（上接D234版）

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
西部证券	59,597.83	14.17%	–	–
关联方名称	上年度可比期间 2016年12月5日(基金合同生效日)至2016年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

本基金无上年度可比数据。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年12月5日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,675,100.81	113,167.01
其中:支付销售机构的客户维护费	194.33	14.21

注:支付基金管理人西部利得基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.8%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×0.8% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年12月5日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	876,581.45	21,218.79

注:支付基金托管人兴业银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.15%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:

日托管费=前一日基金资产净值×0.15% / 当年天数。

7.4.8.2.3 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 2017年1月1日至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	西部利得祥运混合A	西部利得祥运混合C	合计
西部利得基金	–	1,892,157.76	1,892,157.76
西部证券	–	–	–
兴业银行	–	–	–
合计	–	1,892,157.76	1,892,157.76
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年12月5日(基金合同生效日)至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	西部利得祥运混合A	西部利得祥运混合C	合计
合计	–	–	–

1. 按前一日C类基金资产净值0.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给西部利得基金,再由西部利得基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:日销售服务费=前一日基金资产净值×0.5%/ 当年天数。

2.本基金上一年度未产生销售服务费。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2016年12月5日(基金合同生效日)至2016年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

本基金于本报告期内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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	
	西部利得祥运混合A	西部利得祥运混合C
基金合同生效日(2016年12月5日)持有的基金份额	–	–
期初持有的基金份额	–	–
期间申购/买入总份额	–	–
期间因拆分变动份额	–	–
减:期间赎回/卖出总份额	–	–
期末持有的基金份额	–	–
期末持有的基金份额占基金总份额比例	–	–

项目	上年度可比期间 2016年12月5日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	西部利得祥运混合A	西部利得祥运混合C
基金合同生效日(2016年12月5日)持有的基金份额	–	–
期初持有的基金份额	–	–
期间申购/买入总份额	–	–
期间因拆分变动份额	–	–
减:期间赎回/卖出总份额	–	–
期末持有的基金份额	–	–
期末持有的基金份额占基金总份额比例	–	–

本基金管理人于本报告期末运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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

关联方名称	西部利得祥运混合A			
	本期末 2017年12月31日		上年度末 2016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－吉鑫1号资产管理计划	200,008,000.00	47.9700%	200,008,000.00	99.9800%

份额单位:份

关联方名称	西部利得祥运混合C			
	本期末 2017年12月31日		上年度末 2016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－东方睿德2号资产管理计划	111,625,160.26	26.7700%	–	0.0000%
西部利得－东方睿德5号资产管理计划	105,343,812.22	25.2600%	–	0.0000%

7.4.8.5 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 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年12月5日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	14,308,994.89	392,019.66	2,426,569.84	52,338.53

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	本期 2017年1月1日至2017年12月31日 基金在承销期内买入	
				数量(单位:份)	总金额
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	上年度可比期间 2016年12月5日(基金合同生效日)至2016年12月31日 基金在承销期内买入	
				数量(单位:份)	总金额

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

–

7.4.9 期末(2017年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.10.1.1 受限证券类别:股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002466	天齐锂业	2017年12月26日	2018年1月3日	增发流通受限	11.06	53.21	2,160	23,889.60	114,933.60	–
603161	科华控股	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	–

7.4.10.1.2 受限证券类别:债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注

7.4.10.1.3 受限证券类别:权证

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:份)	期末成本总额	期末估值总额	备注

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002507	涪陵榨菜	2017年12月4日	临时停牌	16.77	–	–	70,000	1,149,700.00	1,173,900.00	–
601600	中国铝业	2017年9月12日	临时停牌	8.09	2018年2月26日	7.28	99,000	493,031.40	800,910.00	–

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

–

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
合计				–	–

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2017年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为84,700,743.80元,属于第二层级的余额为177,294,563.25元,无属于第三层级的余额(2016年12月31日,第一层级的余额为60,177,644.52元,属于第二层级的余额为11,273,499.20元,无属于第三层级的余额)。

