证券代码:002630　证券简称:华西能源　公告编号:2017-003

华西能源工业股份有限公司关于签订日常经营重大合同的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、合同签署概况

华西能源工业股份有限公司(以下简称“华西能源”或“公司”)于2017年1月18日与宜宾市翠屏区住房和城乡规划建设局(以下简称“实施机构”)、四川星星建设集团有限公司(以下简称“四川星星建设”)签订了“宜宾市滨水文化特色街区滨江路道路管网、绿化工程和旧州塔城市绿地工程建设PPP项目”(以下简称“项目”或“PPP项目”)合同,项目总投资76,738万元、约占公司2015年度经审计营业总收入的20.74%

公司与交易对方之间不存在关联关系,本次合同签订不涉及关联交易。

上述合同为公司日常经营重大合同,根据《公司章程》等相关条款的规定,合同签订和执行无需公司董事会或股东大会审议批准。

二、交易对手方介绍

1、基本情况

(1)单位名称:宜宾市翠屏区住房和城乡规划建设局

住址:宜宾市翠屏区岷江新区兴盛路龙泉苑小区3幢

(2)单位名称:四川星星建设集团有限公司

法定代表人:匡建华

注册资本:12,600万元

主营业务:土木工程建筑、公路工程、输变电工程、水利工程、市政公用工程;桥涵、线路、管道、设备安装;建筑装饰、装修;园林古建筑工程;钢结构工程、化工石油工程;预制件生产;土地整理;农业资源开发;对外承包工程业务等。

住所:华蓥市渠水路28号

公司与宜宾市翠屏区住房和城乡规划建设局、四川星星建设集团有限公司之间不存在关联关系。

2、最近一个会计年度,公司与宜宾市翠屏区住房和城乡规划建设局、四川星星建设集团有限公司之间曾发生类似业务:2016年12月27日,三方签订了“宜宾市滨水文化特色街区D、E地块市政基础设施、综合管廊和翠屏区岷江路小学迁建PPP项目”,工程建设投资估算约65,964万元。

3、履约能力分析:

宜宾市翠屏区住房和城乡规划建设局受宜宾市翠屏区政府授权,负责项目招标、与中标社会资本签订PPP合同、授予项目公司特许经营权、对项目公司特许经营全过程实施监管等工作,为本项目的实施机构,具有较强的履约能力。

华西能源是本次PPP项目社会资本及项目投资建设的牵头人,四川星星建设集团有限公司是本次PPP项目社会资本及项目投资建设的参与方。

四川星星建设拥有房屋建筑工程施工总承包一级资质、市政公用工程施工总承包一级资质,具有较强的履约能力。

三、合同的主要内容

1、项目概况

(1)项目名称:宜宾市滨水文化特色街区滨江路道路管网、绿化工程和旧州塔城市绿地工程建设PPP项目。

(2)项目背景:

本项目为翠屏区持续推动新型工业化、新型城镇化发展的基础工程,对加强城市建设、提升城市品位、保护历史文化、促进精神文明建设和地方经济发展、创造优美舒适的人居生态环境等方面均具有重要作用。

(3)建设内容:

主要包括宜宾市滨水文化特色街区滨江路道路管网建设工程、宜宾市滨水文化特色街区滨江路绿化建设工程、滨水文化特色街区旧州塔城市绿地项目,及配套基础设施建设。

(4)运作方式:项目采用BOT(建设-经营-移交)模式实施,由宜宾市翠屏区住房和城乡规划建设局与华西能源、四川星星建设签订PPP项目合同后,华西能源再与相关方共同协商合资组建项目公司;由项目公司按照有关法规要求作为本项目实施主体,承担项目融资、建设、特许经营和维护、移交等工作。

2、项目合作期限:自PPP项目合同生效之日起,拟合作期限20年。其中建设期3年、运营期17年。

3、合同价格:项目建设投资总额76,738万元、约占公司2015年度经审计营业总收入的20.74%。

4、合同签订时间:2017年1月18日

5、合同生效主要条件:(1)宜宾市翠屏区人民政府常务会批准、双方签字盖章。(2)项目公司已依法成立,注册资金已按股东合同约定全部到位。(3)华西能源、四川星星建设已按本合同约定提交建设期履约保证金。(4)项目建设融资全部文件已签署和准备完毕,融资文件要求的必备条件已得到满足或被豁免。(5)华西能源、四川星星建设已按本合同约定购买相关保险。

