

# 西部利得天添鑫货币市场基金更新招募说明书(2016年第一期)(摘要)

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

2016年4月19日证监许可【2016】853号文准予注册。本基金的基金合同于2016年6月23日生效。

## 【重要提示】

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册,但中国证监会对本基金募集申请的注册,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,投

资人认购(申购)基金并不等于将资金作为存款存放在银行或者存款类金融机构,基金

管理人不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

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。

投资有风险,投资人认购(申购)基金时应认真阅读本基金的招募说明书及基金合

同。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在投资人作出投资决策后,基

金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩也不

构成对本基金业绩表现的保证。

本次招募说明书的更新内容中与托管相关的信息已经本基金托管人复核。

所载

内容截止日为 2016 年 12 月 23 日,投资组合报告为 2016 年三季度报告,

有关财务数据和

净值表现截止日为 2016 年 9 月 30 日(财务数据未经审计)。

## 第一部分 基金管理人

### 一、基金管理人情况

名称:西部利得基金管理有限公司

住所:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 799 号 11 层 02、03 单元

办公地址:上海市浦东新区杨高南路 799 号陆家嘴世纪金融广场 3 号楼

11 层

法定代表人:徐剑钧

成立日期:2010 年 7 月 20 日

批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监许可【2010】864 号

组织形式:有限责任公司

注册资本:叁亿元

存续期限:持续经营

联系电话:(021)38572888

联系人:陈眉媚

股权结构:

股东 出资额(元) 出资比例

西部证券股份有限公司 1 5 3, 0 0 0, 0 0 0 5 1 %

利得科技有限公司 1 4 7, 0 0 0, 0 0 0 4 9 %

合计 3 0 0, 0 0 0, 0 0 0 1 0 0 %

### 二、主要人员情况

## 1. 董事会成员:

徐剑钧先生:董事长

徐剑钧先生, 董事长, 博士研究生, 高级经济师。毕业于陕西师范大学、复旦大学及

西安西北大学, 分别获理学硕士(基础数学)和经济学博士学位。曾在英国爱丁堡大学

从事资本市场研究工作, 21 年证券从业经历。1995 年 3 月起任陕西省证监局市场部负

责人。1995 年 10 月起任陕西证券有限公司总经理助理。2001 年起任西部证券股份有限

公司副总经理。自 2010 年起任公司督察长, 2016 年 9 月起任公司董事长。

贺燕萍女士:董事

贺燕萍女士, 董事, 硕士研究生, 高级经济师。毕业于中国社会科学院研究生院, 获

经济学硕士学位, 18 年证券从业经历。1990 年起任北京市永安宾馆业务主管。1998 年

起任华夏证券股份有限公司研究所客户部经理。2006 年起任中信建投证券股份有限公司有限

公司机构销售部总经理助理。2007 年起在光大证券股份有限公司工作, 历任销售交易

部副总经理、销售交易部总经理。2013 年 1 月起任光大证券资产管理有限公司总经理。

2013 年 8 月起任国泰基金管理有限公司副总经理。自 2015 年 11 月起任公司总经理。

刘建武先生:董事

刘建武先生, 董事, 博士研究生, 高级经济师。毕业于西安西北大学, 获经济管理学

博士学位。1991 年起在陕西省计划委员会经济研究所工作。1993 年起在

西安市人民政

府办公厅工作, 历任财贸、金融、经济管理副处级秘书, 科技文教管理处处长。2001 年起

任西安高新管委会管理办副主任及西安高科集团公司副总经理。2002 年起任西安市

投资服务中心投资管理副主任。2003 年起任陕西省投资集团公司金融证券管理部门

经理。2005 年起任西部证券股份有限公司董事长, 党委书记。目前兼任陕西能源集团

有限公司董事、中国证券业协会理事、陕西证券期货业协会会长。

李兴春先生: 董事

李兴春先生, 董事, 博士。毕业于南京大学, 获管理科学与工程博士学位。

曾任携程

旅行网高级总监, 富友证券有限责任公司副总裁, 泛亚信托投资有限公司执行副总裁,

西部发展控股有限公司董事、总裁, 现任利得科技有限公司董事长、执行董事、总经

理。

陈伟忠先生: 独立董事

陈伟忠, 教授, 独立董事, 博士研究生。毕业于西安交通大学, 获管理学博士学位。长

期从事金融研究及管理工作。1984 年起历任西安交通大学教研室主任、系主任、博导,

同济大学经管学院现代金融研究所所长。现担任同济大学经济金融系主任、同济大学

上海期货研究院院长、应用经济学学术委员会主任、中国金融学会金融工程分会理

事、上海金融学会常务理事。

沈宏山先生: 独立董事

沈宏山先生:独立董事。毕业于北京大学法学院,获法学硕士学位。曾任君安证券、国泰君安证券法律事务部、人力资源部、收购兼并部门业务董事,方正证券法律事务部总经理等职务。爱建证券有限公司、上海辰光医疗股份有限公司独立董事,安信证券内核委员。现任德恒上海律师事务所主任,高级合伙人。

严荣荣女士:独立董事

严荣荣,独立董事,硕士研究生。毕业于西北政法学院、美国纽约大学法学院。曾任Gless Lutz &Partner 律师事务所律师。现任君合律师事务所合伙人。中华全国律师协会会员和上海市律师协会会员。

2. 监事会成员:

王光辉先生:监事会主席

王光辉先生,监事会主席。毕业于中南财经政法大学工商管理专业,研究生学历。曾任陆家嘴国际信托公司济南业务部总经理,兴业银行济南分行同业部总经理,万家共赢资产管理有限公司副总经理。现任利得科技有限公司副总裁。

