

# 西部利得天添鑫货币市场基金 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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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.....	6
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.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
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 债券回购融资情况.....	38
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	38
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.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	40
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	40
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细.....	40
7.9 投资组合报告附注.....	41
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>42</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
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.....	43
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>43</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>44</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
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.....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变.....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
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.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	46
10.9 其他重大事件.....	46
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>47</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.....	47

11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	47
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>48</b>
12.1 备查文件目录.....	48
12.2 存放地点.....	48
12.3 查阅方式.....	48

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	西部利得天添鑫货币市场基金	
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	810,385,990.11 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	424,095,013.14 份	386,290,976.97 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	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。投资策略包括：收益率曲线分析策略、久期配置策略、类属资产配置策略、回购策略、流动性管理策略、套利策略、资产支持证券投资策略、非金融企业债务融资工具投资策略。（详见《基金合同》）	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为中国人民银行公布的活期存款基准利率的税后收益率。	
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种，其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。	
	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	龚小武
	联系电话	021-38572888	021-52629999-212056
	电子邮箱	service@westleadfund.com	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话		4007-007-818;021-38572666	95561
传真		021-38572750	021-62159217
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	福州市湖东路 154 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	上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼
邮政编码		200127	200041
法定代表人		何方	高建平

## 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(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	4,439,874.16	6,065,843.08
本期利润	4,439,874.16	6,065,843.08
本期净值收益率	0.9342%	1.0548%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)	
期末基金资产净值	424,095,013.14	386,290,976.97
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)	
累计净值收益率	12.2170%	13.3077%

#### 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	0.1003%	0.0006%	0.0287%	0.0000%	0.0716%	0.0006%
过去三个月	0.3260%	0.0006%	0.0871%	0.0000%	0.2389%	0.0006%
过去六个月	0.9342%	0.0024%	0.6736%	0.0000%	0.2606%	0.0024%
过去一年	2.2387%	0.0021%	1.3610%	0.0000%	0.8777%	0.0021%
过去三年	9.1486%	0.0028%	4.1350%	0.0000%	5.0136%	0.0028%
自基金合同生效起至今	12.2170%	0.0028%	4.9389%	0.0000%	7.2781%	0.0028%

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	0.1200%	0.0006%	0.0287%	0.0000%	0.0913%	0.0006%
过去三个月	0.3859%	0.0006%	0.0871%	0.0000%	0.2988%	0.0006%
过去六个月	1.0548%	0.0024%	0.6736%	0.0000%	0.3812%	0.0024%
过去一年	2.4845%	0.0021%	1.3610%	0.0000%	1.1235%	0.0021%
过去三年	9.9364%	0.0028%	4.1350%	0.0000%	5.8014%	0.0028%
自基金合同	13.3077%	0.0028%	4.9389%	0.0000%	8.3688%	0.0028%



---

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

### 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

### 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		
刘心峰	基金经理	2017年2月17日	-	7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。
张英	基金经理	2020年3月16日	-	9年	中国人民大学国际经济与贸易学士，曾任广东南粤银行管理培训生、流动性管理岗、业务经理。2018年9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遵规守信情况的说明

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，受新冠疫情影响全球经济活动经历了从停滞到重启的过程，全球宽松货币政策重启以对冲经济活动停滞和人员隔离的影响，各类资产价格经历了大幅波动。国内来看，一季度 GDP 同比增长-6.8%，与此同时央行通过降准、下调 OMO 和 MLF 利率、增加再贷款和再贴现额度定向支持企业融资，期间 10 年期国债活跃券收益率创 2002 年以来的新低至 2.52%。二季度，国内疫情防控取得重大进展，重点城市疫情防控等级下降，两会召开明确今年经济社会发展目标和措施，社会正常经济活动逐步进入恢复阶段。二季度 GDP 由负转正同比增长 3.2%，货币政策伴随疫情进展逐渐由总量宽松转向支持实体经济恢复与可持续发展，边际变化使货币利率和债券收益率由底部反弹，收益率曲线由陡走平，债券资产价格大幅调整，10 年期国债活跃券收益率由 2.46% 的低点最高上行至 2.93%，回到年初疫情爆发前水平。

本基金在严控信用风险的前提下根据货币资产利率波动情况择机配置，在收益率相对低位主要以流动性较好的 3M 资产为主，增加了信用债持仓，收益率调整阶段根据申购节奏逐渐缩短组合久期，提高再配置收益。

