

西部利得天添金货币市场基金 2024 年中期报告

2024 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 29 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 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合规守信情况的说明 | 9 |
| 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 | 10 |
| 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 | 11 |
| 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合规守信情况声明 | 12 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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 净资产变动表 | 15 |
| 6.4 报表附注 | 16 |
| § 7 投资组合报告 | 34 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 34 |
| 7.2 债券回购融资情况 | 34 |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限 | 35 |
| 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 | 35 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 35 |
| 7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细 | 36 |
| 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离 | 36 |

| | |
|--|-----------|
| 7.8 期末按实际利率计算的账面价值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..... | 37 |
| 7.9 投资组合报告附注..... | 37 |
| § 8 基金份额持有人信息..... | 38 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 38 |
| 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况..... | 39 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 39 |
| 8.4 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..... | 39 |
| § 9 开放式基金份额变动..... | 39 |
| § 10 重大事件揭示..... | 40 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 40 |
| 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..... | 40 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 40 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 40 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 40 |
| 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..... | 40 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 40 |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况..... | 41 |
| 10.9 其他重大事件..... | 41 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 41 |
| 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..... | 41 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 42 |
| § 12 备查文件目录..... | 42 |
| 12.1 备查文件目录..... | 42 |
| 12.2 存放地点..... | 42 |
| 12.3 查阅方式..... | 42 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|---------------------|------------------|------------------|
| 基金名称 | 西部利得天添金货币市场基金 | |
| 基金简称 | 西部利得天添金货币 | |
| 基金主代码 | 675071 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016 年 12 月 5 日 | |
| 基金管理人 | 西部利得基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份 额总额 | 954,021,988.28 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基 金简称 | 西部利得天添金货币 A | 西部利得天添金货币 B |
| 下属分级基金的交 易代码 | 675071 | 675072 |
| 报告期末下属分级 基金的份额总额 | 82,821,581.72 份 | 871,200,406.56 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 在控制投资风险、保持基金资产流动性的前提下，力求为投资者提供稳定的投资收益。 |
| 投资策略 | 利率策略、信用债券投资策略、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、其他金融工具投资策略。（详见《基金合同》） |
| 业绩比较基准 | 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。 |

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 | 交通银行股份有限公司 |
| 信息披露负责 人 | 姓名 | 赵毅 | 方圆 |
| | 联系电话 | 021-38572888 | 95559 |
| | 电子邮箱 | service@westleadfund.com | fangy_20@bankcomm.com |
| 客户服务电话 | | 4007-007-818 | 95559 |
| 传真 | | 021-50710261 | 021-62701216 |
| 注册地址 | | 中国（上海）自由贸易试验区耀 体路 276 号 901 室-908 室 | 中国（上海）自由贸易试验区银 城中路 188 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 | 中国（上海）长宁区仙霞路 18 号 |
| 邮政编码 | | 200126 | 200336 |

| | | |
|-------|----|-----|
| 法定代表人 | 何方 | 任德奇 |
|-------|----|-----|

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《证券时报》 |
| 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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日) | |
|-------------------|-------------------------------------|----------------|
| | 西部利得天添金货币 A | 西部利得天添金货币 B |
| 本期已实现收益 | 946,926.26 | 6,433,170.70 |
| 本期利润 | 946,926.26 | 6,433,170.70 |
| 本期净值收益率 | 0.8833% | 1.0041% |
| 3.1.2 期末数据 和指标 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日) | |
| 期末基金资产净值 | 82,821,581.72 | 871,200,406.56 |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 | 1.0000 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日) | |
| 累计净值收益率 | 19.1450% | 21.3491% |

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

西部利得天添金货币 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 | 0.1345% | 0.0012% | 0.1107% | 0.0000% | 0.0238% | 0.0012% |
| 过去三个月 | 0.4083% | 0.0011% | 0.3362% | 0.0000% | 0.0721% | 0.0011% |
| 过去六个月 | 0.8833% | 0.0018% | 0.6736% | 0.0000% | 0.2097% | 0.0018% |
| 过去一年 | 1.8358% | 0.0017% | 1.3610% | 0.0000% | 0.4748% | 0.0017% |
| 过去三年 | 5.3529% | 0.0018% | 4.1350% | 0.0000% | 1.2179% | 0.0018% |
| 自基金合同生效起至今 | 19.1450% | 0.0027% | 10.7613% | 0.0000% | 8.3837% | 0.0027% |