何方先生:监事

何方先生,监事。毕业于上海财经大学,硕士研究生学历。曾任汉唐证券资产管理部研究员、西部证券投资管理总部投资经理、西部证券投资管理总部副总经理、西部证券投资管理总部总经理、西部证券总经理助理兼上海第一分公司总经理。现任西部证券副总经理兼上海第一分公司总经理。

杨超先生:监事

杨超先生, 监事, 硕士学历。先后毕业于上海同济大学信息工程专业, 获学士学位;

上海交通大学软件工程专业, 获硕士学位。曾任汇添富基金高级 IT 经理、中银国际证券

信息技术部经理、华夏证券软件开发工程师。现任公司总经理助理。

张喆先生: 监事

张喆先生, 监事。毕业于浙江大学检测技术及仪器专业, 获工学学士学位。

曾就职

于中兵勘察研究院、北京证券有限公司、中国证券业协会、中证机构间报价系统股份

有限公司、中国证券投资基金业协会等机构, 长期从事信息技术领域的工作。现任公

司首席信息官、总经理助理。

### 3. 公司高级管理人员

徐剑钧先生: 董事长

徐剑钧先生, 董事长, 博士研究生, 高级经济师。毕业于陕西师范大学、复旦大学及

西安西北大学, 分别获理学硕士(基础数学)和经济学博士学位。曾在英国爱丁堡大学

从事资本市场研究工作, 21 年证券从业经历。1995 年 3 月起任陕西省证监局市场部负

责人。1995 年 10 月起任陕西证券有限公司总经理助理。2001 年起任西部证券股份有限

公司副总经理。自 2010 年起任公司督察长, 2016 年 9 月起任公司董事长。

贺燕萍女士: 总经理

贺燕萍女士, 总经理, 硕士研究生, 高级经济师。毕业于中国社会科学院研究生院,

获经济学硕士学位, 18 年证券从业经历。1990 年起任北京市永安宾馆业

务主管。1998

年起任华夏证券股份有限公司研究所客户部经理。2006年起任中信建投证券股份有限公司机构销售部总经理助理。2007年起在光大证券股份有限公司工作, 历任销售交易部副总经理、销售交易部总经理。2013年1月起任光大证券资产管理有限公司总经理。2013年8月起任国泰基金管理有限公司副总经理。自2015年11月起任公司总经理。

赵毅先生:督察长

赵毅先生, 督察长, 硕士研究生, 毕业于加拿大卡尔加里大学工商管理硕士专业, 20

年证券从业经历。1988年起任北京大学社会科学处职员。1993年起任北京市波姆红外

技术公司总经理助理。1996年起任华夏证券有限责任公司高级投资经理。

2007年起在

华夏基金管理有限公司工作, 历任股票分析师、风险管理部总经理助理。

自2015年起

任公司风险管理部总经理, 2016年9月起任公司督察长。

#### 4. 基金经理

张维文先生, 基金经理, 硕士研究生, 毕业于上海财经大学金融学专业, 获经济学硕

士学位。8年证券从业年限。曾任交银施罗德基金公司信用分析师、国民信托有限公司

固定收益研究员。2013年11月加入西部利得基金管理有限公司, 曾任固定收益高级研

究员。自2016年3月起担任西部利得行业主题优选灵活配置混合型证券投资基金的基

金经理, 自2016年6月起担任西部利得天添鑫货币市场基金的基金经理,

自 2016 年 9 月起担任西部利得天添富货币市场基金的基金经理, 自 2016 年 11 月起担任西部利得合赢债券型证券投资基金、西部利得祥盈债券型证券投资基金的基金经理。

杨炯冉女士, 基金经理, 经济学学士, 曾任中航证券有限责任公司证券交易经理、华

夏人寿保险股份有限公司投资交易负责人、光大永明资产管理有限公司投资管理总

部执行总经理、北京弘富资产管理有限公司固定收益总监。2016 年加入本公司, 现任

事业部固定收益投资副总监, 自 2016 年 6 月起担任西部利得天添鑫货币市场基金的基

金经理, 自 2016 年 11 月起担任西部利得祥盈债券型证券投资基金的基金经理。

#### 5. 投资决策委员会成员

本基金采取集体投资决策制度。

投资决策委员会由下述委员组成:

投资决策委员会主席, 贺燕萍女士, 总经理, 硕士研究生, 高级经济师。毕业于中国

社会科学院研究生院, 获经济学硕士学位, 18 年证券从业经历。1990 年起任北京市永安

宾馆业务主管。1998 年起任华夏证券股份有限公司研究所客户部经理。

2006 年起任中

信建投证券股份有限公司机构销售部总经理助理。2007 年起在光大证券股份有限公司

工作, 历任销售交易部副总经理、销售交易部总经理。2013 年 1 月起任光大证券资产

管理有限公司总经理。2013 年 8 月起任国泰基金管理有限公司副总经理。



自 2015 年 11

月起任公司总经理。

投资决策委员会成员, 刘荟女士, 投资部副总经理, 硕士毕业于辽宁大学应用数学

专业。8 年证券从业年限。曾任群益证券股份有限公司研究员。自

2014 年 1 月起在我公

司担任研究员, 现任投资部副总经理。自 2016 年 1 月起担任西部利得策略优选混合型

证券投资基金的基金经理, 自 2016 年 8 月起担任西部利得景瑞灵活配置混合型证券投

资基金的基金经理, 自 2016 年 11 月起担任西部利得新动力灵活配置混合型证券投资

基金。

投资决策委员会成员, 韩丽楠女士, 基金经理, 硕士研究生, 毕业于英国约克大学经

济与金融专业, 获理学硕士学位。11 年证券从业年限。曾任渣打银行国际管理培训生、

诺德基金管理有限公司研究员、上海元普投资管理有限公司固定收益投资总监。2015

年 5 月加入西部利得基金管理有限公司, 曾任基金经理助理。自 2015 年 8 月起担任西部

利得成长精选灵活配置混合型证券投资基金、西部利得多策略优选灵活配置混合型

证券投资基金的基金经理, 自 2016 年 2 月起担任西部利得新盈灵活配置混合型证券投

资基金的基金经理, 自 2016 年 3 月起担任西部利得行业主题优选灵活配置混合型证券

投资基金的基金经理, 自 2016 年 6 月起担任西部利得稳健双利债券型证券投资基金的

基金经理,自2016年8月起担任西部利得合享债券型证券投资基金的基金经理,自2016

年9月起担任西部利得合赢债券型证券投资基金的基金经理,自2016年12月起担任西

部利得天添金货币市场基金的基金经理、西部利得祥运灵活配置混合型证券投资基金。

投资决策委员会成员,陈保国先生,研究员,硕士毕业于上海理工大学系统理论专

业,获理学硕士学位。6年证券从业年限。曾任西藏同信证券有限公司研究员、上海嘉

华投资有限公司研究员。2016年1月加入我公司,现任研究员。

投资决策委员会成员,王宇先生,固定收益副总监,硕士毕业于南开大学金融学专

业,获经济学硕士学位。10年证券从业年限。曾任上海银行金融市场部交易员、光大证

券金融市场总部债券投资部执行董事、交银施罗德基金投资经理。

2016年9月加入我

公司,现任固定收益副总监。

6. 上述人员之间不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责

1、依法募集资金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额

额的发售、申购、赎回和登记事宜;

2、办理基金备案手续;

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账,进行证券投资;

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配收

益;

- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制季度、半年度和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定,办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项,履行信息披露及报告义务；
- 9、依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- 10、按规定保存基金财产管理业务活动的记录、会计账册、报表和其他相关资料15年以上；
- 11、以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、法律法规和中国证监会规定的或基金合同约定的其他职责。

#### 四、基金管理人关于遵守法律法规的承诺

1、基金管理人将遵守《证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的相关规定,并建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违法违规行为的发生。

2、基金管理人承诺防止下列行为的发生：

- (1)将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2)不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3)利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4)向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5)侵占、挪用基金财产；
- (6)泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示

他人从事

相关的交易活动；

(7)玩忽职守,不按照规定履行职责；

(8)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺加强人员管理,强化职业操守,督促和约束员工遵守国家有关

法律法规及行业规范,诚实信用、勤勉尽责,不从事以下活动：

(1)越权或违规经营；

(2)违反基金合同或托管协议；

(3)故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；

(4)在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；

(5)拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

(6)玩忽职守、滥用职权；

(7)违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，  
泄露在任

职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密,尚未依法公开的基金投资内容、  
基金投资

计划等信息；

(8)除按基金管理人制度进行基金运作投资外,直接或间接进行其他股票  
投资；

(9)协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；

(10)违反证券交易场所业务规则,利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格,  
扰乱市场

秩序；

(11)贬损同行,以抬高自己；

(12)在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

(13)以不正当手段谋求业务发展；

(14)有悖社会公德,损害证券投资基金人员形象；

(15)其他法律、行政法规禁止的行为。

#### 4、基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益,本基金禁止从事下列行为:

- (1)承销证券;
- (2)违反规定向他人贷款或者提供担保;
- (3)从事承担无限责任的投资;
- (4)买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;
- (5)向其基金管理人、基金托管人出资;
- (6)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
- (7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人

人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事

其他重大关联交易的,应当符合本基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人

利益优先原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理

价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意,符合中国证监会的规定,并履行披

露义务。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以

上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关

限制。

#### 5、基金经理承诺

(1)依照有关法律法规和基金合同的规定,本着谨慎的原则为基金份额持有人谋

取最大利益;

(2) 不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人牟取不当

利益;

(3) 不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定, 泄

漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资

内容、基金投

资计划等信息;

(4) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

## 五、基金管理人的内部控制制度

### 1. 内部控制制度概述

公司内部控制是指公司为合理地评价和控制风险, 保证经营运作符合公

司的发

展规划, 防范和化解风险, 保护投资人、公司和公司股东的合法权益, 在充

分考虑内外部

环境的基础上, 通过建立组织机制、运用管理方法、实施操作程序与控制

措施所形成

的风险导向型的内部控制系统。

(1) 内部控制的原则

1) 健全性原则: 内部控制须覆盖公司的各项业务、各个部门或机构和各级

岗位, 并

渗透到各项业务过程, 涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节;

2) 有效性原则: 通过科学的内控手段和方法, 建立合理适用的内控程序, 并

适时调

整和不断完善, 维护内控制度的有效执行;

3) 独立性原则: 公司各机构、部门和岗位的职责应当保持相对独立, 公司

分离,基

金投资研究、决策、执行、清算、评估等部门和岗位,应当在物理上和制度上适当隔离,

以达到风险防范的目的;

5)相互制约原则:公司组织机构、内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡;

6)成本效益原则:公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本,提高经济效益,以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