#### 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，伴随经济基本面复苏和货币政策回归正常化，债券市场预计维持震荡。首先，宏观经济经历供给快速回补后需求也在逐步复苏中，基建投资增长将成为下半年经济主要的增长

点。虽然从产业和就业等微观层面上经济难以回到疫情前水平，但总量改善向上趋势不变。其次，债市经历一季度的大幅下行和第二季度的反转后，超调幅度虽然在修复，但支撑前期快速下行的流动性宽松环境已结束。随着货币政策回归正常化，基础货币减少和货币乘数持续上行的组合下无风险利率不具备大幅下行的基础。货币市场利率向政策利率靠拢，实体经济流动性需求增加，货币市场预计维持紧平衡格局。第三，伴随经济恢复商品和权益市场的上涨提升市场风险偏好，对债券资产形成压制。

虽然债券资产获得资本利得的难度在增加，但从绝对收益上看债券的配置价值在逐步体现，货币类资产的配置收益改善。无风险利率基本回到疫情前水平，与政策利率的利差回归正常水平。从信用债收益率的历史分位数来看，有市场交投的部分债券已由 1 季度 25%以下分位回到 25%分位以上，基本回到 2019 年 3 季度水平。同时整体经济增速仍在下行阶段，在目前的经济与政策组合下无风险利率继续上行的幅度有限，伴随美国大选推进，国际政治仍有一定的不确定性，超预期事件会带动市场避险情绪升温，下半年利率债预计仍有短期交易机会。

本基金将继续加强对组合流动性风险的管理，根据持有人结构选择适当的组合久期，适应不同情形下资产变现需求。同时，积极保持对短期逆回购和债券类资产的配置力度，把握资产配置的关键时点，在控制风险的前提下提高投资收益，努力为基金持有人取得稳健的投资回报。

#### 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管理部、风险控制岗、监察稽核部、基金运营部等有关人员组成。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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场债券品种的估值数据及交易所交易的债券品种的估值数据、流通

受限股票流动性折扣。

#### **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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	142,038,881.77	163,995,847.92
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	564,774,847.07	229,154,973.51
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		564,774,847.07	229,154,973.51
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	143,806,826.99	211,379,614.84
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	3,011,985.47	1,427,955.57
应收股利		-	-
应收申购款		68,291,500.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		921,924,041.30	605,958,391.84
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 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		110,609,544.69	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		364,633.54	147,853.65
应付托管费		55,247.49	22,402.06
应付销售服务费		105,479.39	86,917.69
应付交易费用	6.4.7.7	49,132.25	14,161.53
应交税费		6,426.87	-

应付利息		8,127.47	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	339,459.49	305,104.18
负债合计		111,538,051.19	576,439.11
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	810,385,990.11	605,381,952.73
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		810,385,990.11	605,381,952.73
负债和所有者权益总计		921,924,041.30	605,958,391.84

报告截止日 2020 年 6 月 30 日，西部利得天添鑫货币 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 424,095,013.14 份；西部利得天添鑫货币 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 386,290,976.97 份。西部利得天添鑫货币份额总额合计为 810,385,990.11 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：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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		13,690,181.14	7,155,293.27
1.利息收入		13,772,395.58	7,146,738.08
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,381,791.04	2,186,128.82
债券利息收入		5,465,696.88	1,833,895.28
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,924,907.66	3,126,713.98
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-82,214.44	-
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	-82,214.44	-
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	-	-
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	-	8,555.19



列)			
<b>减：二、费用</b>		3,184,463.90	1,213,162.82
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,922,697.21	701,990.28
2. 托管费	6.4.10.2.2	291,317.71	106,362.19
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	642,889.81	154,492.89
4. 交易费用	6.4.7.19	-	-
5. 利息支出		185,124.98	117,712.72
其中：卖出回购金融资产支出		185,124.98	117,712.72
6. 税金及附加		2,516.70	-
7. 其他费用	6.4.7.20	139,917.49	132,604.74
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		10,505,717.24	5,942,130.45
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		10,505,717.24	5,942,130.45

### 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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)	605,381,952.73	-	605,381,952.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	10,505,717.24	10,505,717.24
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)	205,004,037.38	-	205,004,037.38
其中：1. 基金申购款	7,197,323,989.62	-	7,197,323,989.62
2. 基金赎回款	-6,992,319,952.24	-	-6,992,319,952.24
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)	-	-10,505,717.24	-10,505,717.24

