

西部利得天添富货币市场基金 2022 年第 2 季度报告

2022 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

报告送出日期：2022 年 7 月 20 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 2022 年 7 月 18 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 2022 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	西部利得天添富货币	
基金主代码	675061	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 9 月 28 日	
报告期末基金份额总额	35,991,004,520.99 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	本基金主要为投资人提供现金管理工具，通过积极的投资组合管理，同时充分把握市场短期失衡带来的套利机会，在安全性、流动性和收益性之间寻求最佳平衡点。投资策略包括：收益率曲线分析策略、久期配置策略、类属资产配置策略、回购策略、流动性管理策略、套利策略、资产支持证券投资策略、非金融企业债务融资工具投资策略。（详见《基金合同》）	
业绩比较基准	中国人民银行公布的活期存款基准利率的税后收益率	
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种，其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。	
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
下属分级基金的交易代码	675061	675062
报告期末下属分级基金的份额总额	92,210,252.10 份	35,898,794,268.89 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（2022 年 4 月 1 日-2022 年 6 月 30 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	461,689.93	173,145,547.75
2. 本期利润	461,689.93	173,145,547.75
3. 期末基金资产净值	92,210,252.10	35,898,794,268.89

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。

3.2 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

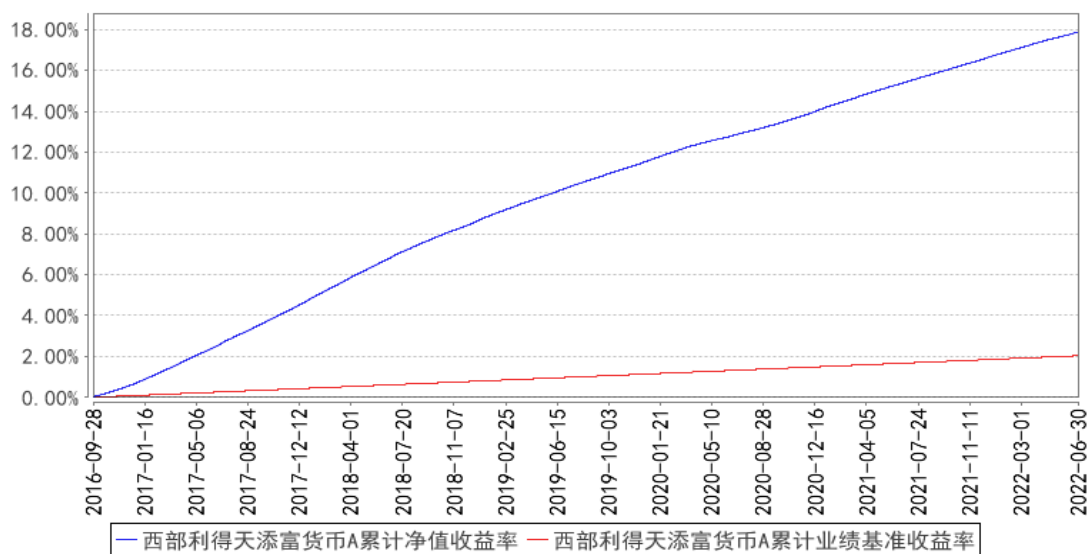
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.4701%	0.0004%	0.0873%	0.0000%	0.3828%	0.0004%
过去六个月	0.9963%	0.0006%	0.1737%	0.0000%	0.8226%	0.0006%
过去一年	2.1019%	0.0006%	0.3506%	0.0000%	1.7513%	0.0006%
过去三年	6.9526%	0.0010%	1.0555%	0.0000%	5.8971%	0.0010%
过去五年	14.8221%	0.0023%	1.7654%	0.0000%	13.0567%	0.0023%
自基金合同生效起至今	17.8697%	0.0023%	2.0348%	0.0000%	15.8349%	0.0023%