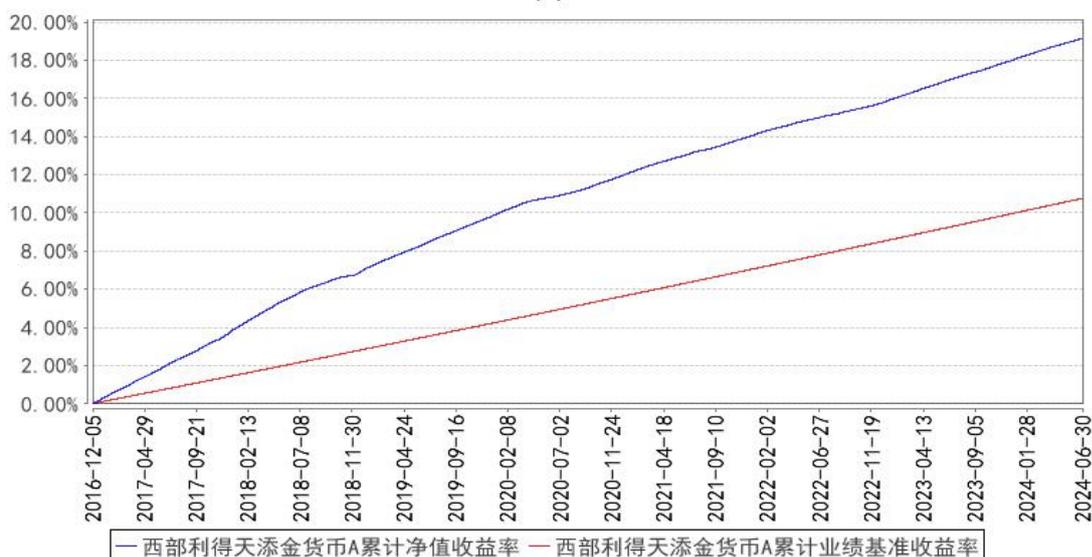
西部利得天添金货币 B

| 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 | 0.1542% | 0.0012% | 0.1107% | 0.0000% | 0.0435% | 0.0012% |
| 过去三个月 | 0.4684% | 0.0011% | 0.3362% | 0.0000% | 0.1322% | 0.0011% |
| 过去六个月 | 1.0041% | 0.0018% | 0.6736% | 0.0000% | 0.3305% | 0.0018% |

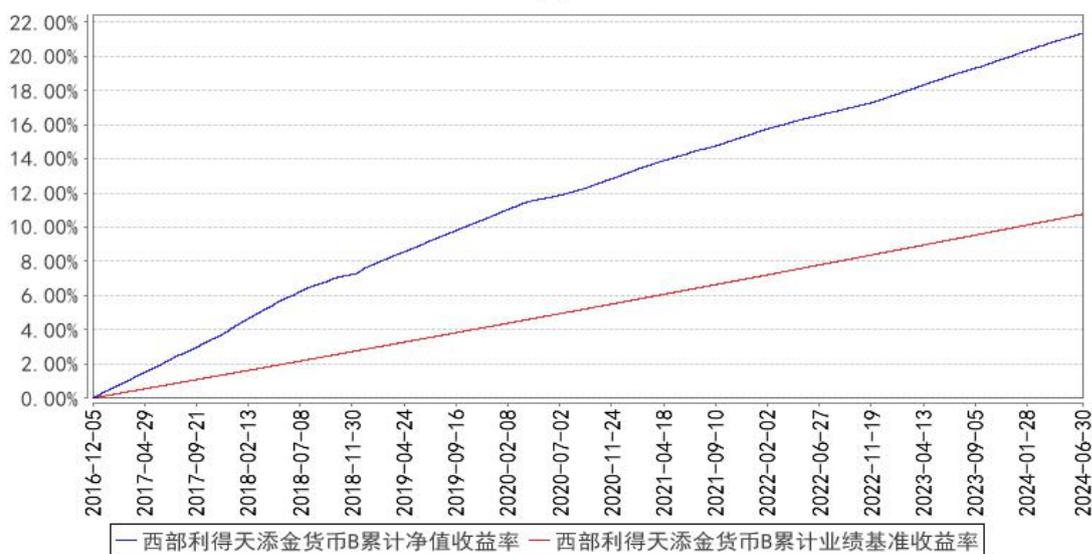
| | | | | | | |
|------------|----------|---------|----------|---------|----------|---------|
| 过去一年 | 2.0819% | 0.0017% | 1.3610% | 0.0000% | 0.7209% | 0.0017% |
| 过去三年 | 6.1186% | 0.0017% | 4.1350% | 0.0000% | 1.9836% | 0.0017% |
| 自基金合同生效起至今 | 21.3491% | 0.0027% | 10.7613% | 0.0000% | 10.5878% | 0.0027% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