6、回报方式:

项目公司完成工程投资、建设并经验收合格,对配套设施进行特许经营,项目公司获得政府按约定期限和比例支付的工程建设费用,以及运营管理、维护服务等投资回报。

四、合同对上市公司的影响

1、本次合同是公司再次承接以PPP模式运作的重大工程项目,有利于公司积极参与政府采购PPP项目工程投资建设,对做大做强公司工程总包业务、拓宽工程总包产品细分市场、推动公司业务转型升级具有重要的促进作用,并将形成新的利润增长点。

2、项目采用国内通行的PPP项目模式运作,项目执行过程中将按照国家有关法律法规、文件的规定获得相应的政策支持;项目执行及货款回收风险较小、投资收益较为稳定;项目如能顺利实施和执行,有利于降低公司应收账款风险、提升公司PPP工程总包业务市场竞争力。

3、项目建设投资总额76,738万元、约占公司2015年度经审计营业总收入的20.74%。公司如能顺利实施该项目,将对公司2017年及后续相关建设运营年度的经营业绩产生积极的影响。

4、本次签订合同为公司日常经营行为,不会对公司业务的独立性产生影响,公司也不会因此对交易对方产生依赖。

5、公司具备项目执行所需人员、技术、管理等要素及资金、资源整合能力,能够保证项目的顺利履行。

五、风险提示

1、根据PPP项目运作特点及洽谈情况,公司将在本次PPP项目合同签订后与相关方协商签订投资协议并合资组建项目公司,由项目公司与宜宾市翠屏区住房和城乡规划建设局签署PPP项目承继协议,并负责本次PPP项目具体实施。对外投资合资组建公司需经公司董事会或股东大会审议批准,能否获得通过存在一定的不确定性。

2、合同生效约定了多项前提条件。由于项目投资金额大、后续进程涉及环节和影响因素较多,项目公司的成立时间、PPP项目承继协议的签订时间、项目融资申请完成时间、合同生效时间等均存在一定的不确定性。

3、本次项目是公司再次承接的PPP重大工程项目,尽管公司在工程总包业务领域已有多年的经验积累,并已成功实施完成了数十个国内外电站EPC工程总包及其他工程总包合同,但在项目的具体执行过程中,因行业、地区及外部环境差异等要素的影响,公司可能存在对某一项目建设、施工组织、工程管理等缺乏经验的风险。

4、项目在执行过程中,可能面临政策法规调整、外部环境发生重大变化、自然灾害、突发意外事件,以及其他不可抗力因素影响所带来的风险。

5、项目公司在建设运营过程中,还可能面临工期延后、合同款项不能按期收回;主要原材料、人工价格上涨导致建设和运营成本超出预算等风险,项目最终执行收益存在一定的不确定性。

公司将根据项目后续进展执行情况,及时履行信息披露义务,敬请广大投资者关注,注意投资风险。

六、备查文件

1、公司与实施机构、四川星星建设签订的《PPP项目合同》。

特此公告。

华西能源工业股份有限公司董事会

二〇一七年一月十九日

证券代码:002170　证券简称:芭田股份　公告编号:17-03

债券代码:112149　债券简称:12芭田债

深圳市芭田生态工程股份有限公司关于12芭田债2017年付息公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

特别提示:

深圳市芭田生态工程股份有限公司2012年公司债券(简称“12芭田债”、“本期债券”、债券代码112149)本次付息的债权登记日为2017年1月24日,凡在2017年1月24日(含)前买入并持有本期债券的投资者享有本次派发的利息;2017年1月24日卖出本期债券的投资者不享有本次派发的利息。

深圳市芭田生态工程股份有限公司(简称“公司”或“本公司”)于?2013年?1月?25日发行的深圳市芭田生态工程股份有限公司2012年公司债券至2017年?1月24日将期满4年。根据本公司“12芭田债”《公开发行公司债券募集说明书》和《公司债券上市公告书》有关条款的规定,在本期债券的计息期限内,每年付息一次,现将有关事项公告如下:

一、本期债券基本情况

1、债券名称:深圳市芭田生态工程股份有限公司2012年公司债券。

2、债券简称:12芭田债。

3、债券代码:112149。

4、发行总额:人民币5.4亿元。

5、发行价格(每张):人民币100元。

6、债券期限:5年,附第3年末发行人上调票面利率选择权和投资者回售选择权。

7、债券利率:票面利率为5.80%。

8、还本付息方式:采用单利按年计息,不计复利,逾期不另计息。每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付。年度付息款项自付息日起不另计利息,本金自本金兑付日起不另计利息。