五、期末所有者权益(基金净值)	810,385,990.11	-	810,385,990.11
	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日		
项目	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)	275,015,931.33	-	275,015,931.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,942,130.45	5,942,130.45
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)	165,571,056.51	-	165,571,056.51
其中：1.基金申购款	1,881,793,904.32	-	1,881,793,904.32
2.基金赎回款	-1,716,222,847.81	-	-1,716,222,847.81
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)	-	-5,942,130.45	-5,942,130.45
五、期末所有者权益(基金净值)	440,586,987.84	-	440,586,987.84

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《关于准予西部利得天添鑫货币市场基金注册的批复》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《西部利得天添鑫货币市场基金基金合同》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)普华永道中天验字(2016)第827号验资报告予以验资。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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《西部利得天添鑫货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，期限在一年以内(含一年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券，以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。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。

本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的活期存款基准利率收益率(税后)。

#### **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与会计估计变更。

#### **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

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[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]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号文《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) 证券投资基金管理人运用基金买卖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债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对自国债、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) 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。

(d) 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 2020年6月30日
活期存款	7,038,881.77

定期存款	135,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	75,000,000.00
存款期限 1-3 个月	60,000,000.00
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	142,038,881.77

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 6 月 30 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	564,774,847.07	564,521,000.00	-253,847.07	-0.0313%
	合计	564,774,847.07	564,521,000.00	-253,847.07	-0.0313%
	资产支持证券	-	-	-	-
	合计	564,774,847.07	564,521,000.00	-253,847.07	-0.0313%

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	45,816,000.00	-
银行间市场	97,990,826.99	-
合计	143,806,826.99	-

##### 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 2020年6月30日
应收活期存款利息	617.11
应收定期存款利息	389,614.04
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	2,520,179.76
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	101,574.56
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	3,011,985.47

**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 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	49,132.25
合计	49,132.25

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付银行汇划手续费	5,924.13
预提费用	333,535.36
合计	339,459.49

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

西部利得天添鑫货币 A		
项目	本期 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	425,112,606.10	425,112,606.10
本期申购	4,600,727,162.73	4,600,727,162.73
本期赎回(以“-”号填列)	-4,601,744,755.69	-4,601,744,755.69
- 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	424,095,013.14	424,095,013.14

金额单位：人民币元

西部利得天添鑫货币 B		
项目	本期 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	180,269,346.63	180,269,346.63
本期申购	2,596,596,826.89	2,596,596,826.89
本期赎回(以“-”号填列)	-2,390,575,196.55	-2,390,575,196.55
- 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	386,290,976.97	386,290,976.97

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

西部利得天添鑫货币 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	4,439,874.16	-	4,439,874.16
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-

本期已分配利润	-4,439,874.16	-	-4,439,874.16
本期末	-	-	-

单位：人民币元

西部利得天添鑫货币 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	6,065,843.08	-	6,065,843.08
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-6,065,843.08	-	-6,065,843.08
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	62,175.03
定期存款利息收入	3,223,843.52
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	17,726.76
其他	78,045.73
合计	3,381,791.04

#### 6.4.7.12 股票投资收益

本基金在本报告期内未持有股票。

#### 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 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	-82,214.44
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	-82,214.44
----	------------

#### 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 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	1,652,769,826.17
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,649,231,348.10
减：应收利息总额	3,620,692.51
买卖债券差价收入	-82,214.44

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末未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

本基金本报告期末未有债券申购差价收入。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

#### 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

本基金在本报告期和上一报告期内均未持有贵金属。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金在本报告期和上一报告期内均未持有贵金属。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期和上一报告期内均未持有贵金属。

##### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期和上一报告期内均未持有贵金属。

#### 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

本基金于本报告期和上一报告期内均未持有衍生工具。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金于本报告期和上一报告期内均未持有衍生工具。

#### 6.4.7.16 股利收益

本基金于本报告期和上一报告期内均未发生股利收益。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

本基金于本报告期和上一报告期均未有公允价值变动损益。

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	-
其他	-
合计	-

本基金于本报告期未发生其他收入。

#### 6.4.7.19 交易费用

本基金在本报告期内未发生交易费用。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
债券账户维护费	18,600.00
银行汇划费用	36,782.13
合计	139,917.49

#### 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
兴业银行股份有限公司	基金托管人
西部利得-中铁乾盈一号分级资产管理计划	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 2020年1月1日至2020年6月 30日	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管理费	1,922,697.21	701,990.28
其中：支付销售机构的客户维护费	579,030.15	134,886.61

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。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	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托管费	291,317.71	106,362.19

