西部利得汇享债券型证券投资基金
2021年中期报告

2021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：平安银行股份有限公司

送出日期：2021年8月30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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 25 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 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2
1.2 目录 3

§2 基金简介 5

2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6

§3 主要财务指标和基金净值表现 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
3.3 其他指标 9

§4 管理人报告 9

4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
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 11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
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 12

§5 托管人报告 12

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
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 12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 12

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 12

6.1 资产负债表 12
6.2 利润表 14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 15
6.4 报表附注 16

§7 投资组合报告 36

7.1 期末基金资产组合情况 36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 36
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 36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 37

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 37
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 37
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 37
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 38
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 38
7.11 投资组合报告附注 38

§8 基金份额持有人信息 39

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 40
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情况 41

§9 开放式基金份额变动 41

§10 重大事件揭示 41

10.1 基金份额持有人大会决议 41
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 41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 42
10.4 基金投资策略的改变 42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 42
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 42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 42
10.8 其他重大事件 43

§11 影响投资者决策的其他重要信息 43

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 43
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 43

§12 备查文件目录 44

12.1 备查文件目录 44
12.2 存放地点 44
12.3 查阅方式 44

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	西部利得汇享债券型证券投资基金	
基金简称	西部利得汇享债券	
基金主代码	675111	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 3 月 10 日	
基金管理人	西部利得基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,277,392,569.81 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	西部利得汇享债券 A	西部利得汇享债券 C
下属分级基金的交易代码	675111	675113
报告期末下属分级基金的份额总额	828,332,065.96 份	1,449,060,503.85 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，对固定收益类资产进行投资，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	中债综合指数收益率。
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。

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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵毅	李帅帅
	联系电话	021-38572888	0755-25878287
	电子邮箱	service@westleadfund.com	LISHUAISHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		4007-007-818	95511-3
传真		021-38572750	0755-82080387
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区耀	广东省深圳市罗湖区深南东路

	体路 276 号 901 室-908 室	5047 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区耀体路 276 号 901 室-908 室	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 26 楼
邮政编码	200126	518001
法定代表人	何方	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.westleadfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人处——上海市浦东新区耀体路 276 号晶耀商务广场 3 号楼 9 层

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	中国（上海）自由贸易试验区耀体路 276 号 901 室-908 室

§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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)	
	西部利得汇享债券 A	西部利得汇享债券 C
本期已实现收益	14,062,175.89	26,363,933.70
本期利润	20,554,676.84	39,681,512.48
加权平均基金份额本期利润	0.0320	0.0329
本期加权平均净值利润率	2.89%	2.97%
本期基金份额净值增长率	3.03%	2.99%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	73,046,306.91	122,034,357.79

期末可供分配基金份额利润	0.0882	0.0842
期末基金资产净值	933,793,656.06	1,627,591,506.86
期末基金份额净值	1.1273	1.1232
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	30.97%	29.92%

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

西部利得汇享债券 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	0.27%	0.06%	-0.04%	0.03%	0.31%	0.03%
过去三个月	1.82%	0.05%	0.45%	0.03%	1.37%	0.02%
过去六个月	3.03%	0.07%	0.65%	0.04%	2.38%	0.03%
过去一年	5.10%	0.08%	-0.20%	0.06%	5.30%	0.02%
过去三年	23.71%	0.09%	4.53%	0.07%	19.18%	0.02%
自基金合同生效起至今	30.97%	0.09%	4.46%	0.07%	26.51%	0.02%

