | 合计             |
|------------------------|----------------|----------------|-----------|---------------|----------------|
| 资产                     |                |                |           |               |                |
| 银行存款                   | 489,159.52     | -              | -         | -             | 489,159.52     |
| 存出保证金                  | 11,205.91      | -              | -         | -             | 11,205.91      |
| 交易性金融资产                | 142,311,371.00 | 205,524,700.00 | -         | -             | 347,836,071.00 |
| 应收利息                   | -              | -              | -         | 10,670,646.59 | 10,670,646.59  |
| 应收申购款                  | -              | -              | -         | 40.00         | 40.00          |
| 资产总计                   | 142,811,736.43 | 205,524,700.00 | -         | 10,670,686.59 | 359,007,123.02 |
| 负债                     |                |                |           |               |                |

|                          |                |                |           |               |                |
|--------------------------|----------------|----------------|-----------|---------------|----------------|
| 卖出回购金融资产款                | 9,309,866.03   | -              | -         | -             | 9,309,866.03   |
| 应付赎回款                    | -              | -              | -         | 20.14         | 20.14          |
| 应付管理人报酬                  | -              | -              | -         | 84,469.04     | 84,469.04      |
| 应付托管费                    | -              | -              | -         | 28,156.35     | 28,156.35      |
| 应付销售服务费                  | -              | -              | -         | 1,466.54      | 1,466.54       |
| 应付交易费用                   | -              | -              | -         | 12,389.08     | 12,389.08      |
| 应付利息                     | -              | -              | -         | 959.73        | 959.73         |
| 应交税费                     | -              | -              | -         | 36,411.24     | 36,411.24      |
| 其他负债                     | -              | -              | -         | 206,573.86    | 206,573.86     |
| 负债总计                     | 9,309,866.03   | -              | -         | 370,445.98    | 9,680,312.01   |
| 利率敏感度缺口                  | 133,501,870.40 | 205,524,700.00 | -         | 10,300,240.61 | 349,326,811.01 |
| 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 | 1 年以内          | 1-5 年          | 5 年<br>以上 | 不计息           | 合计             |
| 资产                       |                |                |           |               |                |
| 银行存款                     | 3,466,392.37   | -              | -         | -             | 3,466,392.37   |
| 结算备付金                    | 453,550.58     | -              | -         | -             | 453,550.58     |
| 存出保证金                    | 14,223.33      | -              | -         | -             | 14,223.33      |
| 交易性金融资产                  | 4,023,955.00   | 138,809,000.00 | -         | -             | 142,832,955.00 |
| 应收利息                     | -              | -              | -         | 4,508,145.42  | 4,508,145.42   |
| 资产总计                     | 7,958,121.28   | 138,809,000.00 | -         | 4,508,145.42  | 151,275,266.70 |
| 负债                       |                |                |           |               |                |
| 卖出回购金融资产款                | 39,983,820.02  | -              | -         | -             | 39,983,820.02  |
| 应付赎回款                    | -              | -              | -         | 5,047.67      | 5,047.67       |
| 应付管理人报酬                  | -              | -              | -         | 38,515.70     | 38,515.70      |
| 应付托管费                    | -              | -              | -         | 9,628.94      | 9,628.94       |
| 应付销售服务费                  | -              | -              | -         | 4,182.79      | 4,182.79       |
| 应付交易费用                   | -              | -              | -         | 3,767.94      | 3,767.94       |
| 应付利息                     | -              | -              | -         | 3,376.35      | 3,376.35       |
| 其他负债                     | -              | -              | -         | 165,000.00    | 165,000.00     |
| 负债总计                     | 39,983,820.02  | -              | -         | 229,519.39    | 40,213,339.41  |
| 利率敏感度缺口                  | -32,025,698.74 | 138,809,000.00 | -         | 4,278,626.03  | 111,061,927.29 |