西部利得天添金货币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



西部利得天添金货币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



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，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。目前公司具有公募基金、特定客户资产管理、受托管理保险资金、合格境内机构投资者资格（获批筹建）等多类别资产管理业务。

2015 年起公司逐步建立了一支前中后台密切配合的专业化团队，树立了绝对收益的投资管理方向，秉承专业稳健的投资风格，严谨科学的风险管理理念，以专业高效的服务，致力于打造良好业绩，为投资者创造长期稳定的价值。

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 | | |
| 张英 | 基金经理 | 2019 年 8 月 12 日 | - | 13 年 | 上海交通大学工商管理专业硕士。曾任广东南粤银行管理培训生、流动性管理岗、业务经理。2018 年 9 月加入本公司，具有基金从业资格，中国国籍。 |
| 刘心峰 | 公募投资二级部门副总经理、基金经理 | 2024 年 3 月 16 日 | - | 12 年 | 英国曼彻斯特大学数量金融专业硕士。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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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，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

本报告期内未发现异常交易行为。公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况。

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

2024 年上半年，经济稳步复苏，政策制定的增长目标总体符合市场预期；央行降准，LPR 下调，手工补息整改，多因素推动流动性整体宽松；特别国债发行计划落地，地方债供给不及预期，债市资产荒延续。

各因素综合影响下，债券收益率整体下行。一季度债券 30-10 年利差不断压缩，曲线走平。随后信贷社融偏弱、特别国债发行计划落地、地产政策放松、央行再提利率风险等多空因素交织，中短端强势，长端低位震荡。季末央行关于利率走廊的表述弱化了 MLF 的锚定作用，叠加跨半年末流动性宽松，超长债收益率再次下行。信用债收益率整体下行，期限利差和等级利差不断压缩，

在资产荒延续的背景下，信用债配置需求强烈。

在运作策略上，在运作策略上，本基金在严控信用风险的前提下，根据货币资产利率波动情况和择机配置了存单与存款，参与存单波段交易，在资金利率上行阶段增加了回购资产配置，提高组合剩余期限。保证了在低风险状况下的较好回报。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

4.4.2 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，债市可能仍处于震荡偏多的环境中。近期央行降低 OMO 利率，并调整了相关政策利率，打开了中短端下行空间，预计将带动长端利率进一步下行。高质量发展框架下，经济刺激政策预计较为温和，市场对经济复苏节奏和力度的预期偏谨慎。在基本面无重大变化和债市资产荒明确的背景下，中长久期资产和有利差的信用债资产可能仍是市场交投的主要方向。关注债券供给对流动性的冲击，机构一致预期下市场波动可能增加，关注交易行为的扰动。

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、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以及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，托管人在西部利得天添金货币市场证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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：西部利得天添金货币市场基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 110,565,847.35 | 56,779,749.13 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | 568.91 | 645.87 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 585,986,903.20 | 257,203,781.22 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 585,986,903.20 | 257,203,781.22 |

| | | | |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 342,268,455.22 | 161,063,111.26 |
| 债权投资 | 6.4.7.5 | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | 6.4.7.6 | - | - |
| 其他权益工具投资 | 6.4.7.7 | - | - |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 4,000,010.00 | 928.00 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 1,042,821,784.68 | 475,048,215.48 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2024年6月30日 | 上年度末 2023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 | | 88,408,491.10 | 51,331,317.43 |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 8,856.63 | - |
| 应付管理人报酬 | | 131,123.80 | 72,607.18 |
| 应付托管费 | | 43,707.94 | 18,151.81 |
| 应付销售服务费 | | 25,633.91 | 36,218.39 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | 2,601.46 |
| 应付利润 | | 44,382.14 | 33,251.56 |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 137,600.88 | 195,354.24 |
| 负债合计 | | 88,799,796.40 | 51,689,502.07 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 954,021,988.28 | 423,358,713.41 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | - | - |
| 净资产合计 | | 954,021,988.28 | 423,358,713.41 |
| 负债和净资产总计 | | 1,042,821,784.68 | 475,048,215.48 |

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，西部利得天添金货币 A 基金份额净值为 1.0000 元，基金份额总额为 82,821,581.72 份；西部利得天添金货币 B 基金份额净值为 1.0000 元，基金份额总额为