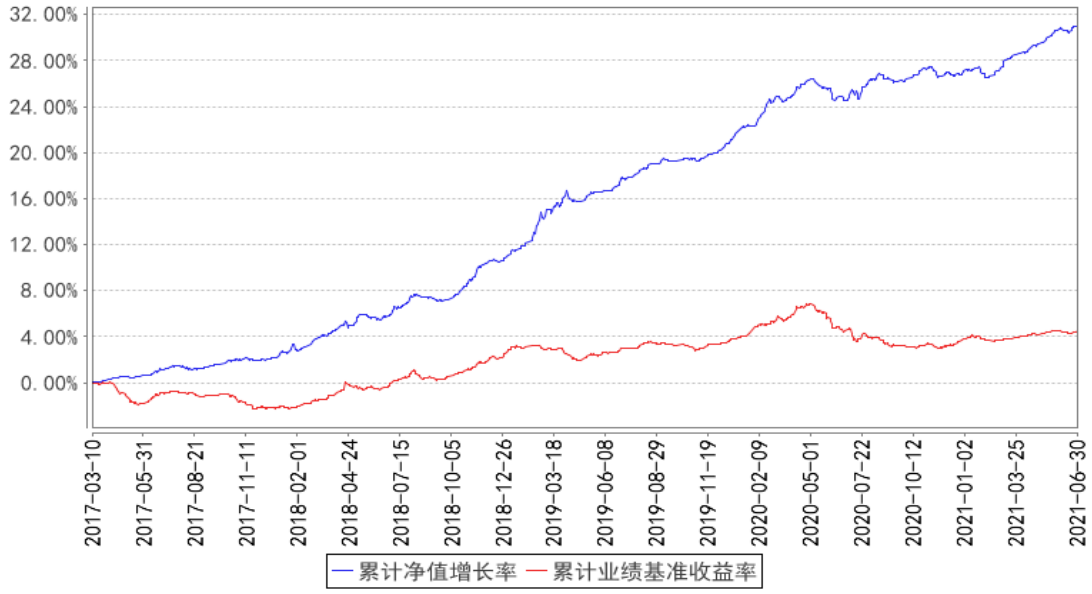
西部利得汇享债券 C

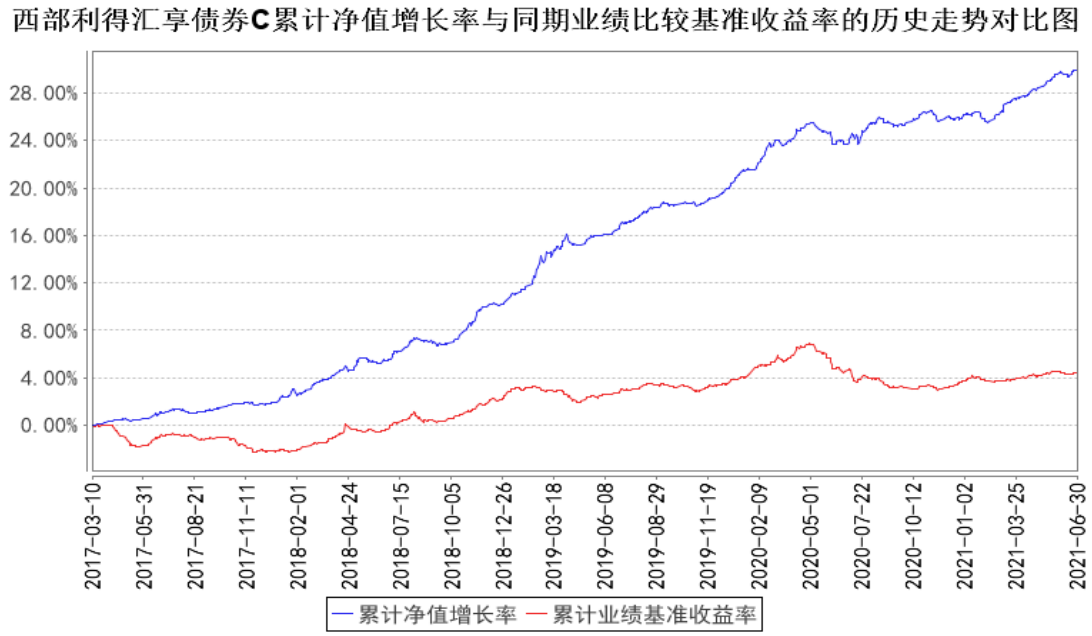
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	0.26%	0.06%	-0.04%	0.03%	0.30%	0.03%
过去三个月	1.80%	0.05%	0.45%	0.03%	1.35%	0.02%
过去六个月	2.99%	0.07%	0.65%	0.04%	2.34%	0.03%
过去一年	5.00%	0.08%	-0.20%	0.06%	5.20%	0.02%
过去三年	23.08%	0.09%	4.53%	0.07%	18.55%	0.02%
自基金合同生效起至今	29.92%	0.08%	4.46%	0.07%	25.46%	0.01%