## (2)内部控制的制度系统

公司内部控制制度系统包括四个层次:第一个层次是国家有关法律法规和公司

章程;第二个层次是包括内部控制大纲在内的基本管理制度;第三个层次是部门管理

制度;第四个层次是各项具体业务规则。

1)国家有关法律法规是公司一切制度的最高准则,公司章程是公司管理制度的基本原则,公司章程、董事会及其下属的专门委员会的管理规定是制订各项制度的基础和前提;

2)内部控制大纲是依据国家相关法律法规、监管机构的有关规定以及公司章程

规定的内控原则而确定的方针和策略,是内部控制纲领性文件,对制订各项基本管理

制度和部门业务规章起着指导性的作用。公司内部控制是公司为实现内部控制目标

而建立的一系列组织机制、管理办法、操作程序与控制措施的总称;

3)公司基本管理制度包括了以下内容:内部控制大纲、风险控制制度、投

资管理制

度、监察稽核制度、基金会计制度、信息披露制度、信息技术管理制度、紧急应变制度、

公司财务管理制度、人力资源管理制度和资料档案管理制度等；

4) 部门管理制度是根据公司章程和内控大纲等文件的要求, 在基本管理制度的基

础上, 对各部门内部管理的具体说明, 包括主要职责、岗位设置、岗位责任及操作规程

等；

5) 各项具体业务规则是针对公司的某项具体业务, 对该业务的操作要求、流程、授

权等作出的详细完整的规定。

### (3) 内部控制的要素

公司内部控制的要素主要包括: 控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通及内部

监控。

#### 1) 控制环境

公司设立董事会, 向股东会负责。董事会由 7 名董事组成, 其中独立董事 3 名。董事

会下设合规审核委员会、资格审查委员会及薪酬与考核委员会等各专门委员会。董事

会是股东会的执行机构, 依照法律法规及公司章程的规定贯彻执行股东会的决议, 行

使决定公司经营和投资方案等重大职权。公司设立监事会, 向股东会负责, 依照《公司

法》和公司章程对公司经营管理活动、董事和公司管理层的经营管理行为进行监督。

公司的日常经营管理工作在总经理的领导下运行, 总经理直接对董事会负责。



公司设立督察长,对董事会负责,负责监督检查基金和公司运作的合法合规情况

及公司内部风险控制情况,行使法律法规及公司章程规定的职权。

## 2) 风险评估

A、董事会下属的合规审核委员会对公司制度的合规性和有效性进行评估,并对

公司与基金运作的合法合规性进行监督检查,以协助董事会确定风险管理目标,提出

风险防范措施的建议,建立并有效维持公司内部控制系统,确保公司规范健康发展;

B、公司经营层下设风险控制委员会,向总经理负责,负责对基金投资风险控制及

公司运作风险控制的有效性进行分析和评估,评估公司面临的风险事项将导致公司

在承担法律责任、社会和公众责任、经济损失或是在以上三个领域的任何组合损失,

以及对商业机会、运营基础以及法律责任等方面的影响,具体包括负责审核公司的风

险控制制度和风险管理流程,识别、监控与管理公司整体风险;

C、公司经营层下设投资决策委员会,负责对公司的基金产品及各投资品种的市

场风险、流动性风险、信用风险等进行风险分析和评估,采用风险量化技术和风险限

额控制等方法把控基金投资整体风险;

D、各业务部门是公司内部控制的具体实施单位,负责对职责范围内的业务所面

临的风险进行识别和评估。各业务部门在公司基本管理制度的基础上,根据具体情况

制订本部门的业务管理规定、操作流程及内部控制规定,对业务风险进行

控制。部门

管理层定期对部门内风险进行评估,确定风险管理措施并实施,监控风险管理绩效,以不断改进风险管理能力。

### 3)控制活动

公司根据自身经营的特点,从组织结构、操作流程及报告制度等多种管理方式入

手,设立顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线:

A、各岗位职责明确,有详细的岗位说明书和业务流程,各岗位人员在上岗前均应

知悉并以书面方式承诺遵守,在授权范围内承担责任;

B、建立重要业务处理凭据传递和信息沟通机制,相关部门和岗位之间相互监督

制衡;

C、公司督察长和内部监察稽核部门独立于其他部门,对内部控制制度的执行情

况实行严格的检查和反馈。

### 4)信息与沟通

公司采用适当、有效的信息系统,识别、采集、加工并相互交流经营活动所需的一

切信息。信息系统须保证业务经营信息和财务会计资料的真实性、准确性和完整性,

必须能实现公司内部信息的沟通和共享,促进公司内部管理顺畅实施。公司根据组织

架构和授权制度,建立清晰的业务报告系统,保障信息的及时、准确的传递,并且维护渠

道的畅通。

### 5)内部监控

公司内部控制的监督系统由监事会、督察长和监察稽核部等组成,监督系

统通过

其监督职能的行使确保公司决策系统和执行系统合法、合规、高效地运作。根据市场

环境、新的金融工具、新的技术应用和新的法律法规等情况,公司组织专门部门对原

有的内部控制进行全面的自查,审查其合法合规性、合理性和有效性,适时改进。

#### (4) 内部控制的检测

内部控制检测的过程包括如下:

- 1) 内控制度设计检测;
- 2) 内部控制执行情况测试;
- 3) 将测试结果与内控目标进行比较;
- 4) 形成测试报告,得出继续运行或纠偏的结论。

#### (5) 风险控制体系

公司风险控制体系包括以下三个层次:

- 1) 第一层次为公司各业务相关部门对各自部门的风险控制负责;
- 2) 第二层次为总经理、风险控制委员会及监察稽核部;
- 3) 第三层次为董事会、合规审核委员会及督察长;
- 4) 为了有效地控制公司内部风险,公司各业务部门建立第一道监控防线。