(ii)公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2017年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具 不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	权益投资	86,696,307.05	19.52
	其中:股票	86,696,307.05	19.52
2	固定收益投资	175,299,000.00	39.48
	其中:债券	175,299,000.00	39.48
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	137,867,466.52	31.05
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	40,096,346.58	9.03
7	其他各项资产	4,101,449.85	0.92
8	合计	444,060,570.00	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	514,000.00	0.12
B	采矿业	3,316,355.00	0.75
C	制造业	58,609,527.55	13.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	940,077.00	0.21
E	建筑业	2,332,482.50	0.53
F	批发和零售业	1,562,520.00	0.35
G	交通运输、仓储和邮政业	3,368,841.00	0.76
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	–	–
J	金融业	8,857,795.00	2.00
K	房地产业	1,098,810.00	0.25
L	租赁和商务服务业	670,450.00	0.15
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	2,999,277.00	0.68
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	1,302,840.00	0.29
R	文化、体育和娱乐业	1,123,332.00	0.25
S	综合	–	–
	合计	86,696,307.05	19.56

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	11,130	7,763,063.70	1.75
2	600887	伊利股份	156,500	5,037,735.00	1.14
3	000858	五粮液	49,000	3,914,120.00	0.88
4	300296	利亚德	135,000	2,631,150.00	0.59
5	601857	中国石油	305,100	2,468,259.00	0.56
6	600036	招商银行	71,000	2,060,420.00	0.46
7	600690	青岛海尔	104,100	1,961,244.00	0.44
8	000333	美的集团	35,000	1,940,050.00	0.44
9	000418	小天鹅A	27,000	1,831,950.00	0.41
10	601988	中国银行	433,700	1,721,789.00	0.39

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	17,620,704.00	8.88
2	600519	贵州茅台	10,789,218.20	5.44
3	000651	格力电器	7,540,982.71	3.80
4	000333	美的集团	6,961,404.62	3.51
5	002304	洋河股份	6,109,469.32	3.08
6	000858	五粮液	6,063,450.00	3.06
7	000963	华东医药	5,482,507.41	2.76
8	300296	利亚德	5,376,519.15	2.71
9	002142	宁波银行	5,211,460.00	2.63
10	000418	小天鹅A	4,940,531.89	2.49
11	600048	保利地产	4,741,061.00	2.39
12	000568	泸州老窖	4,542,319.29	2.29
13	000069	华侨城A	4,219,624.25	2.13
14	000488	晨鸣纸业	4,064,817.00	2.05
15	002475	立讯精密	4,035,164.00	2.03
16	601398	工商银行	3,737,757.00	1.88
17	002241	歌尔股份	3,737,383.86	1.88
18	601318	中国平安	3,544,095.00	1.79
19	300070	碧水源	3,504,616.30	1.77
20	600690	青岛海尔	3,338,199.62	1.68

注:本表"本期累计买入金额"按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	17,579,947.12	8.86
2	600519	贵州茅台	8,796,691.36	4.44
3	600048	保利地产	8,323,251.00	4.20
4	000651	格力电器	7,278,736.79	3.67
5	601398	工商银行	6,423,460.00	3.24
6	600036	招商银行	5,867,736.24	2.96
7	000333	美的集团	5,505,545.52	2.78
8	601988	中国银行	5,500,210.00	2.77
9	601288	农业银行	5,461,743.00	2.75
10	002142	宁波银行	5,148,214.65	2.60
11	002304	洋河股份	4,860,554.76	2.45
12	000488	晨鸣纸业	4,328,315.00	2.18
13	002475	立讯精密	4,234,227.90	2.14
14	600016	民生银行	4,081,832.00	2.06
15	601328	交通银行	4,077,652.00	2.06
16	000568	泸州老窖	3,974,248.08	2.00
17	601818	光大银行	3,951,409.00	1.99
18	000963	华东医药	3,926,203.56	1.98
19	601688	华泰证券	3,921,111.00	1.98
20	002241	歌尔股份	3,827,743.65	1.93

注:本表"本期累计卖出金额"按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	357,024,871.85
卖出股票收入(成交)总额	357,606,634.21

8.5 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	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	29,847,000.00	6.73
	其中:政策性金融债	29,847,000.00	6.73
4	企业债券	116,916,000.00	26.38
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债(可交换债)	–	–
8	同业存单	28,536,000.00	6.44
9	其他	–	–
10	合计	175,299,000.00	39.55