注：本基金的业绩基准指数=中债综合指数收益率

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

西部利得汇享债券A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于 2010 年 7 月 20 日正式成立，公司总部设在上海，在北京、深圳设有分公司，注册资本人民币 35000.00 万元整，是经中国证监会批准设立的第 60 家全国规范性基金管理公司，自成立以来逐步成长为一家以绝对收益产品为特色的资产管理人。目前公司拥有公募基金、特定客户资产管理业务、受托管理保险资金等资格。

公司在“绝对收益”领域采取稳步推进策略，已发展为一家以固收+和量化指数投资为特色、以主动管理权益和混合资产投资为驱动的多元化资产管理公司。致力成为行业基础产品供应商。西部利得基金始终将投资人利益放首位，为投资人提供多样化的资产配置解决方案。

公司一直坚持“专业、诚信”的经营理念，成立至今已发行了货币型、债券型、混合型、指数型、股票型等多种类型的基金产品共 49 只，形成了较为完善的产品线，满足不同风险偏好的投资者需求。

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		
严　志	公募固定	2017 年 8	-	10 年	复旦大学经济学硕士，曾任上海强生有限

勇	收益部总经理、基金经理	月 9 日			公司管理培训生、中国国际金融股份有限公司研究员、中证指数有限公司研究员、兴业证券股份有限公司研究员、鑫元基金管理有限公司债券研究主管。2017 年 5 月加入本公司，具有基金从业资格，中国国籍。
李 安然	基金经理	2021 年 4 月 21 日	-	6 年	英国兰卡斯特大学计量金融学硕士，曾任中信建投湖北分公司量化研究员、前海财险固定收益部投资经理。2017 年 7 月加入本公司，具有基金从业资格证，中国国籍。
李 安然	基金经理助理	2019 年 7 月 23 日	2021 年 4 月 7 日	6 年	英国兰卡斯特大学计量金融学硕士，曾任中信建投湖北分公司量化研究员、前海财险固定收益部投资经理。2017 年 7 月加入本公司，具有基金从业资格证，中国国籍。

注：1.任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；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《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、本基金《基金合同》等法律文件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，力争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，并且交易占优比也没有明显异常，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

2021 年上半年国内债券市场整体呈震荡走势。一季度债市收益率整体冲高，主要原因在于春节前央行并未过多投放跨年资金，以及节后大宗商品价格上涨、全球交易再通胀，二季度随着货币政策维稳、资金面重回宽松，机构配置需求推动利率重归下行。

本基金在报告期内采用稳健积极的投资策略，参与了利率债波段交易，重点配置了中高等级信用债，并用部分仓位参与了可转债的投资交易。

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

展望后市，目前支撑经济的两大动能出口+房地产下半年都有走弱趋势。上半年出口数据整体表现亮眼，但随着海外疫情逐步控制，国内出口替代效应边际减弱。上半年地产投资显示出较强韧性，但在相关政策限制下，下半年地产销售及房企融资均面临较大压力，地产投资逐步走弱概率较大。经济出现边际下行压力叠加信用偏紧的背景下，货币政策预计仍以稳为主，降准释放的资金使得市场短期流动性较为充裕，下半年债市外部环境相对友好。此外，今年中央“强调财政纪律”的主基调使得地方债及城投债等供给均出现收缩，永煤违约事件后机构风险偏好降低加剧了债市供需力量的结构性失衡，关注微观交易结构改变对债市定价中枢的中长期影响。