独立的

监察稽核部,对各业务部门的各项业务全面实行监督反馈,必要时对有关部门进行不

定期突击检查。同时,监察稽核部对于日常操作中发现的或认为具有潜在可能的问题

出具监察稽核报告向风险控制委员会和总经理报告,形成第二道监控防线。

督察长在

工作上向中国证监会和董事会负责,并将检查结果汇报合规审核委员会和董事会,

形成第三道监控防线。

### 3. 基金管理人关于内部控制的声明

(1) 本基金管理人知晓建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层

的责任；

(2) 上述关于内部控制的披露真实、准确；

(3) 本公司承诺将根据市场环境变化及公司发展不断完善内部控制制度。

## 第二部分 基金托管人

### 一、基金托管人基本情况

#### (一) 基本情况

名称: 兴业银行股份有限公司(简称: 兴业银行)

注册地址: 福建省福州市湖东路 154 号

办公地址: 上海市江宁路 168 号

邮政编码: 350013

法定代表人: 高建平

成立日期: 1988 年 8 月 22 日

批准设立机关和批准设立文号: 中国人民银行总行, 银复[1988]347 号

基金托管业务批准文号: 中国证监会证监基金字[2005]74 号

组织形式: 股份有限公司

注册资本: 190.52336751 亿元人民币

存续期间: 持续经营

经营范围: 吸收公众存款; 发放短期、中期和长期贷款; 办理国内外结算;

办理票据

承兑与贴现; 发行金融债券; 代理发行、代理兑付、承销政府债券; 买卖政府债券、金融债

券; 代理发行股票以外的有价证券; 买卖、代理买卖股票以外的有价证券;

资产托管业

务; 从事同业拆借; 买卖、代理买卖外汇; 结汇、售汇业务; 从事银行卡业

务; 提供信用证服

务及担保; 代理收付款项及代理保险业务; 提供保管箱服务; 财务顾问、资

信调查、咨询、

见证业务;经中国银行业监督管理机构批准的其他业务。

## (二) 发展概况及财务状况

兴业银行成立于 1988 年 8 月,是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制

商业银行之一,总行设在福建省福州市,2007 年 2 月 5 日正式在上海证券交易所挂牌上

市(股票代码:601166),注册资本 190.52 亿元。

开业二十多年来,兴业银行始终坚持“真诚服务,相伴成长”的经营理念,致力于为

客户提供全面、优质、高效的金融服务。截至 2015 年 12 月 31 日,兴业银行资产总额达

5.30 万亿元,实现营业收入 1543.48 亿元,全年实现归属于母公司股东的净利润 502.07 亿

元。

在 2015 年英国《银行家》杂志全球银行 1000 强排名中,兴业银行按一级资本排名

列第 36 位;在 2015 年《福布斯》全球上市企业 2000 强排名中,兴业银行位居第 73 位;在

2015 年《财富》世界 500 强中,兴业银行排名第 271 位,稳居全球银行 50 强、全球上市企业

100 强、世界企业 500 强。同时,在国内外各种权威机构组织的评比中,先后荣获“最佳中

资银行”、“最佳战略创新银行”、“最佳绿色银行”、“亚洲可持续银行奖冠军”、“年度

金控集团”、“最佳普惠金融银行”、“中国上市公司卓越董事会(主板)”、“亚洲最佳股东

回报银行”、“最具社会责任上市公司”、“中华慈善突出贡献(单位)奖”、“中国最佳雇

主”等多项大奖。

## 二、托管业务部的部门设置及员工情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部, 下设综合管理处、市场处、委托资产管理处、科技支持处、稽核监察处、运营管理处、期货业务管理处、期货存管结算处、养老金管理中心等处室, 共有员工 100 余人, 业务岗位人员均具有基金从业资格。

## 三、基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于 2005 年 4 月 26 日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号: 证监基金字[2005]74 号。截至 2016 年 9 月 30 日, 兴业银行已托管开放式基金 106 只, 托管基金财产规模 4118.21 亿元。

## 四、基金托管人的内部风险控制制度说明

### 1. 内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定, 守法经营、规范运作、严格监察, 确保业务的稳健运行, 保证基金资产的安全完整, 确保有关信息的真实、准确、完整、及时, 保护基金份额持有人的合法权益。

### 2. 内部控制组织结构

兴业银行基金托管业务内部风险控制组织结构由兴业银行审计部、资产托管部内设稽核监察处及资产托管部各业务处室共同组成。总行审计部对托管业务风险控制工作进行指导和监督; 资产托管部内设独立、专职的稽核监察处, 配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作, 具有独立行使监督稽核工作职权和