9、信用级别:经鹏元资信评估有限公司出具的本期债券2016年跟踪评级报告,公司主体信用等级为AA,本期债券信用等级为AA,评级展望为“稳定”。

10、本次付息起息日:2016年1月25日。

11、付息日:自2014年至2018年每年的1月25日为上一个计息年度的付息日(如遇法定节假日或休息日,则顺延至其后的第1个工作日)。

12、上市时间和地点:2013年3月8日在深圳证券交易所上市交易。

13、登记、托管、委托债券派息、兑付机构:中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司(以下简称“中国结算深圳分公司”)。

二、本期债券付息方案

本期债券的票面利率为5.80%,每手“12芭田债”(面值1,000元)派发利息为人民币:58.00元(含税。扣税后个人、证券投资基金债券持有人实际每手派发利息为:46.40元;扣税后非居民企业(包含QFII、RQFII)取得的实际每手派发利息为:52.20元)。

三、债权登记日、除息日及付息日

1、债权登记日:2017年1月24日。

2、除息交易日:2017年1月25日。

3、债券付息日:2017年1月25日。

下一付息期票面利率为5.80%,下一付息期起息日为2017年1月25日。

四、债券付息对象

本次付息对象为:截止2017年1月24日(该日期为债权登记日)下午深圳证券交易所收市后,在中国结算深圳分公司登记在册的全体“12芭田债”持有人。

五、债券付息方法

公司将委托中国结算深圳分公司进行本次付息。

?在本次付息日2个交易日前,公司会将本期债券本次利息足额划付至中国结算深圳分公司指定的银行账户。中国结算深圳分公司收到款项后,通过资金结算系统将本期债券本次利息划付给相应的付息网点(由债券持有人指定的证券公司营业部或中国结算深圳分公司认可的其他机构)。

???本公司与中国结算深圳分公司的相关协议规定,如本公司未按时足额将债券付息资金划入中国结算深圳分公司指定的银行账户,则后续付息工作由本公司自行负责办理,相关实施事宜以本公司的相关公告为准。

六、关于本次付息对象缴纳公司债券利息所得税的说明

1.个人缴纳企业债券利息所得税的说明

根据《中华人民共和国个人所得税法》以及其他相关税收法规和文件的规定,本期债券个人(包括证券投资基金)债券持有者应缴纳企业债券利息个人所得税,征税税率为利息额的20%。根据《国家税务总局关于加强企业债券利息个人所得税代扣代缴工作的通知》(国税函[2003]612号)规定,本期债券利息个人所得税统一由各付息网点在向债券持有人支付利息时负责代扣代缴,就地入库。

2.非居民企业缴纳企业债券利息所得税的说明

根据《中华人民共和国企业所得税法》及其实施条例、《非居民企业所得税源泉扣缴管理暂行办法》(国税发[2009]3号)等规定,本期债券非居民企业(包含QFII、RQFII)债券持有者取得的本期债券利息应缴纳10%企业所得税,由本公司负责代扣代缴。