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

本报告期，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、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：西部利得汇享债券型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	5,048,926.73	14,116,531.83
结算备付金		2,096,969.99	5,074,790.28
存出保证金		67,527.92	57,627.38
交易性金融资产	6.4.7.2	2,683,120,734.83	2,468,754,551.11

其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,683,120,734.83	2,468,754,551.11
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	10,830,136.25	-
应收证券清算款		2,362,341.28	3,864,864.94
应收利息	6.4.7.5	34,693,439.57	46,607,843.48
应收股利		-	-
应收申购款		29,058,087.61	1,421,011.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,767,278,164.18	2,539,897,220.19
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2021年6月30日**	**上年度末 2020年12月31日**
负 债：			
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		194,199,349.20	550,410,588.27
应付证券清算款		-	10,694,806.09
应付赎回款		9,887,412.43	11,572,811.82
应付管理人报酬		1,009,918.95	870,065.13
应付托管费		201,983.78	174,013.04
应付销售服务费		129,118.70	110,441.86
应付交易费用	6.4.7.7	20,579.21	22,210.08
应交税费		170,206.90	192,147.70
应付利息		49,666.84	115,427.74
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	224,765.25	200,307.55
负债合计		205,893,001.26	574,362,819.28
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,277,392,569.81	1,800,149,288.12
未分配利润	6.4.7.10	283,992,593.11	165,385,112.79
所有者权益合计		2,561,385,162.92	1,965,534,400.91
负债和所有者权益总计		2,767,278,164.18	2,539,897,220.19

注： 报告截止日2021年6月30日，西部利得汇享债券A基金份额净值1.1273元，基金份额总额 828,332,065.96 份；西部利得汇享债券 C 基金份额净值 1.1232 元，基金份额总额 1,449,060,503.85份。西部利得汇享债券份额总额合计为2,277,392,569.81份。

6.2 利润表

会计主体：西部利得汇享债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		71,693,318.63	49,379,772.31
1.利息收入		45,914,657.70	42,163,478.85
其中：存款利息收入	6.4.7.11	191,330.13	449,454.66
债券利息收入		45,498,556.02	40,580,123.11
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		224,771.55	1,133,901.08
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,677,918.08	23,890,284.96
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	5,677,918.08	23,890,284.96
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	19,810,079.73	-18,254,375.60
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	290,663.12	1,580,384.10
减：二、费用		11,457,129.31	10,311,433.47
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	5,046,818.81	5,963,080.35
2．托管费	6.4.10.2.2	1,009,363.81	1,192,616.05
3．销售服务费	6.4.10.2.3	657,873.78	879,677.73
4．交易费用	6.4.7.19	29,576.38	44,222.04
5．利息支出		4,461,576.60	2,007,881.24
其中：卖出回购金融资产支出		4,461,576.60	2,007,881.24
6．税金及附加		143,300.38	120,820.70
7．其他费用	6.4.7.20	108,619.55	103,135.36

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		60,236,189.32	39,068,338.84
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		60,236,189.32	39,068,338.84

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：西部利得汇享债券型证券投资基金

本报告期：2021年1月1日至2021年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021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）	1,800,149,288.12	165,385,112.79	1,965,534,400.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	60,236,189.32	60,236,189.32
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）	477,243,281.69	58,371,291.00	535,614,572.69
其中：1.基金申购款	1,421,795,352.40	159,132,298.44	1,580,927,650.84
2.基金赎回款	-944,552,070.71	-100,761,007.44	-1,045,313,078.15
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,277,392,569.81	283,992,593.11	2,561,385,162.92
项目	上年度可比期间 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）	1,051,199,929.19	45,763,021.54	1,096,962,950.73
二、本期经营活	-	39,068,338.84	39,068,338.84

动产生的基金净值变动数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,295,962,167.09	80,981,956.97	1,376,944,124.06
其中：1.基金申购款	3,882,655,516.77	266,445,903.38	4,149,101,420.15
2.基金赎回款	-2,586,693,349.68	-185,463,946.41	-2,772,157,296.09
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）	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,347,162,096.28	165,813,317.35	2,512,975,413.63