能力。各业

务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

### 3. 内部风险控制原则

(1) 全面性原则:风险控制必须覆盖基金托管部的所有处室和岗位,渗透各项业务

过程和业务环节;风险控制责任应落实到每一业务部门和业务岗位,每位员工对自己

岗位职责范围内的风险负责。

(2) 独立性原则:资产托管部设立独立的稽核监察处,该处室保持高度的独立性和

权威性,负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

(3) 相互制约原则:各处室在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制,

建立不同岗位之间的制衡体系。

(4) 定性和定量相结合原则:建立完备的风险管理指标体系,使风险管理更具客观

性和操作性。

(5) 防火墙原则:托管部自身财务与基金财务严格分开;托管业务日常操作部门与

行政、研发和营销等部门严格分离。

(6) 有效性原则。内部控制体系同所处的环境相适应,以合理的成本实现内控目

标,内部制度的制订应当具有前瞻性,并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要,适

时进行相应修改和完善;内部控制应当具有高度的权威性,任何人不得拥有不受内部

控制约束的权力,内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正。

(7) 审慎性原则。内控与风险管理必须以防范风险,审慎经营,保证托管资产的安

全与完整为出发点;托管业务经营管理必须按照“内控优先”的原则,在新设机构或新

增业务时,做到先期完成相关制度建设。

(8) 责任追究原则。各业务环节都应有明确的责任人,并按规定对违反制度的直

接责任人以及对负有领导责任的主管领导进行问责。

## 五、内部控制制度及措施

1. 制度建设:建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的

人员行为规范等一系列规章制度。

2. 建立健全的组织管理结构:前后台分离,不同部门、岗位相互牵制。

3. 风险识别与评估:稽核监察处指导业务处室进行风险识别、评估,制定并实施风

险控制措施。

4. 相对独立的业务操作空间:业务操作区相对独立,实施门禁管理和音像监控。

5. 人员管理:进行定期的业务与职业道德培训,使员工树立风险防范与控制理念,

并签订承诺书。

6. 应急预案:制定完备的《应急预案》,并组织员工定期演练;建立异地灾备中心,保

证业务不中断。

(七) 基金托管人对基金管理人进行监督的方法和程序

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、

《运作办法》、基金合同及其他有关规定,托管人对基金的投资对象和范围、投资组合

比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的



计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项,对基金管理人进行

业务监督、核查。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律

法规规定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知

后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内,基金托管人有权随时

对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人违反基金托管人通知的违规事

项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时,通知基

金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违

反基金合同约定的,应当拒绝执行,立即通知基金管理人,并及时向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政

法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当立即通知基金管理人,并及时向

中国证监会报告。

### 第三部分 相关服务机构

#### 一、基金份额销售机构

##### (1) 直销机构:

名称:西部利得基金管理有限公司

住所:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 799 号 11 层 02、03 单元

办公地址:上海市浦东新区杨高南路 799 号陆家嘴世纪金融广场 3 号楼  
11 层

法定代表人:徐剑钧

联系人:陈眉媚

联系电话:(021)38572888

网址:[www.westleadfund.com](http://www.westleadfund.com)(2) 代销机构:

(1) 兴业银行股份有限公司

地址:福建省福州市湖东路 154 号

法定代表人:高建平

网址:[www.cib.com.cn](http://www.cib.com.cn)

客服热线:95561

(2) 西部证券股份有限公司

地址:西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

法定代表人:刘建武

联系人:冯萍

网址:[www.westsecu.com](http://www.westsecu.com)

客服热线:95582

(3) 申万宏源证券有限公司

地址:上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

法定代表人:李梅

客服热线:95523、400-889-5523

网址:[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

(4) 申万宏源西部证券有限公司

地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦  
20 楼 2005 室

法定代表人:许建平

客服电话:400-800-0562

网址:[www.hysec.com](http://www.hysec.com)

(5) 国金证券股份有限公司

地址:上海市浦东新区芳甸路 1088 号紫竹国际大厦

法定代表人:冉云

电话: 95310

网址:www.gjq.com.cn

(6) 中信建投证券股份有限公司

地址:北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人:王常青

客服电话:400-8888-108

联系人:魏明

网址:www.csc108.com

(7) 中国银河证券股份有限公司

地址:北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人:陈有安

客服电话:400-888-8888

联系人:田薇

网址:www.chinastock.com.cn

(8) 东海证券股份有限公司

地址:上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人:刘化军

联系人:王一彦

客服电话:95531;400-8888-588

网址:www.longone.com.cn

(9) 中泰证券股份有限公司

地址:山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人:李玮

客户服务电话:95538

联系人:吴阳

网址:www.zts.com.cn

(10) 光大证券股份有限公司

地址:上海市新闻路 1508 号

法定代表人:薛峰

客户服务电话: 95525、400-8888-788

联系人:刘晨

网址:www.ebscn.com

(11)招商证券股份有限公司

地址:深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层

法定代表人:宫少林

联系人:黄婵君

客服电话:95565

网址:www.newone.com.cn

(12)平安证券有限责任公司

地址:深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 号

法定代表人:谢永林

联系人:石静武

客服电话:95511-8

网址:http://stock.pingan.com

(13)中银国际证券有限责任公司

地址:上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39F

法定代表人:钱卫

联系人:王炜哲

客服电话:400-620-8888

网址:www.bocichina.com

(14)国信证券股份有限公司

地址:深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦

法定代表人:何如

联系人:周杨

客服电话:95536

网址:www.guosen.com.cn

(15) 上海天天基金销售有限公司

地址:上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

法定代表人:其实

联系人:朱玉

客服电话:400-1818-188

网址:www.1234567.com.cn

(16) 杭州数米基金销售有限公司

地址:浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人:陈柏青

联系人:张裕

客服电话:400-0766-123

网址:www.fund123.cn

(17) 浙江同花顺基金销售有限公司

地址:浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼

法定代表人:凌顺平

联系人:杨翼

客服电话:4008-773-772

网址:www.5ifund.com

(18) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

地址:上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人:张跃伟

客服电话:400-089-1289

网址:www.erichfund.com

(19) 上海利得基金销售有限公司

地址:上海市浦东新区峨山路 91 弄 61 号 1 幢 12 层(陆家嘴软件园 10 号楼)