西部利得天添富货币 B

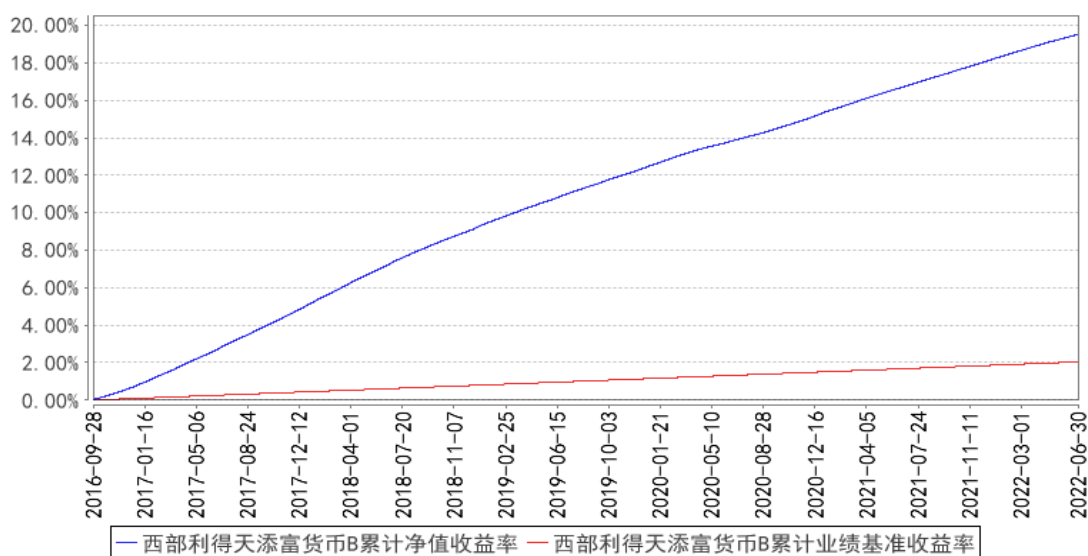
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5304%	0.0004%	0.0873%	0.0000%	0.4431%	0.0004%
过去六个月	1.1167%	0.0006%	0.1737%	0.0000%	0.9430%	0.0006%
过去一年	2.3475%	0.0006%	0.3506%	0.0000%	1.9969%	0.0006%
过去三年	7.7261%	0.0010%	1.0555%	0.0000%	6.6706%	0.0010%
过去五年	16.2192%	0.0023%	1.7654%	0.0000%	14.4538%	0.0023%
自基金合同生效起至今	19.5211%	0.0023%	2.0348%	0.0000%	17.4863%	0.0023%

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

西部利得天添富货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



西部利得天添富货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 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		
李焯	基金经理	2021年4月21日	-	6年	本科毕业于上海交通大学工商管理专业，曾任上海体验企业管理咨询有限公司课程顾问、法纳通电器(上海)有限公司投资部银行间固定收益交易员、上海锡科斯人力资源有限公司猎头顾问。2016年5月加入本公司，具有基金从业资格，中国国籍。

刘心峰	公募固定收益部副总经理、基金经理	2017 年 2 月 17 日	-	10 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. 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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《西部利得基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人未发生所有投资组合参与的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% 的情况。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022 年二季度我国经历了疫情冲击，后随着稳增长政策刺激力度加大和复工复产的快速推进，基本面从 5 月开始有所恢复。从投资端来看，基建仍是稳增长的重要发力点，制造业投资维持高景气，地产处于底部阶段；从消费端来看，4 月疫情防控形势严峻，对消费影响较大，5 月疫情形势缓和后，社零数据降幅收窄；外贸方面，前期积压的订单较多，出口增速呈现回暖。目前海外处于快速加息周期中，但我国仍将加大稳健货币政策的实施力度，强化逆周期和跨周期调节，发挥好总量及结构调节的双重功能。本季度在流动性宽松作用下，债券收益率呈低位窄幅震荡走