3.其他债券持有者缴纳企业债券利息所得税的说明

对于其他债券持有者,其债券利息所得税自行缴纳。

七、咨询联系方式

1、发行人:深圳市芭田生态工程股份有限公司

地址:深圳市南山区高新技术园粤兴二道10号7-8楼

联系人:赵青、刘耿豪

电话:0755-86578985;0755-26951598

传真:0755-26584355

邮政编码:518057

2、主承销商:中信建投证券股份有限公司

地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心B座22层

联系人:王庆华

电话:0755-23953946

传真:0755-23953850

邮政编码:518038

3、托管人:中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

地址:广东省深圳市福田区深南大道2012号深圳证券交易所广场22-28楼

联系人:杨惊淙

联系电话:0755-21899320

邮政编码:518038

特此公告。

深圳市芭田生态工程股份有限公司董事会

二〇一七年一月十九日

西部利得天添富货币市场基金

【2016】第四季度报告

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
报告送出日期:二〇一七年一月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2017年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	西部利得天添富货币
场内简称	西部利得天添富货币
基金主代码	675061
交易代码	675061
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年09月28日
报告期末基金份额总额	6,887,416,187.53份
投资目标	本基金在严格控制风险并保持较高流动性的前提下,力争为基金份额持有人创造稳定的、高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	1.收益率曲线分析策略 货币市场收益率曲线的形状反映当时短期利率水平之间的关系,反映市场对较短期限经济状况的判断及对未来短期经济走势的预期。本基金管理人将通过分析货币市场收益率曲线,适时调整基金的短期投资策略。当预期收益率曲线将变陡峭时,将买入期限相对较短并卖出期限相对较长的货币资产;当预期收益率曲线将变平坦时,则买入期限相对较长并卖出期限相对较短的货币资产。 2.久期配置策略 久期是债券价格相对于利率水平正常变动的敏感度。通过对宏观经济的前瞻性研究,预期未来市场利率的变化趋势,可以有效地确定投资组合的最佳平均剩余期限。如果预测未来利率将上升,则可以缩短组合平均剩余期限的办法规避利率风险;如果预测未来利率下降,则延长组合平均剩余期限,赚取利率下行带来的超额回报。 3.类属资产配置策略 根据市场变化趋势,在保持组合资产相对稳定的前提下,根据各类短期金融工具的市场规模、流动性以及参与主体资金的供求变化预期来,确定各类资产在组合中的比例;再通过评估各类资产的流动性和收益性利差,确定不同期限类别资产在各资产类别中的比例。 4.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。 5.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。 6.套利策略 由于市场环境差异、交易市场分割、市场参与者差异,以及资金供求失衡导致的中短期利率异常差异,债券现券市场上存在着套利机会。基金管理人将积极把握由于市场短期失衡而带来的套利机会,通过跨市场、跨品种、跨期限等套利策略,力求获得安全的超额收益。 7.资产支持证券投资策略 本基金将综合运用定性方法和定量方法,基本面分析和数量化模型相结合,对资产证券化产品的基础资产质量及未来现金流进行分析,并结合发行条款、提前偿还率、风险补偿收益等个券因素以及市场利率、流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析和价值评估后进行投资。本基金将严格遵守法律法规和基金合同的约定,严格控制资产支持证券的投资比例、信用等级开密切跟踪评级变化,采用分散投资方式以降低流动性风险,在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。 8.非金融企业债务融资工具投资策略 本基金投资非金融企业债务融资工具,将根据审慎原则,通过指定严格的投资决策流程和风险控制制度,规避高信用风险行业及主体,定期监测分析非金融企业债务融资工具流动性,适度提高组合收益并控制组合整体久期。本基金对于非金融企业债务融资工具的仓位、评级及期限的选择均是建立在对经济基本面、政策面、资金面以及收益水平和流动性风险的分析的基础上。
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,其报期收益和报期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。
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

下属分级基金的基金简称	西部利得天添富货币A	西部利得天添富货币B
下属分级基金的场内简称	西部利得天添富货币A	西部利得天添富货币B
下属分级基金的交易代码	675061	675062
报告期末下属分级基金的份额总额	7,673,465.09份	6,879,742,722.44份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年10月1日 - 2016年12月31日)	
	西部利得天添富货币A	西部利得天添富货币B
1. 本期已实现收益	34,567.78	29,847,723.67
2. 本期利润	34,567.78	29,847,723.67
3. 期末基金资产净值	7,673,465.09	6,879,742,722.44

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.本基金基金合同于2016年9月28日生效。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

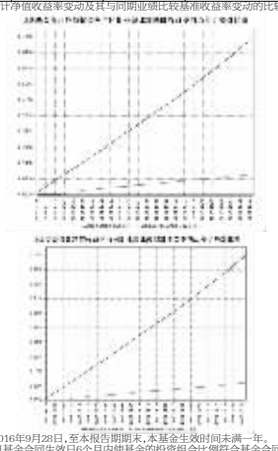
西部利得天添富货币A

阶段	净值收益率①	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
过去三个月	0.6885%	0.0011%	0.0880%	0.0000%	0.6005%	0.0011%

西部利得天添富货币B

阶段	净值收益率①	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
过去三个月	0.7488%	0.0011%	0.0880%	0.0000%	0.6608%	0.0011%

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



注:1. 本基金基金合同生效日为2016年9月28日,至本报告期期末,本基金生效时间未满一年。

2. 按照基金合同的约定,本基金自基金合同生效日6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金建仓期为2016年9月28日至2017年3月27日,至本报告期期末,基金仍处于建仓期。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张维文	本基金基金经理	2016年9月28日	-	八年	上海财经大学金融学硕士;曾任交银施罗德基金管理有限公司创用分析师、国民信托有限公司研究部固定收益研究员。2013年11月加入本公司,具有基金从业资格,中国国籍。