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	150418	15农发18	300,000	29,847,000.00	6.73
2	122497	15远洋04	300,000	29,553,000.00	6.67
3	122445	15融创03	300,000	29,259,000.00	6.60
4	111796474	17龙江银行CD094	300,000	28,536,000.00	6.44
5	112315	16宝龙债	200,000	19,792,000.00	4.47

8.7 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

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

贵金属不在本基金投资范围内。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

金额单位:人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)

本基金于本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金于本报告期末未持有股指期货合约。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金于本报告期末未持有股指期货合约。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货不在本基金投资范围内。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
公允价值变动总额合计(元)					–
国债期货投资本期收益(元)					–
国债期货投资本期公允价值变动(元)					–

国债期货不在本基金投资范围内。

8.11.3 本期国债期货投资评价

国债期货不在本基金投资范围内。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 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	78,727.30
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	4,022,722.55
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	4,101,449.85

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)

本基金于本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
西部利得祥运混合A	107	1,869,246.90	200,008,000.00	100.00%	1,417.82	0.00%
西部利得祥运混合C	103	2,106,574.60	216,968,972.48	100.00%	8,211.27	0.00%
合计	196	2,127,482.66	416,976,972.48	100.00%	9,629.09	0.00%

9.3 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	西部利得祥运混合A	0.00	0.0000%
	西部利得祥运混合C	0.00	0.0000%
	合计	0.00	0.0000%

9.4 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的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	西部利得祥运混合A	0~10
	西部利得祥运混合C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	西部利得祥运混合A	0~10
	西部利得祥运混合C	0~10
	合计	0~10

§10 开放式基金份额变动

单位:份

项目	西部利得祥运混合A	西部利得祥运混合C
基金合同生效日(2016年12月5日)基金份额总额	200,022,779.29	30,510.00
本报告期期初基金份额总额	200,022,779.29	30,510.00
本报告期基金总申购份额	12,677.22	490,199,991.43
减:本报告期基金总赎回份额	26,038.69	273,253,317.68
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"–"填列)	–	–
本报告期期末基金份额总额	200,009,417.82	216,977,183.75

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期为本基金审计的会计师事务所改聘为毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)。本报告期应支付毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审计费人民币77,000元。截至报告期末连续服务期为1~2年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券	2	164,114,753.91	23.10%	129,863.79	30.88%	–
西部证券	2	112,172,776.32	15.79%	59,597.83	14.17%	–
海通证券	1	107,555,392.63	15.14%	57,144.33	13.59%	–
银河证券	2	74,504,984.54	10.49%	12,017.67	2.86%	–
中泰证券	2	55,796,541.57	7.85%	46,383.71	11.03%	–
中信建投	2	54,862,099.50	7.72%	35,533.14	8.45%	–
方正证券	2	44,178,970.45	6.22%	23,472.21	5.58%	–
广发证券	1	33,857,797.42	4.77%	24,760.17	5.89%	–
华创证券	2	29,629,847.36	4.17%	9,816.26	2.33%	–
东兴证券	1	16,421,368.37	2.31%	12,008.99	2.86%	–
太平洋证券	2	11,795,937.00	1.66%	7,446.88	1.77%	–
华泰证券	1	5,496,042.58	0.77%	2,920.03	0.69%	–
东吴证券	2	–	–	–	–	–
申万宏源	2	–	–	−454.86	0.11%	–
平安证券	2	–	–	–	–	–
东北证券	2	–	–	–	–	–
华金证券	2	–	–	–	–	–

11.7.2 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
光大证券	3,047,884.92	1.59%	857,500,000.00	43.37%	–	–
西部证券	4,099,234.96	2.13%	86,176,000.00	4.36%	–	–
海通证券	–	–	10,000,000.00	0.51%	–	–
银河证券	3,020,125.48	1.57%	455,000,000.00	23.01%	–	–
中泰证券	–	–	39,000,000.00	1.97%	–	–
中信建投	–	–	19,000,000.00	0.96%	–	–
方正证券	29,155,386.30	15.18%	45,000,000.00	2.28%	–	–
广发证券	279,264.36	0.15%	43,000,000.00	2.18%	–	–
华创证券	–	–	49,000,000.00	2.48%	–	–
东兴证券	10,476,468.10	5.46%	282,300,000.00	14.28%	–	–
太平洋证券	–	–	–	–	–	–
华泰证券	–	–	10,000,000.00	0.51%	–	–
东吴证券	–	–	81,000,000.00	4.10%	–	–
申万宏源	141,960,552.06	73.92%	–	–	–	–
平安证券	–	–	–	–	–	–
东北证券	–	–	–	–	–	–
华金证券	–	–	–	–	–	–