势，国内 10 年期国债收益率振幅在 10BP 左右。

本基金在报告期内采用稳健的投资策略，严格控制剩余期限和杠杆水平，配置上提升了逆回购、同业存单及同业存款的资产占比，在保持流动性安全的基础上，努力为投资者获得稳定的收益。衷心感谢持有人的支持，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

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”。

4.6 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以及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	9,194,467,519.73	24.68
	其中：债券	9,164,450,423.84	24.60
	资产支持证券	30,017,095.89	0.08
2	买入返售金融资产	11,338,652,412.03	30.44
	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	16,712,868,364.40	44.87
4	其他资产	3,101,378.92	0.01
5	合计	37,249,089,675.08	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	7.35	
	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	1,244,002,239.71	3.46
	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	78
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	84
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	55

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

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	42.41	3.46
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	9.16	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	22.30	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	6.19	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	23.06	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	103.12	3.46

5.4 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。

5.5 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	720,956,366.01	2.00
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,164,388,851.50	3.24
	其中：政策性金融债	1,164,388,851.50	3.24

4	企业债券	52,244,233.20	0.15
5	企业短期融资券	801,643,745.64	2.23
6	中期票据	15,551,766.30	0.04
7	同业存单	6,409,665,461.19	17.81
8	其他	-	-
9	合计	9,164,450,423.84	25.46
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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	112209032	22 浦发银行 CD032	3,000,000	295,286,875.32	0.82
2	112104055	21 中国银行 CD055	2,200,000	217,877,945.62	0.61
3	112108144	21 中信银行 CD144	2,000,000	199,116,292.76	0.55
4	190214	19 国开 14	1,800,000	184,305,853.86	0.51
5	210211	21 国开 11	1,800,000	183,461,124.88	0.51
6	210411	21 农发 11	1,800,000	182,991,192.03	0.51
7	2203669	22 进出 669	1,500,000	150,000,000.00	0.42
8	112108169	21 中信银行 CD169	1,500,000	148,479,647.84	0.41
9	229914	22 贴现国债 14	1,400,000	139,931,104.14	0.39
10	112209120	22 浦发银行 CD120	1,400,000	136,855,432.78	0.38

5.7 “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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0439%
报告期内偏离度的最低值	0.0190%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0310%

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。##

5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	180069	铁建 Y16A	300,000	30,017,095.89	0.08

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金计价采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按照实际利率法每日计提损益。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在 1.0000 元。

5.9.2 本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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	17,152.78
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	3,084,226.14
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	3,101,378.92

5.9.4 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。

§ 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	105,044,451.74	31,025,222,258.38
报告期期间基金总申购份额	57,181,660.99	17,252,267,826.90
报告期期间基金总赎回份额	70,015,860.63	12,378,695,816.39
报告期期末基金份额总额	92,210,252.10	35,898,794,268.89

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。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	申购	2022-04-19	10,000,000.00	10,000,000.00	-

2	申购	2022-04-20	10,000,000.00	10,000,000.00	-
3	赎回	2022-04-27	-41,000,000.00	-41,000,000.00	-
4	红利转再投	2022-04-29	136,898.85	136,898.85	-
5	申购	2022-05-12	28,000,000.00	28,000,000.00	-
6	赎回	2022-05-27	-25,000,000.00	-25,000,000.00	-
7	赎回	2022-05-30	-8,000,000.00	-8,000,000.00	-
8	红利转再投	2022-05-31	120,482.83	120,482.83	-
9	申购	2022-06-09	31,000,000.00	31,000,000.00	-
10	赎回	2022-06-23	-27,500,000.00	-27,500,000.00	-
11	赎回	2022-06-28	-16,000,000.00	-16,000,000.00	-
12	红利转再投	2022-06-30	110,484.14	110,484.14	-
合计			-38,132,134.18	-38,132,134.18	

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

本报告期内，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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 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) 本基金更新的《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) 报告期内涉及本基金公告的各项原稿。

9.2 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

9.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:00。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
2022 年 7 月 20 日