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：

贺燕萍	贺燕萍	张皞骏
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

西部利得汇享债券型证券投资基金(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]1846 号《关于准予西部利得汇享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《西部利得汇享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348,408,799.23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1700236号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《西部利得汇享债券型证券投资基金基金合同》于2017年3月10日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为348,473,801.85份基金份额，其中认购资金利息折合65,002.62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，基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《西部利得汇享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固定收益类金融工具，包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债券、短期融资券、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。本基金不直接购买股票、权证，但可持有因可转换债券转股所形成的股票和因投资分离交易可转债所形成的权证。因上述原因持有的股票和权证等资产，基金将在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，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：中债综合指数收益率。

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 2021 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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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

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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》(财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号)、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。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20%的个人所得税。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，其股息红利所得暂减按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。

(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 2021年6月30日
活期存款	5,048,926.73
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	5,048,926.73

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 2021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	686,138,325.83	684,560,634.83	-1,577,691.00
	银行间市场	1,997,266,961.28	1,998,560,100.00	1,293,138.72

	合计	2,683,405,287.11	2,683,120,734.83	-284,552.28
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,683,405,287.11	2,683,120,734.83	-284,552.28

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末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 2021 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	10,830,136.25	-
合计	10,830,136.25	-

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 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,756.01
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	943.70
应收债券利息	34,688,312.49
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	1,396.97
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	30.40
合计	34,693,439.57

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 2021 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	20,579.21
合计	20,579.21

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,245.70
应付证券出借违约金	-
预提费用	223,519.55
合计	224,765.25

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

西部利得汇享债券 A

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	650,853,320.23	650,853,320.23
本期申购	434,418,951.28	434,418,951.28
本期赎回（以“-”号填列）	-256,940,205.55	-256,940,205.55
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	828,332,065.96	828,332,065.96

西部利得汇享债券 C

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,149,295,967.89	1,149,295,967.89
本期申购	987,376,401.12	987,376,401.12
本期赎回（以“-”号填列）	-687,611,865.16	-687,611,865.16
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,449,060,503.85	1,449,060,503.85

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

西部利得汇享债券A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	43,018,333.37	18,213,081.96	61,231,415.33
本期利润	14,062,175.89	6,492,500.95	20,554,676.84
本期基金份额交易产生的变动数	15,965,797.65	7,709,700.28	23,675,497.93
其中：基金申购款	34,105,387.10	15,233,385.25	49,338,772.35
基金赎回款	-18,139,589.45	-7,523,684.97	-25,663,274.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	73,046,306.91	32,415,283.19	105,461,590.10

西部利得汇享债券C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	72,114,997.24	32,038,700.22	104,153,697.46
本期利润	26,363,933.70	13,317,578.78	39,681,512.48
本期基金份额交易产生的变动数	23,555,426.85	11,140,366.22	34,695,793.07
其中：基金申购款	74,553,138.29	35,240,387.80	109,793,526.09
基金赎回款	-50,997,711.44	-24,100,021.58	-75,097,733.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	122,034,357.79	56,496,645.22	178,531,003.01

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	139,322.84
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	32,413.33
其他	19,593.96
合计	191,330.13

注：其他包括结算保证金利息收入和申购款利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

本基金于本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金在本报告期内未持有股票。

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无股票出借差价收入。

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 2021年1月1日至2021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	5,677,918.08
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	5,677,918.08

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 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,335,747,756.68
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,315,408,447.42
减：应收利息总额	14,661,391.18
买卖债券差价收入	5,677,918.08

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期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

本基金于本报告期未持有股票，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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	19,810,079.73
股票投资	-

债券投资	19,810,079.73
资产支持证券投资	-
基金投资	-
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增值税	-
合计	19,810,079.73

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	209,393.35
基金转换费收入	81,269.77
合计	290,663.12

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	16,068.88
银行间市场交易费用	13,507.50
合计	29,576.38

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	14,100.00
其他	300.00
合计	108,619.55

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
平安银行股份有限公司	基金托管人
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

