西部利得天添益货币市场基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:西部利得基金管理有限公司
基金托管人:宁波银行股份有限公司
送出日期:二〇一八年八月二十八日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018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2018年1月1日起至6月30日止。

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

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	西部利得天添益货币	
场内简称	–	
基金主代码	675131	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年8月1日	
基金管理人	西部利得基金管理有限公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	25,595,109.28份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	–	
上市日期	–	
下属分级基金的基金简称:	西部利得天添益货币A	西部利得天添益货币B
下属分级基金场内简称:	–	–
下属分级基金的交易代码:	675131	675132
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	8,527,392.28份	17,067,717.00份

2.2 基金产品说明

投资目标	在满足安全性、流动性的基础上,力求实现稳定的投资收益。	
投资策略	在确定总体流动性要求的基础上,根据不同投资品种的流动性、预期收益率、信用水平来确定投资比例,构建投资组合,并定期对投资组合的剩余期限和投资比例调整优化。 1.利率策略 在综合分析宏观经济状况基础上,判断宏观经济趋势,预期未来一段时间的利率水平。同时深入研究央行的货币政策,央行的货币政策是影响货币市场利率的最直接因素。在央行紧缩货币、提高基准利率时,市场利率一般会相应上升;而央行放松货币、降低基准利率时,市场利率则相应下降。 2.信用债券投资策略 深入分析企业的发展前景和财务稳健性,判断发行人违约的可能性,严格控制信用债券的违约风险。在此基础上,选择发展趋势向好、违约可能性较小、具有相对投资价值的投资品种进行投资。 3.久期控制策略 本基金根据对利率趋势的判断来确定基金资产的久期。在预期利率上升时,缩短基金资产的久期,以规避资本损失或获取较高的收益;在预期利率下降时,延长基金资产的久期,以获取资本利得或锁定较高的收益。 4.套利策略 套利策略包括跨市场套利和跨品种套利。跨市场套利是利用同一金融工具在各个子市场的不同表现进行套利。跨品种套利是利用不同金融工具的收益率差别,在满足基金自身流动性、安全性需要的基础上寻求更高的收益率。 5.回购策略 在有效控制风险的条件下,本基金将密切跟踪不同市场和不同期限之间的利率差异,在精确投资收益测算的基础上,积极采取回购杠杆操作,为基金资产增加收益。同时,密切关注央行公开市场操作、季节因素、日历效应、IPO发行等因素导致短期资金需求激增的机会,通过逆回购融出资金以把握短期资金利率陡升的投资机会。 6.流动性管理策略 对市场资金面的变化(如季节性资金流动、日历效应等)及本基金申购/赎回变化的动态预测,通过现金库存管理、回购滚动操作、债券品种的期限结构安排及资产变现等措施,实现对基金资产的结构化管理。在保证满足基金投资人申购、赎回的资金需求的前提下,获取稳定的收益。 7.资产支持证券投资策略 本基金将采用基本面分析和数量化分析相结合的方法,对资产支持证券的基础资产质量和未来现金流进行分析,估算投资品种的风险和收益,选取具有相对投资价值的投资品种进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。 8.其他金融工具投资策略 本基金将密切跟踪银行承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品的动向,一旦监管机构允许基金参与此类金融工具的投资,本基金将在届时相应法律法规的框架内,根据对该金融工具的研究,制定符合本基金投资目标的投资策略,在充分考虑该投资品种风险和收益特征的前提下谨慎投资。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为同期七天通知存款利率(税后)。	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金低风险水平的投资品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。	
	西部利得天添益货币A	西部利得天添益货币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	宁波银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵毅	王海燕
	联系电话	021-38572888	0574-89103171
	电子邮箱	service@westleadfund.com	wanghaiyan@nbcb.cn
客户服务电话		4007-007-818;021-38572666	95574
传真		021-38572750	0574-89103213

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

基金级别	西部利得天添益货币A	西部利得天添益货币B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	70,548.05	7,411,278.95
本期利润	70,548.05	7,411,278.95
本期净值收益率	2.9483%	3.0739%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
期末基金资产净值	8,527,392.28	17,067,717.00
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