注：支付基金托管人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。

### 6.4.10.2.3 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		
	西部利得天添鑫 货币 A	西部利得天添鑫货 币 B	合计
兴业银行	549.01	0.00	549.01
西部利得基金	5,101.29	33,464.30	38,565.59
西部证券	599,509.50	0.00	599,509.50
合计	605,159.80	33,464.30	638,624.10
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		
	西部利得天添鑫 货币 A	西部利得天添鑫货 币 B	合计
兴业银行	1,992.43	0.00	1,992.43
西部利得基金	658.44	15,515.95	16,174.39
西部证券	127,049.96	0.00	127,049.96
合计	129,700.83	15,515.95	145,216.78

h 注：支付基金销售机构的销售服务费：

1. 按前一日 A 类基金资产净值 0.25% 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 × 0.25% / 当年天数。

2. 按前一日 B 类基金资产净值 0.01% 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 × 0.01% / 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

西部利得天添鑫货币 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 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- 中铁乾盈一 号分级资产 管理计划	2,005,664.31	0.2475%	-	-

注：除管理人之外的其他关联方在本报告期内未持有西部利得天添鑫 B 类份额。

#### 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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 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
兴业银行股份 有限公司	7,038,881.77	62,175.03	10,033,639.06	224,447.72

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。

#### 6.4.10.6 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

金额单位：人民币元

##### 西部利得天添鑫货币A

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配 合计	备注
4,439,874.16	-	-	4,439,874.16	-

##### 西部利得天添鑫货币B

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配 合计	备注
6,065,843.08	-	-	6,065,843.08	-

## 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	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
11035101209917	20 贴现 国债 17	2020 年 7 月 1 日	99.95	500,000	49,975,000.00
11036901170209	17 国开 09	2020 年 7 月 1 日	100.46	120,000	12,055,200.00
11036901190307	19 进出 07	2020 年 7 月 1 日	100.21	200,000	20,042,000.00
11036901200201	20 国开 01	2020 年 7 月 1 日	100.14	100,000	10,014,000.00
11036901170209	17 国开 09	2020 年 7 月 1 日	100.46	230,000	23,105,800.00
合计				1,150,000	115,192,000.00

#### 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

本基金的投资范围为具有良好流动性的货币市场工具，包括现金、期限在一年以内（含一年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券，以及中国证监会、中国人民银行认可的其他货币市场工具。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，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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
A-1	90,001,724.08	-
A-1 以下	-	-
未评级	190,156,893.95	29,999,537.31
合计	280,158,618.03	29,999,537.31

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 按短期信用评级列示的资产支持证券投资



**6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	249,430,675.55	199,155,436.20
合计	249,430,675.55	199,155,436.20

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。

**6.4.13.2.4 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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	35,185,553.49	-
合计	35,185,553.49	-

注 1：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。

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资****6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资****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 金融资产和金融负债的到期期限分析**

#### **6.4.13.3.2 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 2020 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	142,038,881.77	-	-	-	-142,038,881.77
交易性金融资产	564,774,847.07	-	-	-	-564,774,847.07
买入返售金融资产	143,806,826.99	-	-	-	-143,806,826.99
应收利息	-	-	-	3,011,985.47	3,011,985.47
应收申购款	-	-	-	68,291,500.00	68,291,500.00
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	850,620,555.83	-	-	71,303,485.47	921,924,041.30
负债					
卖出回购金融资产款	110,609,544.69	-	-	-	-110,609,544.69
应付管理人报酬	-	-	-	364,633.54	364,633.54
应付托管费	-	-	-	55,247.49	55,247.49
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	49,132.25	49,132.25
应付利息	-	-	-	8,127.47	8,127.47
应交税费	-	-	-	6,426.87	6,426.87
其他负债	-	-	-	339,459.49	339,459.49
负债总计	110,609,544.69	-	-	823,027.11	111,432,571.80
利率敏感度缺口	740,011,011.14	-	-	70,480,458.36	810,491,469.50
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	163,995,847.92	-	-	-	-163,995,847.92
交易性金融资产	229,154,973.51	-	-	-	-229,154,973.51
买入返售金融资产	211,379,614.84	-	-	-	-211,379,614.84
应收利息	-	-	-	1,427,955.57	1,427,955.57
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	604,530,436.27	-	-	1,427,955.57	605,958,391.84
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	147,853.65	147,853.65

应付托管费	-	-	-	22,402.06	22,402.06
应付销售服务费	-	-	-	86,917.69	86,917.69
应付交易费用	-	-	-	14,161.53	14,161.53
其他负债	-	-	-	305,104.18	305,104.18
负债总计	-	-	-	576,439.11	576,439.11
利率敏感度缺口	604,530,436.27	-	-	851,516.46	605,381,952.73