法定代表人:沈继伟

客服电话:400-033-7933

网址:www.leadbank.com.cn

(20) 上海陆金所资产管理有限公司

地址:上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人:郭坚

客服电话:400-821-9031

网址:[www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

(21) 上海联泰资产管理有限公司

地址:上海市长宁区金钟路 658 弄 2 号楼 B 座 6 楼

法定代表人:燕斌

联系人:陈东

电话:021-52822063

(22) 平安银行股份有限公司

地址:广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

法定代表人:孙建一

联系人:叶佳

客服电话:95511-3

网址:<http://bank.pingan.com/>

(23) 华泰证券股份有限公司

公司地址:南京市江东中路 228 号

法定代表人:周易

联系人:庞晓芸

客服热线:95597

网址:[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

(24) 北京汇成基金销售有限公司

公司地址:北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号

法定代表人:王伟刚

联系人:丁向坤

客服热线:400-619-9059

网址:[www.fundzone.cn](http://www.fundzone.cn)

(25) 泛华普益基金销售有限公司

公司地址:四川省成都市锦江区东大街 99 号平安金融中心 1501 室

法定代表人:于海锋

联系人:陈金红

客服热线:4008588588

网址:<https://www.puyifund.com/>

(26)北京钱景财富投资管理有限公司

公司地址:北京市海淀区中关村丹棱 SOHO10 楼

法定代表人:赵荣春

联系人:陈剑炜

客服热线:400-893-6885

网址:[www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

(27)京东金融-北京肯特瑞财富投资管理有限公司

公司地址:北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部

法定代表人:陈超

联系人:赵德赛

客服热线:95118

网址:<http://fund.jd.com/>

(28)上海华信证券有限责任公司

公司地址:上海市黄浦区南京西路 399 号明天广场 18-23 层

法定代表人:郭林

联系人:李颖

客服热线:4008205999

网址:[www.shhxzq.com](http://www.shhxzq.com)

3、基金管理人可根据有关法律法规要求,选择其他符合要求的机构代理

销售本基

金或变更上述销售机构,并及时公告

二、注册登记机构

名称:西部利得基金管理有限公司

住所:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 799 号 11 层 02、03 单元

办公地址:上海市浦东新区杨高南路 799 号陆家嘴世纪金融广场 3 号楼  
11 层

法定代表人:徐剑钧

电话:(021)38572888

传真:(021)38572750

联系人:张皞骏

客户服务电话:4007-007-818; (021)38572666

### 三、出具法律意见书的律师事务所

名称:上海源泰律师事务所

住所:上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室

办公地址:上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室

负责人:廖海

联系电话:(021)51150298

传真:(021)51150398

联系人:刘佳

经办律师:廖海、刘佳

### 四、审计基金财产的会计师事务所

名称:毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层

办公地址:上海市南京西路 1266 号恒隆广场 50 楼

法定代表人:邹俊

联系电话:(021)22122888

传真:(021)62881889

联系人:黄小熠

经办注册会计师:黄小熠、张楠

### 第四部分 基金的名称

西部利得天添鑫货币市场基金

### 第五部分 基金的类型



契约型开放式

## 第六部分 基金的投资目标

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。

## 第七部分 基金的投资范围

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。

## 第八部分 基金的投资策略

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。

### 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等因素,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

在有效控制风险的前提下,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。

## 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、信用等级并密切跟踪评级变化,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。此外,本基金利用内部信用评级筛选模型,系统跟踪分析非金融企业债务融资工具发行主体的偿债能力、盈利能力、现金流获取能力以及发行主体的长期资本结构等要素,选择优质个券投资标的,严格控制信用风险,保护基金份额持有人的利益。

#### 第九部分 基金的业绩比较基准

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。

如果今后法律法规发生变化,或者证券市场中有其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,本基金管理人可依据维护基金份额持有人合法权益的原则,在与基金托管人协商一致的情况下对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准须报中国证监会备案并及时公告,而无须基金份额持有人大会审议。

#### 第十部分 基金的风险收益特征

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。

#### 第十一部分 基金的投资组合报告

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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据基金合同规定,复核了本报告中的投资组

合报告内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截止 2016 年 9 月 30 日,本报告所列财务数据未经审计。

##### 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 3 7 5, 6 4 2, 1 2 9. 5 3 2 8. 0 3

其中: 债券 3 7 5, 6 4 2, 1 2 9. 5 3 2 8. 0 3

资产支持证券 — —

2 买入返售金融资产 3 7 0, 0 0 1, 2 3 5. 0 0 2 7. 6 1

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 9 1, 6 4 4, 3 2 4. 6 7 4

4. 1 5

4 其他资产 2, 9 1 9, 4 1 5. 0 7 0. 2 2

5 合计 1, 3 4 0, 2 0 7, 1 0 4. 2 7 1 0 0. 0 0

##### 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 6. 3 2

其中: 买断式回购融资 —

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 1 4 6， 8 9 9， 5 7 9. 6 5 1

2. 3 1

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%。

3. 基金投资组合平均剩余期限

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 7 2

报告期内投资组合平均剩余期限最高值 1 1 7

报告期内投资组合平均剩余期限最低值 1 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 3 0 天以内 8 0. 6 1 1 2. 3 1