871,200,406.56 份。西部利得天添金货币市场基金总份额为 954,021,988.28 份。

6.2 利润表

会计主体：西部利得天添金货币市场基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------------------|----------|--|---|
| 一、营业总收入 | | 8,751,458.03 | 7,932,847.61 |
| 1. 利息收入 | | 3,332,746.82 | 3,917,422.62 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 808,639.80 | 1,062,664.81 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 2,524,107.02 | 2,854,757.81 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 5,418,711.21 | 4,015,424.99 |
| 其中：股票投资收益 | | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.15 | 5,418,711.21 | 4,015,424.99 |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.16 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.17 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.18 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.19 | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.20 | - | - |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.21 | - | - |
| 减：二、营业总支出 | | 1,371,361.07 | 1,577,208.03 |
| 1. 管理人报酬 | | 655,124.10 | 615,926.28 |
| 2. 托管费 | | 192,239.10 | 153,981.57 |
| 3. 销售服务费 | | 166,267.59 | 499,334.02 |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 240,828.08 | 187,398.02 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 240,828.08 | 187,398.02 |

| | | | |
|---------------------|----------|--------------|--------------|
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.22 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 477.86 | 1,167.11 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.23 | 116,424.34 | 119,401.03 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 7,380,096.96 | 6,355,639.58 |
| 减: 所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 7,380,096.96 | 6,355,639.58 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 7,380,096.96 | 6,355,639.58 |

6.3 净资产变动表

会计主体: 西部利得天添金货币市场基金

本报告期: 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | |
|--|--|---------------|-------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 423,358,713.41 | - | 423,358,713.41 |
| 二、本期期初净资产 | 423,358,713.41 | - | 423,358,713.41 |
| 三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列) | 530,663,274.87 | - | 530,663,274.87 |
| (一)、综合收益总额 | - | 7,380,096.96 | 7,380,096.96 |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列) | 530,663,274.87 | - | 530,663,274.87 |
| 其中: 1. 基金申购款 | 3,288,931,448.69 | - | 3,288,931,448.69 |
| 2. 基金赎回款 | -2,758,268,173.82 | - | -2,758,268,173.82 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动 (净资产减少以“-”号填列) | - | -7,380,096.96 | -7,380,096.96 |
| 四、本期期末净资产 | 954,021,988.28 | - | 954,021,988.28 |
| 项目 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | |

| | 实收基金 | 未分配利润 | 净资产合计 |
|--|-------------------|---------------|-------------------|
| 一、上期期末净资产 | 1,074,157,295.19 | - | 1,074,157,295.19 |
| 二、本期期初净资产 | 1,074,157,295.19 | - | 1,074,157,295.19 |
| 三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列) | -516,483,678.62 | - | -516,483,678.62 |
| (一)、综合收益总额 | - | 6,355,639.58 | 6,355,639.58 |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列) | -516,483,678.62 | - | -516,483,678.62 |
| 其中:1.基金申购款 | 1,869,114,928.67 | - | 1,869,114,928.67 |
| 2.基金赎回款 | -2,385,598,607.29 | - | -2,385,598,607.29 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动 (净资产减少以“-”号填列) | - | -6,355,639.58 | -6,355,639.58 |
| 四、本期期末净资产 | 557,673,616.57 | - | 557,673,616.57 |

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

西部利得天添金货币市场基金(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”)证监许可[2016]2102号《关于准予西部利得天添金货币市场基金注册的批复》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《西部利得天添金货币市场基金基金合同》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400,258,328.89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1600880号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《西部利得天添金货币市

场基金基金合同》于 2016 年 12 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 400,276,427.23 份基金份额，其中认购资金利息折合 18,098.34 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《西部利得天添金货币市场基金基金合同》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)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金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和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“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<年度报告和中期报告>》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

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况、2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金本报告期末发生重大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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《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号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》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) 资管产品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。

证券投资基金管理人运用基金买卖债券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。

(b) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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。

(c) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(d) 对基金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 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024年6月30日 |
|--------|-------------------|
| 活期存款 | 5,352,869.75 |
| 等于：本金 | 5,351,923.42 |
| 加：应计利息 | 946.33 |
| 减：坏账准备 | - |
| 定期存款 | 105,212,977.60 |
| 等于：本金 | 105,000,000.00 |

| | |
|----------------|----------------|
| 加：应计利息 | 212,977.60 |
| 减：坏账准备 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - |
| 存款期限 1-3 个月 | 30,008,291.65 |
| 存款期限 3 个月以上 | 75,204,685.95 |
| 其他存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 110,565,847.35 |

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 2024 年 6 月 30 日 | | | |
|--------|-------|------------------------|----------------|-----------|------------|
| | | 按实际利率计算的 账面价值 | 影子定价 | 偏离金额 | 偏离度 (%) |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - | - |
| | 银行间市场 | 585,986,903.20 | 586,085,209.29 | 98,306.09 | 0.0103 |
| | 合计 | 585,986,903.20 | 586,085,209.29 | 98,306.09 | 0.0103 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 585,986,903.20 | 586,085,209.29 | 98,306.09 | 0.0103 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