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	>6个月	200,008,000.00	–	–	200,008,000.00	47.97%
	2	3–6个月	0.00	111,625,160.26	–	111,625,160.26	26.77%
	3	3–6个月	0.00	105,343,812.22	–	105,343,812.22	25.26%
个人	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
产品特有风险							
本基金为混合型基金,其主要风险包括但不限于:股票价格波动风险、信用风险、流动性风险等。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

西部利得基金管理有限公司
2018年3月30日

（上接D236版）

1. 按前一日A类基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给西部利得基金,再由西部利得基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:

日销售服务费=前一日基金资产净值×0.25%/ 当年天数。

2. 按前一日B类基金资产净值0.01%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给西部利得基金,再由西部利得基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:

日销售服务费=前一日基金资产净值×0.01%/ 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2016年12月5日(基金合同生效日)至2016年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

本基金于本报告期内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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	
	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)持有的基金份额	–	–
期初持有的基金份额	–	–
期间申购/买入总份额	11,000,000.00	–
期间因拆分变动份额	43,156.51	–
减:期间赎回/卖出总份额	8,042,298.60	–
期末持有的基金份额	3,000,857.91	–
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.0600%	–

项目	上年度可比期间 2016年12月5日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	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)持有的基金份额	–	–
期初持有的基金份额	–	–
期间申购/买入总份额	–	–
期间因拆分变动份额	–	–
减:期间赎回/卖出总份额	–	–
期末持有的基金份额	–	–
期末持有的基金份额占基金总份额比例	–	–

本基金上年度可比期间末运用固有资金持有本基金。

7.4.8.4.2 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

西部利得天添金货币A

份额单位:份

关联方名称	本期末 2017年12月31日		上年度末 2016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－吉鑫1号资产管理计划	0.00	0.0000%	103,891.81	0.1026%

西部利得天添金货币B

份额单位:份

关联方名称	本期末 2017年12月31日		上年度末 2016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

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

7.4.8.5 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 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年12月5日(基金合同生效日)至2016年12月31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	5,418,654.72	72,104.12	2,922,255.25	106,340.57

注:1.本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管,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2017年12月31日的相关余额为人民币214,069.37元。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	本期 2017年1月1日至2017年12月31日 基金在承销期内买入	
				数量(单位:份)	总金额
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	上年度可比期间 2016年12月5日(基金合同生效日)至2016年12月31日 基金在承销期内买入	
				数量(单位:份)	总金额

本基金本报告期及上年度可比期间末在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

–

7.4.9 期末(2017年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.10.1.1 受限证券类别:股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

7.4.10.1.2 受限证券类别:债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注

7.4.10.1.3 受限证券类别:权证

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:份)	期末成本总额	期末估值总额	备注

本基金于本报告期末未因认购新发/增发而持有流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

本基金于本报告期末未持暂时停牌股票。

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

–

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
合计				–	–

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

–

§8 投资组合报告

8.1 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	13,045,804.83	17.63
	其中:债券	13,045,804.83	17.63
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	14,973,000.00	20.23
	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	45,632,724.09	61.67
4	其他各项资产	346,734.12	0.47
5	合计	73,998,263.04	100.00

8.2 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	2.42
	其中:买断式回购融资	–

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	–	–
	其中:买断式回购融资	–	–

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

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	原因	调整期
1	2017年4月20日	37.25	天添金货币基金于4月19日遭遇巨额赎回,赎回后被动提高到37.25%。	1天
2	2017年8月8日	34.34	天添金货币基金于8月7日遭遇巨额赎回,为满足支付需求临时银行间融资。	1天

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	34
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	91
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	9

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限(天数)	原因	调整期

注:本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

8.3.2 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	69.85	–
	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	27.09	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天(含)—120天	–	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	120天(含)—397天(含)	2.82	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
	合计	99.76	–

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

序号	发生日期	平均剩余存续期	原因	调整期

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	3,078,419.10	4.17
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	同业存单	9,967,385.73	13.50
8	其他	–	–
9	合计	13,045,804.83	17.67
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	–	–