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日

	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
西部证券	772,943,408.61	92.81	1,234,423,648.35	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）
西部证券	2,963,000,000.00	100.00	2,664,100,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,046,818.81	5,963,080.35
其中：支付销售机构的客户维护费	800,404.19	1,653,070.38

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 0.50%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×0.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

当期发生的基金应支付的托管费	1,009,363.81	1,192,616.05

注：注：支付基金托管人平安银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%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×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	西部利得汇享债券 A	西部利得汇享债券 C	合计
平安银行	-	2,562.04	2,562.04
西部利得基金	-	379,318.36	379,318.36
西部证券	-	5,377.57	5,377.57
合计	-	387,257.97	387,257.97
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	西部利得汇享债券 A	西部利得汇享债券 C	合计
平安银行	0.00	10,857.41	10,857.41
西部利得基金	0.00	291,226.51	291,226.51
西部证券	0.00	15,312.95	15,312.95
合计	0.00	317,396.87	317,396.87

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 0.1%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×0.1%/ 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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期未与关联方进行转融通证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期未与关联方进行转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 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无除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金的情况。

6.4.10.6 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
平安银行股份有限公司	5,048,926.73	139,322.84	8,566,646.19	351,570.82

注：1.本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2021 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021 年 6 月 17 日	2021 年 7 月 1 日	新债未上市	100.00	100.00	7,210	721,000.00	721,000.00	-

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

截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 167,199,349.20 元，是以如下债券作为质押：

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
102000116	20 广新控股 MTN001	2021 年 7 月 5 日	100.18	260,000	26,046,800.00
102002098	20 武金控 MTN001	2021 年 7 月 5 日	102.64	300,000	30,792,000.00
200309	20 进出 09	2021 年 7 月 5 日	100.04	300,000	30,012,000.00
200314	20 进出 14	2021 年 7 月 5 日	100.21	900,000	90,189,000.00
合计				1,760,000	177,039,800.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 27,000,000.00 元，于 2021 年 7 月 5 日和 2021 年 7 月 7 日到期。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

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等级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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	96,060,800.00	50,049,000.00
A-1以下	-	-
未评级	210,536,000.00	200,188,000.00
合计	306,596,800.00	250,237,000.00

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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	963,254,092.72	897,581,655.00
AAA以下	1,051,231,512.26	1,048,959,896.11
未评级	362,038,329.85	271,976,000.00
合计	2,376,523,934.83	2,218,517,551.11

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。

6.4.13.3 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 2021 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	5,048,926.73	-	-	-	5,048,926.73
结算备付金	2,096,969.99	-	-	-	2,096,969.99
存出保证金	67,527.92	-	-	-	67,527.92
交易性金融资产	738,673,749.83	1,684,309,800.00	260,137,185.00	-	2,683,120,734.83
买入返售金融资产	10,830,136.25	-	-	-	10,830,136.25
应收利息	-	-	-	34,693,439.57	34,693,439.57
应收申购款	-	-	-	29,058,087.61	29,058,087.61
应收证券清算款	-	-	-	2,362,341.28	2,362,341.28
资产总计	756,717,310.72	1,684,309,800.00	260,137,185.00	66,113,868.46	2,767,278,164.18
负债					
应付赎回款	-	-	-	9,887,412.43	9,887,412.43
应付管理人报酬	-	-	-	1,009,918.95	1,009,918.95
应付托管费	-	-	-	201,983.78	201,983.78
卖出回购金融资产款	194,199,349.20	-	-	-	194,199,349.20
应付销售服务费	-	-	-	129,118.70	129,118.70
应付交易费用	-	-	-	20,579.21	20,579.21
应付利息	-	-	-	49,666.84	49,666.84
应交税费	-	-	-	170,206.90	170,206.90
其他负债	-	-	-	224,765.25	224,765.25
负债总计	194,199,349.20	-	-	11,693,652.06	205,893,001.26
利率敏感度缺口	562,517,961.52	1,684,309,800.00	260,137,185.00	54,420,216.40	2,561,385,162.92
上年度末 2020 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	14,116,531.83	-	-	-	14,116,531.83
结算备付金	5,074,790.28	-	-	-	5,074,790.28
存出保证金	57,627.38	-	-	-	57,627.38
交易性金融资产	533,624,081.11	1,753,301,470.00	181,829,000.00	-	2,468,754,551.11
应收利息	-	-	-	46,607,843.48	46,607,843.48
应收申购款	-	-	-	1,421,011.17	1,421,011.17
应收证券清算款	-	-	-	3,864,864.94	3,864,864.94