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 2024 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 | 342,268,455.22 | - |
| 合计 | 342,268,455.22 | - |

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。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资**6.4.7.5.1 债权投资情况**

本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末未发生债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资**6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末未发生其他债权投资减值准备。

6.4.7.7 其他权益工具投资**6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 52,219.42 |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | 52,219.42 |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 85,381.46 |
| 合计 | 137,600.88 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

西部利得天添金货币 A

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 143,201,667.00 | 143,201,667.00 |
| 本期申购 | 230,465,819.66 | 230,465,819.66 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -290,845,904.94 | -290,845,904.94 |
| 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 | 82,821,581.72 | 82,821,581.72 |

西部利得天添金货币 B

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|-------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 280,157,046.41 | 280,157,046.41 |
| 本期申购 | 3,058,465,629.03 | 3,058,465,629.03 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,467,422,268.88 | -2,467,422,268.88 |
| 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 | 871,200,406.56 | 871,200,406.56 |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

西部利得天添金货币 A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|-------------|-------|-------------|
| 上年度末 | - | - | - |
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 946,926.26 | - | 946,926.26 |
| 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 | -946,926.26 | - | -946,926.26 |
| 本期末 | - | - | - |

西部利得天添金货币 B

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|-------|---------------|
| 上年度末 | - | - | - |
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 6,433,170.70 | - | 6,433,170.70 |
| 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 | -6,433,170.70 | - | -6,433,170.70 |
| 本期末 | - | - | - |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 活期存款利息收入 | 10,877.65 |
| 定期存款利息收入 | 781,796.95 |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 33.07 |
| 其他 | 15,932.13 |
| 合计 | 808,639.80 |

注：其他包括结算保证金利息收入和申购款利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------------------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 债券投资收益——利息收入 | 5,001,854.90 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 416,856.31 |
| 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 | 5,418,711.21 |

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |

| | |
|------------------------|------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 1,526,401,751.18 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,522,523,304.37 |
| 减：应计利息总额 | 3,461,590.50 |
| 减：交易费用 | - |
| 买卖债券差价收入 | 416,856.31 |

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无资产支持证券赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无资产支持证券申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期末持有贵金属。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期末持有贵金属。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末持有贵金属。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末持有贵金属。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.20 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动损益。

6.4.7.21 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用 | 16,409.12 |
| 信息披露费 | 59,672.34 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行费用 | 21,708.88 |
| 账户维护费 | 18,600.00 |
| 其他 | 34.00 |
| 合计 | 116,424.34 |

6.4.7.24 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

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 |
| 交通银行股份有限公司 | 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 |
| 西部利得-安盈 1 号资产管理计划 | 基金管理人管理的资产管理计划 |

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

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债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

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均无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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|----------------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 655,124.10 | 615,926.28 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护 费 | 158,970.54 | 209,768.13 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 496,153.56 | 406,158.15 |

注：支付基金管理人西部利得基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值一定比例的年费率计提，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 × 0.20% / 当年天数（2023 年 1 月 1 日至 2024 年 4 月 14 日），

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数（自 2024 年 4 月 15 日起）。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 192,239.10 | 153,981.57 |

注：支付基金托管人交通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。

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 | | |
|----------------|---------------------------------|----------------|------------|
| | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 西部利得天添金货币 A | 西部利得天添金货币 B | 合计 |
| 交通银行股份有限公司 | 13,149.04 | 3,593.19 | 16,742.23 |
| 西部利得基金管理有限公司 | 160.37 | 11,924.85 | 12,085.22 |
| 西部证券股份有限公司 | 282.92 | 0.66 | 283.58 |
| 合计 | 13,592.33 | 15,518.70 | 29,111.03 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 | | |
| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 西部利得天添金货币 A | 西部利得天添金货币 B | 合计 |
| 交通银行股份有限公司 | 105,432.11 | 2,112.61 | 107,544.72 |
| 西部利得基金管理有限公司 | 7,331.57 | 5,900.85 | 13,232.42 |
| 西部证券股份有限公司 | 218.47 | - | 218.47 |
| 合计 | 112,982.15 | 8,013.46 | 120,995.61 |

注：支付基金销售机构的销售服务费：

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管理有限公司，再由西部利得基金管理有限公司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管理有限公司，再由西部利得基金管理有限公司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。

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均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 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