#### 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	195,337.68	71,000.00
	市场利率上升 25 个基点	-195,039.98	-71,000.00

#### 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

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

#### 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 56477847.07 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 48878063.00 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	固定收益投资	564,774,847.07	61.26
	其中: 债券	564,774,847.07	61.26
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	143,806,826.99	15.60
	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	142,038,881.77	15.41
4	其他各项资产	71,303,485.47	7.73
5	合计	921,924,041.30	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	2.02	
	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	110,609,544.69	13.65
	其中: 买断式回购融资	-	-

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值 20%

### 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	41
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	59
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	31

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

#### 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	56.24	13.65
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	25.89	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	10.50	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	3.69	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	8.64	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		104.96	13.65

#### 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

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过 240 天的情况。

#### 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	49,986,736.61	6.17
2	央行票据	-	-
3	金融债券	65,338,152.15	8.06
	其中：政策性金融债	65,338,152.15	8.06
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	200,019,282.76	24.68
6	中期票据	-	-
7	同业存单	249,430,675.55	30.78
8	其他	-	-
9	合计	564,774,847.07	69.69
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	209917	20 贴现国债 17	500,000	49,986,736.61	6.17
2	111903112	19 农业银行 CD112	500,000	49,916,195.18	6.16
3	170209	17 国开 09	350,000	35,185,553.49	4.34
4	072000092	20 国信证券 CP005	300,000	30,002,161.68	3.70
5	072000104	20 银河证券 CP004	300,000	29,998,952.40	3.70
6	111904073	19 中国银行 CD073	300,000	29,942,847.83	3.69
7	190307	19 进出 07	200,000	20,097,053.81	2.48
8	012000848	20 华菱集团 SCP001	200,000	20,011,590.05	2.47
9	072000087	20 渤海证券 CP004	200,000	20,000,562.25	2.47
10	012001358	20 中芯国际 SCP002	200,000	20,000,048.24	2.47

## 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	0.0561%
报告期内偏离度的最低值	-0.0440%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0286%

## 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

无

## 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

无

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。



## 7.9 投资组合报告附注

### 7.9.1 基金计价方法说明

### 7.9.2 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。

### 7.9.3 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	3,011,985.47
4	应收申购款	68,291,500.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	71,303,485.47

### 7.9.4 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
西部利得天添鑫货币 A	7,975	53,178.06	36,530,126.70	8.61%	387,564,886.44	91.39%
西部利得天添鑫货币 B	19	20,331,104.05	386,286,696.45	100.00%	4,280.52	0.00%
合计	7,994	101,374.28	422,816,823.15	52.17%	387,569,166.96	47.83%

### 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	其他机构	68,290,000.00	8.43%
2	其他机构	59,205,373.16	7.31%
3	保险类机构	50,334,924.76	6.21%
4	其他机构	50,173,980.71	6.19%
5	其他机构	28,266,426.68	3.49%
6	其他机构	22,966,865.12	2.83%
7	其他机构	21,004,498.19	2.59%
8	其他机构	20,222,108.70	2.50%
9	其他机构	20,082,708.72	2.48%
10	保险类机构	17,071,358.52	2.11%

### 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	48,234.46	0.0114%
	西部利得天添鑫货币 B	-	-
	合计	48,234.46	0.0060%

#### 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	0~10
	西部利得天添鑫货币 B	0
	合计	0~10
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	425,112,606.10	180,269,346.63
本报告期基金总申购份额	4,600,727,162.73	2,596,596,826.89
减：本报告期基金总赎回份额	4,601,744,755.69	2,390,575,196.55
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	424,095,013.14	386,290,976.97

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更。

### 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。

### 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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东北证券	2	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	3	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-

太平洋证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

### 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
东北证券	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	1,832,677,044.00	100.00%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

### **10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况**

本基金本报告期未发生偏离度绝对值超过0.5%的情况。

### **10.9 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品	1	2020/3/13-2020/3/18	-	401,784,996.00	401,784,996.00	-	-
产品	2	2020/3/24-2020/3/25	-	401,784,996.00	401,784,996.00	-	-
产品	3	2020/3/27-2020/4/27	-	401,784,996.00	401,784,996.00	-	-
产品	4	2020/5/12-2020/5/13	-	401,784,996.00	401,784,996.00	-	-
产品	5	2020/5/15-2020/6/29	-	401,784,996.00	401,784,996.00	-	-
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