资产总计	552,873,030.60	1,753,301,470.00	181,829,000.00	51,893,719.59	2,539,897,220.19
负债					
应付赎回款	-	-	-	11,572,811.82	11,572,811.82
应付管理人报酬	-	-	-	870,065.13	870,065.13
应付托管费	-	-	-	174,013.04	174,013.04
应付证券清算款	-	-	-	10,694,806.09	10,694,806.09
卖出回购金融资产款	550,410,588.27	-	-	-	550,410,588.27
应付销售服务费	-	-	-	110,441.86	110,441.86
应付交易费用	-	-	-	22,210.08	22,210.08
应付利息	-	-	-	115,427.74	115,427.74
应交税费	-	-	-	192,147.70	192,147.70
其他负债	-	-	-	200,307.55	200,307.55
负债总计	550,410,588.27	-	-	23,952,231.01	574,362,819.28
利率敏感度缺口	2,462,442.33	1,753,301,470.00	181,829,000.00	27,941,488.58	1,965,534,400.91

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 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券。		
	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 （2021年6月30日）	上年度末 （2020 年 12 月 31 日 ）
分析	市场利率上升25个基点	-14,661,000.00	-15,547,000.00
	市场利率下降25个基点	14,816,000.00	15,731,000.00

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 2021年6月30日		上年度末 2020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	2,683,120,734.83	104.75	2,468,754,551.11	125.60
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	2,683,120,734.83	104.75	2,468,754,551.11	125.60

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2021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属于第一层级的余额为197400058.73元，属于第二层级的余额为2485720676.1元，无属于第三层级的余额（于2020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属于第一层级的余额为151825081.11元，属于第二层级的余额为2316929470.00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 2021 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	2,683,120,734.83	96.96
	其中：债券	2,683,120,734.83	96.96
	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	10,830,136.25	0.39
	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	7,145,896.72	0.26
8	其他各项资产	66,181,396.38	2.39
9	合计	2,767,278,164.18	100.00

7.2 报告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股票。

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

本基金本报告期内未持有股票。

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

本基金本报告期内未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未持有股票。

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	66,738,646.90	2.61
2	央行票据	-	-
3	金融债券	403,875,538.10	15.77
	其中：政策性金融债	403,875,538.10	15.77
4	企业债券	462,446,391.10	18.05
5	企业短期融资券	136,440,800.00	5.33
6	中期票据	1,415,498,300.00	55.26
7	可转债（可交换债）	198,121,058.73	7.73
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,683,120,734.83	104.75

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	170210	17 国开 10	900,000	93,024,000.00	3.63
2	200314	20 进出 14	900,000	90,189,000.00	3.52
3	102100521	21 广州地铁 MTN007	600,000	60,330,000.00	2.36
4	200012	20 附息国债 12	500,000	51,270,000.00	2.00
5	170405	17 农发 05	500,000	51,235,000.00	2.00

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

国债期货不在本基金投资范围内。

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

国债期货不在本基金投资范围内。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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

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是否超出基金合同规定的备选股票库

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	67,527.92
2	应收证券清算款	2,362,341.28
3	应收股利	-
4	应收利息	34,693,439.57
5	应收申购款	29,058,087.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	66,181,396.38

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110077	洪城转债	34,840,820.10	1.36
2	113612	永冠转债	13,835,800.00	0.54
3	128034	江银转债	12,624,000.00	0.49
4	128048	张行转债	12,604,000.00	0.49