6.4.10.4.2 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

份额单位：份

西部利得天添金货币 B

| 关联方名称 | 本期末 2024年6月30日 | | 上年度末 2023年12月31日 | |
|-----------------|-------------------|-----------------------------|---------------------|-----------------------------|
| | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的比 例(%) | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的比 例(%) |
| 西部利得-安盈1号资产管理计划 | 11,146,594.28 | 1.1684 | 11,034,664.99 | 2.6065 |

注：本报告期末及上年度可比期间无除基金管理人之外的其他关联方投资西部利得天添金货币 A。

6.4.10.5 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 2024年1月1日至2024年6月30日 | | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023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 |
| 交通银行股份有限公司 | 5,352,869.75 | 10,877.65 | 849,327.57 | 16,680.63 |

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人交通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“交通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2024年6月30日的相关余额为人民币0.00元。（2023年6月30日：人民币0.00元）

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 西部利得天添金货币 A | | | | |
|------------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 已按再投资形式 转实收基金 | 直接通过应付 赎回款转出金额 | 应付利润 本年变动 | 本期利润分配合 计 | 备注 |
| 954,193.57 | - | -7,267.31 | 946,926.26 | - |
| 西部利得天添金货币 B | | | | |
| 已按再投资形式 转实收基金 | 直接通过应付 赎回款转出金额 | 应付利润 本年变动 | 本期利润分配合 计 | 备注 |
| 6,414,772.81 | - | 18,397.89 | 6,433,170.70 | - |

6.4.12 期末（2024 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

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。

6.4.12.2 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有暂时停牌股票。

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 2024 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 88,408,491.10 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 |
|-----------|-------------------|-------------------|------------|---------|---------------|
| 112303155 | 23 农业银 行 CD155 | 2024 年 7 月 1 日 | 99.91 | 468,000 | 46,759,066.81 |
| 2404103 | 24 农发贴 现 03 | 2024 年 7 月 1 日 | 99.90 | 70,000 | 6,993,073.77 |
| 2404104 | 24 农发贴 现 04 | 2024 年 7 月 1 日 | 99.84 | 100,000 | 9,984,339.47 |
| 2404105 | 24 农发贴 现 05 | 2024 年 7 月 1 日 | 99.81 | 240,000 | 23,954,996.06 |
| 249929 | 24 贴现国 债 29 | 2024 年 7 月 1 日 | 99.77 | 100,000 | 9,976,877.93 |
| 合计 | | | | 978,000 | 97,668,354.04 |

6.4.12.3.2 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。

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。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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风险评估、交易对手分类管理、投资比例控制等方式来管控信用风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在信用良好的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制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 2024年6月30日 | 上年度末 2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 74,325,644.48 | 47,277,150.71 |

| | | |
|----|---------------|---------------|
| 合计 | 74,325,644.48 | 47,277,150.71 |
|----|---------------|---------------|

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债、短期融资券等无信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2024年6月30日 | 上年度末 2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 511,661,258.72 | 204,782,759.46 |
| 合计 | 511,661,258.72 | 204,782,759.46 |

6.4.13.2.3 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 2024年6月30日 | 上年度末 2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | - | 5,143,871.05 |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | - | 5,143,871.05 |

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

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。

本基金的投资范围为银行存款、大额存单、短期债券、央行票据、债券回购等银行间市场固定收益品种。基金估值采用摊余成本法，按实际利率在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失，并通过“影子定价”对基金持有的估值对象进行重新评估，因此利率风险在一定程度上存在。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类：

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 6 个月以内 | 6 个月-1 年 | 1-5 年 | 不计息 | 合计 |
|------------------------|-----------------------|----------------------|----------|---------------------|-------------------------|
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 90,411,519.70 | 20,154,327.65 | - | - | 110,565,847.35 |
| 存出保证金 | 568.91 | - | - | - | 568.91 |
| 交易性金融资产 | 543,623,955.73 | 42,362,947.47 | - | - | 585,986,903.20 |
| 买入返售金融资产 | 342,268,455.22 | - | - | - | 342,268,455.22 |
| 应收申购款 | - | - | - | 4,000,010.00 | 4,000,010.00 |
| 资产总计 | 976,304,499.56 | 62,517,275.12 | - | 4,000,010.00 | 1,042,821,784.68 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 8,856.63 | 8,856.63 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 131,123.80 | 131,123.80 |
| 应付托管费 | - | - | - | 43,707.94 | 43,707.94 |
| 卖出回购金融资产款 | 88,408,491.10 | - | - | - | 88,408,491.10 |