金额单位:人民币元

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

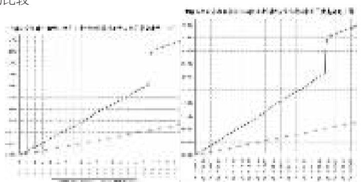
西部利得天添益货币A

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	0.1992%	0.0039%	0.1110%	0.0000%	0.0882%	0.0039%
过去三个月	1.9820%	0.0909%	0.3371%	0.0000%	1.6449%	0.0909%
过去六个月	2.9483%	0.0646%	0.6717%	0.0000%	2.2766%	0.0646%
自基金合同生效起至今	4.6407%	0.0476%	1.2430%	0.0000%	3.3977%	0.0476%

西部利得天添益货币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	0.2194%	0.0039%	0.1110%	0.0000%	0.1084%	0.0039%
过去三个月	2.0441%	0.0909%	0.3371%	0.0000%	1.7070%	0.0909%
过去六个月	3.0739%	0.0645%	0.6717%	0.0000%	2.4022%	0.0645%
自基金合同生效起至今	4.8782%	0.0475%	1.2430%	0.0000%	3.6352%	0.0475%

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



§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2018年6月30日,本基金管理人旗下共管理29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	本基金基金经理	2017年8月1日	–	五年	英国曼彻斯特大学理学硕士。曾任中德安联人寿保险有限公司交易员、华泰柏瑞基金管理有限公司交易员。2016年11月加入本公司,具有基金从业资格,中国国籍。

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

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年在宏观去杠杆的目标下,投资动能一定程度上有所削弱。贸易战持续,保护主义倾向抬升,全球贸易和经济前景不确定性加大。国内经济下行压力仍较大。非标融资规模不断萎缩,表内融资受制于资本金、监管指标等因素增长有限。信用扩张受限抑制实体经济融资。5月以来,信用事件不断爆发,债券发行量大减,信用条件恶化对企业的再融资通道形成冲击,融资环境收紧、财务成本上升、企业盈利恶化与违约预期相互强化形成正反馈,可能导致实体企业融资的剧烈收缩,从而造成基本面进一步的下行压力。从大类资产配置角度,看好利率债和高等级信用债的投资价值。

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,主要投资存款、同业存单和逆回购,在保证资产良好流动性的前提下,力争收益的最大化,并适度使用杠杆套利操作提高收益。

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,宏观数据大概率遵循稳中有降的趋势。首先,外贸战对经济的负面作用将会逐步体现,出口数据加速下降拖累经济;其次,房地产调控大环境下,房地产投资这个上半年推动宏观的主要动力即将进一步加速;第三,出于防风险的考虑,财政政策目前看并不十分积极,即使后期有所加强,也仅仅起"托底"的作用,想象空间不大。在经济走弱,货币政策重归宽松的趋势下,债券市场特别是利率债有望继续受益,但信用收缩仍然在继续,故中低等级信用债投资仍须谨慎。

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

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

4.8报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,本基金触发连续二十个工作日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:西部利得天添益货币市场基金

报告截止日: 2018年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:			
银行存款		5,848,033.39	114,379,930.84
结算备付金		–	56,831.54
存出保证金		677.60	2,215.42
交易性金融资产		9,990,200.93	140,603,483.52
其中:股票投资		–	–
基金投资		–	–
债券投资		9,990,200.93	140,603,483.52
资产支持证券投资		–	–
贵金属投资		–	–
衍生金融资产		–	–
买入返售金融资产		9,800,124.90	262,184,661.28
应收证券清算款		–	–
应收利息		5,364.90	1,875,177.23
应收股利		–	–
应收申购款		17,200.00	20,738.00
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		25,661,601.72	519,123,037.83
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负 债:			
短期借款		–	–
交易性金融负债		–	–
衍生金融负债		–	–
卖出回购金融资产款		–	–
应付证券清算款		–	–
应付赎回款		–	–
应付管理人报酬		7,312.20	193,762.29
应付托管费		1,107.88	29,357.93
应付销售服务费		2,176.61	6,025.76
应付交易费用		9,571.25	12,744.19
应交税费		–	–
应付利息		–	–
应付利润		2,706.41	100,106.15
递延所得税负债		–	–
其他负债		43,618.09	127,000.00
负债合计		66,492.44	468,996.32
所有者权益:			
实收基金		25,595,109.28	518,654,041.51
未分配利润		–	–
所有者权益合计		25,595,109.28	518,654,041.51
负债和所有者权益总计		25,661,601.72	519,123,037.83