8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	111712238	17北京银行CD238	100,000	9,967,385.73	13.50
2	019563	17国债09	20,800	2,079,747.70	2.82
3	020203	17贴债47	10,000	998,671.40	1.35

8.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	–
报告期内偏离度的最高值	0.04%
报告期内偏离度的最低值	−0.10%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.01%

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

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

序号	发生日期	偏离度	原因	调整期

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

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)

本基金于本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1

–

8.9.2

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

8.9.3 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	946.31
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	224,125.30
4	应收申购款	121,662.51
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	346,734.12

8.9.4 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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	246	18,576.46	3,000,857.91	65.67%	1,568,951.55	34.33%
西部利得天添金货币B	4	17,314,796.01	69,259,184.03	100.00%	–	0.00%
合计	250	295,315.97	72,260,041.94	97.87%	1,568,951.55	2.13%

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)。

9.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	弘康人寿增利灵活型投资连结保险	20,113,215.69	27.25%
2	华农财产保险股份有限公司	20,056,555.65	27.17%
3	宁波兴富先锋投资合伙企业(有限合伙)	20,041,437.66	27.15%
4	弘康人寿投资连结保险增利90投资账户	9,027,608.29	12.23%
5	西部利得基金管理有限公司	3,000,000.00	4.06%
6	蒋蓉曾	510,386.52	0.69%
7	谢绍丽	189,887.50	0.26%
8	余俊萱	100,044.04	0.14%
9	贺燕萍	50,428.30	0.07%
10	邓楠	50,022.03	0.07%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	西部利得天添金货币A	0.00	0.0000%
	西部利得天添金货币B	0.00	0.0000%
	合计	0.00	0.0000%

9.5 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	西部利得天添金货币A	0~10
	西部利得天添金货币B	0
	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	0
	西部利得天添金货币B	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位:份

	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	1,037,401.68	100,264,076.38
本报告期基金总申购份额	31,558,557.38	541,077,246.52
减:本报告期基金总赎回份额	28,026,149.60	572,082,138.87
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"–"填列)	–	–
本报告期期末基金份额总额	4,569,809.46	69,259,184.03

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内,本基金召开基金份额持有人大会,大会于2017年9月26日表决通过了《关于修改西部利得天添金货币市场基金基金合同有关事项的议案》,本次大会决议自该日起生效。决议内容如下:

"根据《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》和《西部利得天添金货币市场基金基金合同》的有关规定,同意对本基金降低管理费率和托管费率,其年管理费率由0.30%降低至0.20%,其年托管费率由0.065%降低至0.05%,并相应修订《西部利得天添金货币市场基金基金合同》的相应条款。"

本基金于2017年9月30日起执行调整后的管理费率与托管费率,新的《西部利得天添金货币市场基金基金合同》也于该日起正式生效。

上述内容具体情况可详见2017年9月28日本基金管理人披露的《西部利得天添金降费表决结果及决议生效公告》。

11.2 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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期为本基金审计的会计师事务所改聘为毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)。本报告期应支付毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审计费人民币39,600元。截至报告期末连续服务期为1~2年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
太平洋证券	2	–	–	–	–	–

注:1.基金租用席位的选择标准是:(1)资力雄厚,信誉良好;(2)财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定;(3)经营行为规范,在最近一年内无重大违规经营行为;(4)内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求;(5)公司具有较强的研究能力,能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务;能根据基金投资的特定要求,提供专门研究报告。选择程序是:根据对各券商提供的各项投资、研究服务情况的考评结果,符合席位券商标准的,由公司研究部提出席位券商的调整意见(调整名单及调整原因),并经公司批准。

11.7.2 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	25,775,596.60	100.00%	350,300,000.00	100.00%	–	–

11.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

项目	发生日期	偏离度	法定披露报刊	法定披露日期

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	1–3个月	0.00	20,113,215.69	–	20,113,215.69	27.25%
	2	1–3个月	0.00	20,056,555.65	–	20,056,555.65	27.17%
	3	1–3个月	0.00	20,041,437.66	–	20,041,437.66	27.15%
个人	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
产品特有风险							
本基金为货币市场基金,其主要风险包括但不限于:利率风险、信用风险、流动性风险、操作风险等。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

西部利得基金管理有限公司
2018年3月30日