| | | | | | |
|--------------------------|----------------|---------------|-------|--------------|----------------|
| 应付销售服务费 | - | - | - | 25,633.91 | 25,633.91 |
| 应付利润 | - | - | - | 44,382.14 | 44,382.14 |
| 其他负债 | - | - | - | 137,600.88 | 137,600.88 |
| 负债总计 | 88,408,491.10 | - | - | 391,305.30 | 88,799,796.40 |
| 利率敏感度缺口 | 887,896,008.46 | 62,517,275.12 | - | 3,608,704.70 | 954,021,988.28 |
| 上年度末 2023 年 12 月 31 日 | 6 个月以内 | 6 个月 -1 年 | 1-5 年 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 56,779,749.13 | - | - | - | 56,779,749.13 |
| 存出保证金 | 645.87 | - | - | - | 645.87 |
| 交易性金融资产 | 257,203,781.22 | - | - | - | 257,203,781.22 |
| 买入返售金融资产 | 161,063,111.26 | - | - | - | 161,063,111.26 |
| 应收申购款 | - | - | - | 928.00 | 928.00 |
| 资产总计 | 475,047,287.48 | - | - | 928.00 | 475,048,215.48 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 72,607.18 | 72,607.18 |
| 应付托管费 | - | - | - | 18,151.81 | 18,151.81 |
| 卖出回购金融资产款 | 51,331,317.43 | - | - | - | 51,331,317.43 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 36,218.39 | 36,218.39 |
| 应付利润 | - | - | - | 33,251.56 | 33,251.56 |
| 应交税费 | - | - | - | 2,601.46 | 2,601.46 |
| 其他负债 | - | - | - | 195,354.24 | 195,354.24 |
| 负债总计 | 51,331,317.43 | - | - | 358,184.64 | 51,689,502.07 |
| 利率敏感度缺口 | 423,715,970.05 | - | - | -357,256.64 | 423,358,713.41 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

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 | | |
|--------------|--------------------|-----------------------------|------------------------|
| 分析 | 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（2024 年 6 月 30 日） | 上年度末（2023 年 12 月 31 日） |
| | 市场利率上升 25 基点 | -318,000.00 | -137,000.00 |
| 市场利率下降 25 基点 | 318,000.00 | 137,000.00 | |

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。

于 6 月 30 日，本基金未持有对其他价格敏感的金融资产与金融负债，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响，所以未进行其他价格风险的敏感性分析。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | - | - |
| 第二层次 | 585,986,903.20 | 257,203,781.22 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 585,986,903.20 | 257,203,781.22 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2023 年 12 月 31 日：无)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2024 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 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 | 固定收益投资 | 585,986,903.20 | 56.19 |
| | 其中：债券 | 585,986,903.20 | 56.19 |
| | 资产支持证 券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 342,268,455.22 | 32.82 |
| | 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 | 110,565,847.35 | 10.60 |
| 4 | 其他各项资产 | 4,000,578.91 | 0.38 |
| 5 | 合计 | 1,042,821,784.68 | 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 | 3.74 | |
| | 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 | 88,408,491.10 | 9.27 |
| | 其中：买断式回购融资 | - | - |

注：本报告期内，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正回购的资金余额未超过基金资产净值的 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 | 58 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 69 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 32 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

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 | 54.22 | 9.26 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天（含）—60 天 | 15.70 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天（含）—90 天 | 19.75 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天（含）—120 天 | 0.83 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120 天（含）—397 天（含） | 18.31 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 108.82 | 9.26 |

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 | 按实际利率计算的账面价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|---------------|---------------|
| 1 | 国家债券 | 9,976,877.93 | 1.05 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 40,932,409.30 | 4.29 |
| | 其中：政策性金融债 | 40,932,409.30 | 4.29 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融 | 23,416,357.25 | 2.45 |

| | | | |
|----|--------------------|----------------|-------|
| | 资券 | | |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 511,661,258.72 | 53.63 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 585,986,903.20 | 61.42 |
| 10 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | - | - |

7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名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) | 按实际利率计算的账面价值 (元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|------------------|-------------|---------------------|--------------|
| 1 | 112303155 | 23 农业银行 CD155 | 500,000 | 49,956,267.96 | 5.24 |
| 2 | 112405139 | 24 建设银行 CD139 | 500,000 | 49,881,040.14 | 5.23 |
| 3 | 112303199 | 23 农业银行 CD199 | 500,000 | 49,783,939.63 | 5.22 |
| 4 | 112490916 | 24 昆仑银行 CD004 | 400,000 | 39,961,972.64 | 4.19 |
| 5 | 112481543 | 24 天津银行 CD218 | 300,000 | 29,863,354.26 | 3.13 |
| 6 | 112480490 | 24 台州银行 CD026 | 300,000 | 29,736,658.00 | 3.12 |
| 7 | 2404105 | 24 农发贴现 05 | 240,000 | 23,954,996.06 | 2.51 |
| 8 | 112418035 | 24 华夏银行 CD035 | 230,000 | 22,825,755.71 | 2.39 |
| 9 | 112383612 | 23 广西北部湾银行 CD256 | 200,000 | 19,975,205.85 | 2.09 |
| 10 | 112491402 | 24 九江银行 CD021 | 200,000 | 19,973,929.83 | 2.09 |