注:报告截止日2018年6月30日,A类基金和B类基金的份额净值1.0000元,基金份额总额25,595,109.28份, 其中A类基金份额8,527,392.28份,B类基金份额17,067,717.00份。

6.2 利润表

会计主体:西部利得天添益货币市场基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		8,340,216.53	–
1.利息收入		8,276,925.07	–
其中:存款利息收入		1,829,391.01	–
债券利息收入		3,470,518.81	–
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		2,977,015.25	–
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)		59,778.90	–
其中:股票投资收益		–	–
基金投资收益		–	–
债券投资收益		59,778.90	–
资产支持证券投资收益		–	–
贵金属投资收益		–	–
衍生工具收益		–	–
股利收益		–	–
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		–	–
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)		3,512.56	–
减:二、费用		858,389.53	–
1. 管理人报酬		623,042.12	–
2. 托管费		94,400.26	–
3. 销售服务费	6.4.9.2.3	25,109.61	–
4. 交易费用		–	–
5. 利息支出		59,619.45	–
其中:卖出回购金融资产支出		59,619.45	–
6. 其他费用		56,218.09	–
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		7,481,827.00	–
减:所得税费用		–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		7,481,827.00	–

注:本基金无上年度可比数据 。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:西部利得天添益货币市场基金

本报告期:2018年1月1日 至 2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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)	518,654,041.51	–	518,654,041.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	7,481,827.00	7,481,827.00
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)	-493,058,932.23	–	-493,058,932.23
其中:1.基金申购款	692,562,057.20	–	692,562,057.20
2.基金赎回款	-1,185,620,989.43	–	-1,185,620,989.43
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)	–	-7,481,827.00	-7,481,827.00
五、期末所有者权益(基金净值)	25,595,109.28	–	25,595,109.28
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	–	–	–
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	–	–
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)	–	–	–
其中:1.基金申购款	–	–	–
2.基金赎回款	–	–	–
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)	–	–	–

注:本基金无上年度可比数据 。

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

西部利得天添益货币市场基金 (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")《关于准予西部利得天添益货币市场基金注册的批复》(证监许可[2016] 2479号) 批准,由西部利得基金管理有限公司(以下简称"西部利得基金公司")依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规以及《西部利得天添益货币市场基金基金合同》发售,基金合同于2017年8月1日生效。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集规模为300,647,108.23份基金份额。本基金的基金管理人为西部利得基金公司,基金托管人为宁波银行股份有限公司(以下简称"宁波银行")。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《西部利得天添益货币市场基金基金合同》和《西部利得天添益货币市场基金招募说明书》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同期七天通知存款利率(税后) 。

本财务报表由本基金的基金管理人西部利得基金管理有限公司批准于2018年8月28日报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《西部利得天添益货币市场基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

此外本财务报表同时符合如财务报表附注6.4.2所列示的其他有关规定的要求。

6.4.4 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变更。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易为目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具 (主要为权证投资) 分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2) 该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3) 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。

当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金投资人可选择现金红利或将现金红利按除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

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]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)证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(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)运营基金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。对基金在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、债券收入免征增值税。

(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)对基金取得的股票的股息、红利收入,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,股权登记日为自2013年1月1日起至2015年9月7日期间的,暂减按25%计入应纳税所得额,股权登记日在2015年9月8日及以后的,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(包括个人和机构投资者)从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,按照证券投资基金管理人所在地适用的城市维护建设税税率,计算缴纳城市维护建设税。

(h)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费率计算缴纳教育费附加、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 2018年6月30日
活期存款	5,848,033.39
定期存款	–
其中:存款期限1-3个月	–
其他存款	–
合计:	5,848,033.39