其中：剩余存续期超过 3 9 7 天的浮动  
利率债 — —

2 3 0 天（含）— 6 0 天 1 0. 0 6 —

其中：剩余存续期超过 3 9 7 天的浮动  
利率债 — —

3 6 0 天（含）— 9 0 天 — —

其中：剩余存续期超过 3 9 7 天的浮动

利率债 — —

4 90天(含) — 120天 0.84 —

其中：剩余存续期超过397天的浮动

利率债 — —

5 120天(含) — 397天(含) 20.59 —

其中：剩余存续期超过397天的浮动

利率债 — —

合计 112.10 12.31

#### 4. 报告期末按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 50,453,467.49 4.23

其中：政策性金融债 50,453,467.49 4.23

4 企业债券 — —

5 企业短期融资券 130,051,895.93 10.90

6 中期票据 — —

7 同业存单 195,136,766.11 16.36

8 其他 — —

9 合计 375,642,129.53 31.49

10

剩余存续期超过397天的浮动利

率债券 — —

#### 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 111695908 16包商银行CD047 1,000,000

9 7, 5 4 4, 4 9 0. 2 4 8. 1 8

2 0 1 1 6 9 9 0 0 6 1 6 中航技SCP001 8 0 0, 0 0 0 8  
0, 0 0 3, 4 8 3. 2 3 6. 7 1

3 1 5 0 4 1 7 1 5 农发17 5 0 0, 0 0 0 5 0, 4 5 3, 4 6  
7. 4 9 4. 2 3

4 1 1 1 6 9 5 9 3 3 1 6 盛京银行CD096 5 0 0, 0 0 0 4  
8, 8 0 0, 1 3 0. 4 5 4. 0 9

5 1 1 1 6 1 9 1 2 0 1 6 恒丰银行CD120 5 0 0, 0 0 0 4  
8, 7 9 2, 1 4 5. 4 2 4. 0 9

6 0 1 1 6 9 9 2 0 7 1 6 首旅SCP002 4 0 0, 0 0 0 4 0,  
0 4 1, 9 4 4. 8 5 3. 3 6

7 0 1 1 6 9 9 6 6 2 1 6 大唐发电SCP003 1 0 0, 0 0 0  
1 0, 0 0 6, 4 6 7. 8 5 0. 8 4

#### 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 —

报告期内偏离度的最高值 0.0079%

报告期内偏离度的最低值 —0.0832%

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 0.0249%

#### 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8. 投资组合报告附注

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。

#### 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 2, 9 1 7, 4 1 5. 0 7
- 4 应收申购款 2, 0 0 0. 0 0
- 5 其他应收款 —
- 6 待摊费用 —
- 7 其他 —
- 8 合计 2, 9 1 9, 4 1 5. 0 7

### 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。

### 第十二部分 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产, 但不保证基金一定盈利, 也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险, 投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

#### 1. 本报告期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

(1) 西部利得天添鑫货币 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

2016年6月23日—

2016年9月30日 0.5256% 0.0046% 0.0971%

0.0009% 0.4285% 0.0037%

(2)西部利得天添鑫货币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

2016年6月23

日—2016年9月

30日

0.5927% 0.0051% 0.0971% 0.0009%

0.4956% 0.0042%

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

西部利得天添鑫货币市场基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势

对比图

(2016年6月24日至2016年9月30日)

(1)西部利得天添鑫货币A:

(2)西部利得天添鑫货币B:

注:1、本基金基金合同生效日为2016年6月23日,至2016年9月30日,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起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6月23日至2016年12月22日,至

2016年9月30日,本基金仍处于建仓期。

### 第十三部分 费用概览

#### 一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费;

3、基金销售服务费;

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费;

6、基金份额持有人大会费用;

7、基金的证券交易费用;

8、基金的银行汇划费用;

9、证券账户开户费用、账户维护费用;

10、货币经纪服务费用(若有);

11、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

#### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率计提。管理费的计算方法

如下:

$H = E \times 0.33\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管

人发送基金管理费划款指令, 基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中

一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等, 支付日期顺延。

## 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方

法如下:

$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管

人发送基金托管费划款指令, 基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中

一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等, 支付日期顺延。

## 3、基金销售服务费

本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%, 对于由 B 类降级的 A 类的基金份

额持有人, 年销售服务费率应自其降级后的下一个自然日起适用 A 类基金份额的费

率。B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%, 对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有

人, 年销售服务费率应自其升级后的下一个自然日起享受 B 类基金份额的费率。

A、B 两类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同,具体如下:

$H=E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金

托管人发送基金销售服务费划款指令,基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基

金财产中一次性支付给登记机构,由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休

日或不可抗力等,支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第 4-11 项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费

用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金

财产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、基金合同生效前的相关费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金管理费、基金托管费、基金销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人协商一致,待履行相关程序后可降低基金管理费、基金

托管费和基金销售服务费。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 个工作日前予以

刊登公告。

## 五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

### 第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》

及其他有关法律法规的要求,对2016年6月4日公布的《西部利得天添鑫货币市场基金

招募说明书》进行更新,并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内

容补充和更新,主要更新的内容如下:

1. 根据最新资料,更新了“标题”部分。
2. 根据最新资料,更新了“重要提示”部分。
3. 根据最新资料,更新了“第三部分基金管理人”部分。
4. 根据最新资料,更新了“第四部分基金托管人”部分。
5. 根据最新资料,更新了“第五部分相关服务机构”部分。
6. 根据最新资料,更新了“第八部分基金合同的生效”部分。
7. 根据最新资料,更新了“第九部分基金份额的申购与赎回”部分。
8. 根据最新资料,增加了“第十部分与基金管理人管理的其他基金转换”部分。
9. 根据最新资料,更新了“第十二部分基金的投资”部分。
10. 根据最新资料,更新了“第二十三部分对基金份额持有人的服务”。
11. 根据最新公告,更新了“第二十四部分其他应披露的事项”。

西部利得基金管理有限公司

2017年2月3日