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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 | 0.0663% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0052% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0270% |

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 期末按实际利率计算的账面价值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

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 基金计价方法说明

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内按照实际利率法进行摊销，每日计提损益。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式，使基金份额净值保持在人民币 1.00 元。

为了避免采用“摊余成本法”计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用估值技术，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。投资组合的摊余成本与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的，应按其他公允指标对组合的账面价值进行调整，调整差额确认为“公允价值变动损益”，并按其他公允价值指标进行后续计量。如基金份额净值恢复至 1 元，可恢复使用摊余成本法估算公允价值。如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7.9.2 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中，中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局的处罚。中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。天津银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行天津市分行的处罚。台州银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局台州监管分局的处罚。广西北部湾银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局广西监管局、国家外汇管理局广西壮族自治区分局的处罚。九江银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局九江监管分局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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 | 568.91 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收申购款 | 4,000,010.00 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 4,000,578.91 |

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 天添金货 币 A | 10,151 | 8,158.96 | 1,586,670.83 | 1.92 | 81,234,910.89 | 98.08 |
| 西部利得 天添金货 币 B | 8,383 | 103,924.66 | 794,552,735.23 | 91.20 | 76,647,671.33 | 8.80 |
| 合计 | 18,524 | 51,501.94 | 796,139,406.06 | 83.45 | 157,882,582.22 | 16.55 |

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）。

8.2 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 | 银行类机构 | 200,493,352.74 | 21.02 |
| 2 | 其他机构 | 100,927,606.87 | 10.58 |
| 3 | 银行类机构 | 100,482,351.71 | 10.53 |
| 4 | 其他机构 | 97,473,137.99 | 10.22 |
| 5 | 其他机构 | 65,758,918.74 | 6.89 |
| 6 | 其他机构 | 35,012,483.96 | 3.67 |
| 7 | 其他机构 | 33,120,000.00 | 3.47 |
| 8 | 其他机构 | 25,285,262.81 | 2.65 |
| 9 | 其他机构 | 20,008,942.22 | 2.10 |
| 10 | 其他机构 | 11,795,881.23 | 1.24 |

8.3 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 | 西部利得天添金货币 A | 126,030.73 | 0.1522 |
| | 西部利得天添金货币 B | 55,226.75 | 0.0063 |
| | 合计 | 181,257.48 | 0.0190 |

8.4 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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金 | 西部利得天添金货币 A | 0~10 |
| | 西部利得天添金货币 B | 0~10 |
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 西部利得天添金货币 A | 10~50 |
| | 西部利得天添金货币 B | - |
| | 合计 | 10~50 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 西部利得天添金货币 A | 西部利得天添金货币 B |
|-----------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日 (2016年12月5日) 基金份额总额 | 258,427.23 | 400,018,000.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 143,201,667.00 | 280,157,046.41 |

| | | |
|---------------|----------------|------------------|
| 本报告期基金总申购份额 | 230,465,819.66 | 3,058,465,629.03 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 290,845,904.94 | 2,467,422,268.88 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 82,821,581.72 | 871,200,406.56 |

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

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

本报告期内本基金无涉及基金管理人、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

10.6.1 管理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及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 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 | 股票交易 | 应支付该券商的佣金 | 备注 |
|------|-----|------|-----------|----|
|------|-----|------|-----------|----|

| | 元数量 | 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 (%) | |
|-------|-----|------|------------------|----|----------------|---|
| 太平洋证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | 2 | - | - | - | - | - |

注：基金租用席位的选择标准是：（1）财力雄厚，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 (%) |
| 太平洋证券 | 5,002,450.00 | 100.00 | 152,312,000.00 | 100.00 | - | - |
| 天风证券 | - | - | - | - | - | - |

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期未发生偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

10.9 其他重大事件

本报告期内本基金未发生其他重大事件。

§ 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 | 20240627-20 240630 | 0.00 | 200,493 ,352.74 | 0.00 | 200,493,352.7 4 | 21.02 |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况，由此可能导致的特有 风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产 运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产 以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金 管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者 赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p> | | | | | | | |

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 8:30-11:30，13:00-17:00。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

2024 年 8 月 29 日