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目		本期末 2018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	9,990,200.93	9,989,000.00	-1,200.93	-0.0047%
	合计	9,990,200.93	9,989,000.00	-1,200.93	-0.0047%

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位:人民币元

项目	本期末 2018年6月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	–	–	–	
货币衍生工具	–	–	–	
权益衍生工具	–	–	–	
其他衍生工具	–	–	–	
合计	–	–	–	

本基金于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 2018年6月30日	
	账面余额	其中;买断式逆回购
合计	9,800,124.90	–

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

金额单位:人民币元

项目	本期末 2018年6月30日						
	债券代码	债券名称	约定返售日	估值单价	数量(张)	估值总额	其中:已出售或再质押总额
合计					–	–	–

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 2018年6月30日
应收活期存款利息	1,688.96
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	–
应收买入返售证券利息	3,675.64
应收申购款利息	–
应收黄金合约拆借孳息	–
其他	0.30
合计	5,364.90

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 2018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	9,571.25
合计	9,571.25

6.4.7.8 其他负债

单位:人民币元

项目	本期末 2018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	43,618.09
合计	43,618.09

6.4.7.9 实收基金

金额单位:人民币元

西部利得天添益货币A		
项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,210,749.89	1,210,749.89
本期申购	44,371,382.93	44,371,382.93
本期赎回(以"-"号填列)	-37,054,740.54	-37,054,740.54
- 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	8,527,392.28	8,527,392.28
西部利得天添益货币B		
项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	517,443,291.62	517,443,291.62
本期申购	648,190,674.27	648,190,674.27
本期赎回(以"-"号填列)	-1,148,566,248.89	-1,148,566,248.89
- 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	17,067,717.00	17,067,717.00

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

西部利得天添益货币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	70,548.05	–	70,548.05
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	-70,548.05	–	-70,548.05
本期末	–	–	–

西部利得天添益货币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	7,411,278.95	–	7,411,278.95
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	-7,411,278.95	–	-7,411,278.95
本期末	–	–	–

6.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	57,269.86
定期存款利息收入	1,745,680.57
其他存款利息收入	–
结算备付金利息收入	196.36
其他	26,244.22
合计	1,829,391.01

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 2018年1月1日至2018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	59,778.90
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	59,778.90

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 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	895,902,704.42
减:卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	894,411,435.66
减:应收利息总额	1,431,489.86
买卖债券差价收入	59,778.90

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

本基金本报告期无公允价值变动收益。

6.4.7.18 其他收入

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	–
其他	3,512.56
合计	3,512.56

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

本基金本报告期无交易费用。

6.4.7.20 其他费用

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	15,912.71
信息披露费	23,206.38
债券账户维护费	16,500.00
其他	600.00
合计	56,218.09

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 关联方关系

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.9.1.2 债券交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.9.1.3 债券回购交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.9.1.4 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期末有应支付关联方的佣金。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	623,042.12	–
其中:支付销售机构的客户维护费	27,888.15	–

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。

本基金无上年度可比期间。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	94,400.26	–

注:支付基金托管人宁波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。

本基金无上年度可比期间。

6.4.9.2.3 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 2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	西部利得天添益货币A	西部利得天添益货币B	合计
西部利得基金	1,302.95	16,602.96	17,905.91
宁波银行	215.50	–	215.50
西部证券	622.00	–	622.00
合计	2,140.45	16,602.96	18,743.41
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	西部利得天添益货币A	西部利得天添益货币B	合计

注:支付基金销售机构的销售服务费为

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。

3.本基金无上年度可比期间。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
宁波银行股份有限公司	29,911,656.67	49,475,180.00	–	–	–	–
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