## 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                                 |                        |
|----|--------------------|---------------------------------|------------------------|
|    | 利率曲线平行移动           |                                 |                        |
| 分析 | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                    | 本期末（2020 年 6 月 30 日）            | 上年度末（2019 年 12 月 31 日） |
|    | 市场利率下降 25 个基点      | 784,686.47                      | 1,103,000.00           |

|  |               |               |                  |
|--|---------------|---------------|------------------|
|  | 市场利率上升 25 个基点 | -782, 452. 53 | -1, 097, 000. 00 |
|--|---------------|---------------|------------------|

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于固定收益类金融工具，主要风险为利率风险和信用风险，其他的市场因素对本基金资产净值无重大影响，因此无重大其他价格风险。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |               | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |               |
|---------------|------------------------|---------------|--------------------------|---------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值                     | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | -                      | -             | -                        | -             |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                      | -             | -                        | -             |
| 交易性金融资产—债券投资  | 347, 836, 071. 00      | 99. 57        | 142, 832, 955. 00        | 128. 61       |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -                      | -             | -                        | -             |
| 衍生金融资产—权证投资   | -                      | -             | -                        | -             |
| 其他            | -                      | -             | -                        | -             |
| 合计            | 347, 836, 071. 00      | 99. 57        | 142, 832, 955. 00        | 128. 61       |

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。第三层次：相关资产或负债的不可观察

输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中无属于第一层级的余额，属于第二层级的余额为 347836071.00 元，无属于第三层级的余额（于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中无属于第一层级的余额，属于第二层级的余额为 142,832,955.00 元，无属于第三层级的余额）。

(ii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具 不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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  | 权益投资              | -              | -             |
|    | 其中：股票             | -              | -             |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 347,836,071.00 | 96.89         |
|    | 其中：债券             | 347,836,071.00 | 96.89         |
|    | 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      | 489,159.52     | 0.14          |
| 8  | 其他各项资产            | 10,681,892.50  | 2.98          |
| 9  | 合计                | 359,007,123.02 | 100.00        |

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

## 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      | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -              | -            |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 41,741,371.00  | 11.95        |
|    | 其中：政策性金融债 | 41,741,371.00  | 11.95        |
| 4  | 企业债券      | 245,269,700.00 | 70.21        |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | 60,825,000.00  | 17.41        |
| 7  | 可转债（可交换债） | -              | -            |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 347,836,071.00 | 99.57        |

## 7.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称          | 数量（张）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 1480489   | 14 西安陆港债      | 840,000 | 34,809,600.00 | 9.96         |
| 2  | 1480528   | 14 世园投资债      | 770,000 | 31,439,100.00 | 9.00         |
| 3  | 143888    | 18 西地 02      | 300,000 | 30,621,000.00 | 8.77         |
| 4  | 143463    | 18 延长 01      | 300,000 | 30,543,000.00 | 8.74         |
| 5  | 101764066 | 17 陕有色 MTN002 | 300,000 | 30,465,000.00 | 8.72         |

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

## 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 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

本基金于本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金于本报告期末未持有国债期货。

**7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金于本报告期末未持有国债期货。

**7.10.3 本期国债期货投资评价**

本基金于本报告期内未持有国债期货。

**7.11 投资组合报告附注****7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

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。

**7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明**

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

**7.11.3 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   | 11,205.91     |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 10,670,646.59 |
| 5  | 应收申购款   | 40.00         |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 10,681,892.50 |

**7.11.4 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。

**7.11.5 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。

**7.11.6 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。

## § 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  |
| 西部利得汇盈债券A | 254      | 1,297,589.04 | 329,563,088.51 | 99.99% | 24,527.34  | 0.01%   |
| 西部利得汇盈债券C | 27       | 6,333.42     | 0.00           | 0.00%  | 171,002.31 | 100.00% |
| 合计        | 280      | 1,177,709.35 | 329,563,088.51 | 99.94% | 195,529.65 | 0.06%   |