5	128129	青农转债	9,355,272.42	0.37
6	113528	长城转债	9,021,480.00	0.35
7	113606	荣泰转债	8,448,496.00	0.33
8	113610	灵康转债	7,550,900.00	0.29
9	110067	华安转债	7,493,619.20	0.29
10	123078	飞凯转债	6,878,700.52	0.27
11	123048	应急转债	6,664,780.00	0.26
12	113601	塞力转债	5,885,260.00	0.23
13	128078	太极转债	5,765,000.00	0.23
14	128141	旺能转债	5,502,000.00	0.21
15	128049	华源转债	5,135,962.00	0.20
16	113524	奇精转债	4,684,950.00	0.18
17	113030	东风转债	4,631,760.00	0.18
18	123071	天能转债	4,070,850.00	0.16
19	110073	国投转债	3,769,850.00	0.15
20	123002	国祯转债	3,059,865.60	0.12
21	123076	强力转债	3,034,068.73	0.12
22	128140	润建转债	2,648,640.00	0.10
23	113043	财通转债	2,560,560.00	0.10
24	123068	弘信转债	2,494,784.16	0.10
25	113600	新星转债	2,472,250.00	0.10
26	123075	贝斯转债	2,141,918.07	0.08
27	113516	苏农转债	1,783,138.50	0.07
28	123049	维尔转债	1,382,765.20	0.05
29	113012	骆驼转债	1,254,200.00	0.05
30	123010	博世转债	630,569.80	0.02
31	128064	司尔转债	600,900.00	0.02
32	128107	交科转债	294,197.60	0.01

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期内未持有股票。

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	持有人户数	户均持有的基金份	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

级别	（户）	额	持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
西部利得汇享债券A	9,136	90,666.82	662,890,843.71	80.03	165,441,222.25	19.97
西部利得汇享债券C	24,137	60,034.82	1,021,780,037.44	70.51	427,280,466.41	29.49
合计	32,746	69,547.20	1,684,670,881.15	73.97	592,721,688.66	26.03

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	西部利得汇享债券 A	430,762.36	0.0520
	西部利得汇享债券 C	491,103.03	0.0339
	合计	921,865.39	0.0405

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金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）。

8.3 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	西部利得汇享债券 A	-
	西部利得汇享债券 C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	西部利得汇享债券 A	0~10
	西部利得汇享债券 C	0~10
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	西部利得汇享债券 A	西部利得汇享债券 C
基金合同生效日（2017 年 3 月 10 日）基金份额总额	20,859,108.26	327,614,693.59
本报告期期初基金份额总额	650,853,320.23	1,149,295,967.89
本报告期基金总申购份额	434,418,951.28	987,376,401.12
减：本报告期基金总赎回份额	256,940,205.55	687,611,865.16
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	828,332,065.96	1,449,060,503.85

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

基金管理人于 2021 年 1 月 7 日对外发布了公司董事及独立董事变更公告，董事长为何方先生、股东董事为李兴春先生、曲莉女士，当然董事为贺燕萍女士，独立董事为张成虎先生、吴弘先生；于 2021 年 1 月 11 日对外发布了公司高级管理人员变更公告，任命王宇、孙威、蔡

晨研为公司副总经理。

本报告期内，基金托管人员变动如下：

2021 年 1 月 26 日，根据工作安排，陈正涛先生不再担任平安银行股份有限公司资产托管事业部总裁。2021 年 2 月 26 日，平安银行股份有限公司任命黄伟先生担任资产托管事业部副总裁（主持工作）。

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	
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

注：1.基金租用席位的选择标准是： (1)资力雄厚，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
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	772,943,408.61	92.81%	2,963,000,000.00	100.00%	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	59,906,400.00	7.19%	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	基金管理人住所变更公告西部利得基金管理有限公司	基金管理人公司网站、中国证监会基金电子披露网站及本基金选定的信息披露报纸	2021 年 07 月 02 日

§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

截止本报告期末，本基金未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

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——上海市浦东新区耀体路276号晶耀商务广场3号楼9层

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

2021年8月30日