注:本基金无上年度可比期间。

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	西部利得天添益货币A	西部利得天添益货币B
基金合同生效日(2017年8月1日)持有的基金份额	–	0.00
期初持有的基金份额	–	0.00
期间申购/买入总份额	–	17,065,876.54
期间因拆分变动份额	–	–
减:期间赎回/卖出总份额	–	–
期末持有的基金份额	–	17,065,876.54
期末持有的基金份额占基金总份额比例	–	66.6763%
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	西部利得天添益货币A	西部利得天添益货币B
基金合同生效日(2017年8月1日)持有的基金份额	–	–
期初持有的基金份额	–	–
期间申购/买入总份额	–	–
期间因拆分变动份额	–	–
减:期间赎回/卖出总份额	–	–
期末持有的基金份额	–	–
期末持有的基金份额占基金总份额比例	–	–

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.5 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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
宁波银行股份有限公司	5,848,033.39	57,269.86	–	–

注:1.本基金的银行存款由基金托管人宁波银行股份有限公司保管,按银行同业利率计息。

2.本基金通过"宁波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2018年6月30日的相关余额为0元。

3.本基金无上年度可比期间。

6.4.9.6 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 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未因认购新发/增发而持有流通受限证券。

6.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持暂时停牌股票。

6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	9,990,200.93	38.93
	其中:债券	9,990,200.93	38.93
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	9,800,124.90	38.19
	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	5,848,033.39	22.79
4	其他各项资产	23,242.50	0.09
5	合计	25,661,601.72	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.46	
	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	–	–
	其中:买断式回购融资	–	–

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

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的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	5
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	38
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	2

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	100.17	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天(含)—60天	–	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)—90天	–	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天(含)—120天	–	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	120天(含)—397天(含)	–	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
	合计	100.17	–

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	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	同业存单	9,990,200.93	39.03
8	其他	–	–
9	合计	9,990,200.93	39.03
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	111780875	17杭州银行CD134	100,000	9,990,200.93	39.03

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	0.2257%
报告期内偏离度的最低值	-0.0262%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0159%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内本基金不存在负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本报告期内本基金不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

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

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

7.9.2

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	677.60
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	5,364.90
4	应收申购款	17,200.00
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	23,242.50

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
西部利得天添益货币A	640	13,324.05	3,010,765.43	35.31%	5,516,626.85	64.69%
西部利得天添益货币B	1	17,067,717.00	17,067,717.00	100.00%	0.00	0.00%
合计	641	39,929.97	20,078,482.43	78.45%	5,516,626.85	21.55%

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)。

8.3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	基金类机构	17,065,876.54	66.68
2	基金类机构	3,010,461.06	11.76
3	个人	1,001,119.26	3.91
4	个人	500,342.82	1.96
5	个人	435,155.18	1.70
6	个人	401,339.42	1.57
7	个人	270,941.52	1.06
8	个人	233,503.55	0.91
9	个人	200,479.60	0.78
10	个人	190,512.93	0.74

8.4 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	西部利得天添益货币A	20,326.16	0.2384%
	西部利得天添益货币B	0.00	0.0000%
	合计	20,326.16	0.0794%

8.5 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	西部利得天添益货币A	0
	西部利得天添益货币B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	西部利得天添益货币A	0
	西部利得天添益货币B	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位:份

	西部利得天添益货币A	西部利得天添益货币B
基金合同生效日(2017年8月1日)基金份额总额	44,042,167.23	256,604,941.00
本报告期期初基金份额总额	1,210,749.89	517,443,291.62
本报告期基金总申购份额	44,371,382.93	648,190,674.27
减:本报告期基金总赎回份额	37,054,740.54	1,148,566,248.89
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	8,527,392.28	17,067,717.00

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

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金进行审计。

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	
中银国际证券有限责任公司	2	–	–	–	–	–
西藏东方财富证券股份有限公司	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
中银国际证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
西藏东方财富证券股份有限公司	6,167,837.81	100.00%	959,492,000.00	100.00%	–	–

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期末未发生偏离度绝对值超过0.5%的情况。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	1-3个月	–	17,065,876.54	–	17,065,876.54	66.68%
个人	–	–		–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
产品特有风险							
本基金为货币市场基金,其主要风险包括但不限于:利率风险、信用风险、流动性风险、操作风险等。							

11.2影响投资者决策的其他重要信息

无。

西部利得基金管理有限公司

2018年8月28日