注：1. “持有人户数”合计数小于各份额级别持有人户数的总和，是由于一个持有人同时持有多个级别基金份额；

2. 分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 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 | 西部利得汇盈债券A | 4,237.12  | 0.0013%  |
|                  | 西部利得汇盈债券C | 156.49    | 0.0915%  |
|                  | 合计        | 4,393.61  | 0.0013%  |

### 8.3 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 | 西部利得汇盈债券A | 0~10              |
|                                | 西部利得汇盈债券C | 0                 |
|                                | 合计        | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 西部利得汇盈债券A | 0                 |
|                                | 西部利得汇盈债券C | 0                 |
|                                | 合计        | 0                 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                             | 西部利得汇盈债券 A     | 西部利得汇盈债券 C     |
|--------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日（2018 年 3 月 26 日）基金份额总额 | 56,566.56      | 212,021,984.31 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 30,006.10      | 104,819,649.86 |
| 本报告期基金总申购份额                    | 329,643,280.74 | 100,251,052.35 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 85,670.99      | 204,899,699.90 |
| 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                   | 329,587,615.85 | 171,002.31     |

注：其中“总申购份额”含红利再投、转换入份额；“总赎回份额”含转换出份额。

## § 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。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

托管业务的诉讼：报告期内未涉及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。

### 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<br>数量 | 股票交易 |                      | 应支付该券商的佣金 |                | 备注 |
|----------|------------|------|----------------------|-----------|----------------|----|
|          |            | 成交金额 | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例 | 佣金        | 占当期佣金<br>总量的比例 |    |
| 兴业证券     | 1          | -    | -                    | -         | -              | -  |
| 西藏东方财富证券 | 1          | -    | -                    | -         | -              | -  |

注：1. 基金租用席位的选择标准是：（1）资质雄厚，信誉良好；（2）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；（3）经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；（4）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；（5）公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专

门研究报告。选择程序是：根据对各券商提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合席位券商标准的，由公司研究部提出席位券商的调整意见（调整名单及调整原因），并经公司批准。

### 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 |
| 兴业证券     | —              | —            | —              | —              | —    | —            |
| 西藏东方财富证券 | 122,928,041.09 | 100.00%      | 158,000,000.00 | 100.00%        | —    | —            |

### 10.8 其他重大事件

本报告期内本基金未发生其他重大事件。

## § 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              | 2020/1/1-2020/6/2       | 95,020,904.60 | 0.00          | 95,020,904.60 | 0.00          | 0.00%  |
| 个人                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | -              | -                       | -             | -             | -             | -             | -      |
| 产品                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 1              | 2020/4/23-2020/5/11     | 0.00          | 45,118,209.71 | 45,118,209.71 | 0.00          | 0.00%  |
| 产品                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 2              | 2020/4/23-2020/6/1      | 0.00          | 54,141,851.65 | 54,141,851.65 | 0.00          | 0.00%  |
| 产品                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 3              | 2020/6/2-2020/6/30      | 0.00          | 94,161,016.95 | 0.00          | 94,161,016.95 | 28.55% |
| 产品                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 4              | 2020/6/2-2020/6/30      | 0.00          | 94,161,016.95 | 0.00          | 94,161,016.95 | 28.55% |
| 产品                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 5              | 2020/6/2-2020/6/30      | 0.00          | 94,161,016.95 | 0.00          | 94,161,016.95 | 28.55% |
| 产品特有风险                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                |                         |               |               |               |               |        |
| <p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p> |                |                         |               |               |               |               |        |

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准本基金设立的相关文件；
- (2) 本基金《基金合同》；
- (3) 本基金《招募说明书》；
- (4) 本基金《托管协议》；
- (5) 基金管理人《基金管理资格证书》及《企业法人营业执照》；
- (6) 报告期内本基金公告的各项原稿。

### 12.2 存放地点

本基金管理人处——上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 11 楼

### 12.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资人可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.westleadfund.com> 投资人对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人西部利得基金管理有限公司，咨询电话 4007-007-818（免长途话费）或发电子邮件，E-mail:service@westleadfund.com。

西部利得基金管理有限公司

2020 年 8 月 31 日