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年四季度,国内经济整体保持平稳,通胀继续温和反弹。美国总统大选尘埃落定,新总统特朗普推出财政刺激政策,12月美联储如期加息后,点阵图显示明年加息次数可能高达3次,美元强势上涨,美债则出现大跌,人民币贬值压力加大。在国内管理层的控资产泡沫和金融风险的背景下,四季度资金面超预期紧张,国内债市也出现巨幅调整,十年期国债收益率从10月最低点大幅上行了近200bp,市场一片哀鸿遍野。

本基金在报告期内采用稳健的投资策略,操作上以同业存单和协议式回购为主,根据市场变化保持合适的组合久期和杠杆,从而获得较稳定的收益,同时尽量规避各种市场风险。

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

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2016年12月31日,本报告期本基金A类份额净值增长率为0.6885%;本报告期本基金B类份额净值增长率为0.7488%,同期业绩比较基准增长率为0.0880%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	1,114,175,561.70	16.17
	其中:债券	1,114,175,561.70	16.17
	资产支持证券	5,475,000.00	0.08
2	买入返售金融资产	4,861,247,490.00	70.56
	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	901,534,422.20	13.08
4	其他资产	12,996,912.06	0.19
5	合计	6,889,954,385.96	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	3.22
	其中:买断式回购融资	0.05

序号	项目	金额(元)	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,本基金债券回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	55
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	115
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	55

5.3.2 报告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	75.25	-
	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	4.36	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	2.16	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	18.09	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.85	-

5.4 报告期末投债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	251,314,160.55	3.65
	其中:政策性金融债	251,314,160.55	3.65
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	99,965,167.85	1.45
6	中期票据	-	-
7	同业存单	757,431,233.30	11.00
9	资产支持证券	5,475,000.00	0.08
8	其他	-	-
9	合计	1,114,175,561.70	16.19
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	011698735	16大唐融资SCP002	1,000,000	99,955,167.85	1.45
2	111699035	16中原银行CD129	1,000,000	99,013,076.68	1.44
3	111699056	16唐山银行CD013	1,000,000	97,400,313.94	1.41
4	111699263	16内蒙古银行CD059	1,000,000	97,338,466.59	1.41
5	111615337	16民生CD337	800,000	79,148,680.24	1.15
6	111680588	16江苏紫金农村商业银行CD071	700,000	69,054,808.11	1.00
7	140225	14国开25	500,000	50,693,169.65	0.74
8	120230	12国开30	500,000	50,293,390.40	0.73
9	100405	10农发05	500,000	50,170,488.52	0.73
10	100210	10国开10	500,000	50,161,154.32	0.73

5.6 “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	1
报告期内偏离度的最高值	0.0032%
报告期内偏离度的最低值	-0.2834%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0587%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

序号	发生日期	偏离度	原因	调整期
1	2016年12月19日	-0.28%	11月下旬开始,资金面显著收紧,一方面债券利率快速上升,另一方面本基金出现大量赎回,最终导致负偏离不断上升,本基金有一天超过-0.25%,我们及时采取应对措施,将负偏离控制在合规范围内,并在随后逐步释放负偏离,将其调至合理水平。	2016-12-20

5.7 报告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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1688226	16金诚2A1	100,000	5,475,000.00	0.08

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

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。

5.8.2 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	12,711,534.06
4	应收申购款	285,378.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	12,996,912.06

5.8.3 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	西部利得天添富货币A	西部利得天添富货币B
报告期期初基金份额总额	2,173,025.57	3,536,764,770.27
报告期期间基金总申购份额	12,911,089.34	8,200,321,279.47
报告期期间基金总赎回份额	7,410,649.82	4,857,343,327.30
报告期期末基金份额总额	7,673,465.09	6,879,742,722.44

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(1)中国证监会批准西部利得天添富货币市场基金设立的相关文件;

(2)《西部利得天添富货币市场基金基金合同》;

(3)《西部利得天添富货币市场基金招募说明书》;

(4)《西部利得天添富货币市场基金托管协议》;

(5)基金管理人《基金管理资格证书》及《企业法人营业执照》;

(6)报告期内西部利得天添富货币市场基金公告的各项原稿。

8.2 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

8.3 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

2017年1月20日