

光大保德信添天利季度开放短期理财债券  
型证券投资基金  
2012 年年度报告  
2012 年 12 月 31 日

基金管理人：光大保德信基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一三年三月二十七日

---

## § 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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 3 月 26 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。

本报告中财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所为本基金财务出具了 2012 年度无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2012 年 6 月 19 日起至 12 月 31 日止。

---

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录.....	1
1.1	重要提示.....	1
§ 2	基金简介.....	4
2.1	基金基本情况.....	4
2.2	基金产品说明.....	4
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	信息披露方式.....	5
2.5	其他相关资料.....	5
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	5
3.1	主要会计数据和财务指标.....	5
3.2	基金净值表现.....	6
3.3	自基金合同生效以来基金的利润分配情况.....	9
§ 4	管理人报告.....	10
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	13
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
§ 5	托管人报告.....	16
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2	托管人对报告期内本基金运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
§ 6	审计报告.....	17
§ 7	年度财务报表.....	18
7.1	资产负债表.....	18
7.2	利润表.....	20
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4	报表附注.....	21
§ 8	投资组合报告.....	37
8.1	期末基金资产组合情况.....	37
8.2	债券回购融资情况.....	37
8.3	基金投资组合平均剩余期限.....	37
8.4	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
8.5	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.....	38
8.6	“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	38
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	39
8.8	投资组合报告附注.....	39
§ 9	基金份额持有人信息.....	40
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	40

---

§ 10	开放式基金份额变动.....	40
§ 11	重大事件揭示.....	41
11.1	基金份额持有人大会决议.....	41
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.....	41
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	41
11.4	基金投资策略的改变.....	41
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	41
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.....	41
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	41
11.8	偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	42
11.9	其他重大事件.....	42
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息.....	44
§ 13	备查文件目录.....	44
13.1	备查文件目录.....	44
13.2	存放地点.....	45
13.3	查阅方式.....	45

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金	
基金简称	光大保德信添天利理财债券	
交易代码	360017	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年6月19日	
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	110,351,931.07份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	光大保德信添天利理财债券A类	光大保德信添天利理财债券B类
下属分级基金的交易代码	360017	360018
报告期末下属分级基金的份额总额	64,513,114.11份	45,838,816.96份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于银行存款等货币市场工具，力争获得超过税后人民币一年期定期存款基准利率的投资回报。
投资策略	<p>本基金将综合考虑各类投资品种的收益和风险特征，在保证基金资产安全性的基础上力争为投资人创造稳定的收益。同时，本基金将关注宏观经济走势、货币政策和财政政策的变化，结合对货币市场利率变动的预期，对投资组合进行管理。</p> <p>本基金投资于银行存款的比例不低于基金资产的80%，基金资产可以投资于上市商业银行、大型商业银行、国有商业银行、股份制商业银行、城市商业银行、邮政储蓄银行、农村商业银行、外资银行等银行的协议存款。若本基金投资的协议存款中未约定可提前支取并无利息损失的，则该笔存款的到期日不得晚于下一个开放日。本基金在投资银行存款时将对不同银行的银行存款收益率做深入的分析，同时结合各银行的信用等级、存款期限等因素的研究，综合考量整体利率市场环境及其变动趋势，在严格控制风险的前提下决定各银行存款的投资比例。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为税后1年期定期存款收益率。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的风险较低的品种，其预期收益和预期风险低于普通债券型基金、混合型基金和股票型基金。

### 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		光大保德信基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	伍文静	石立平
	联系电话	021-33074700-3105	010-63639161
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	shiliping@cebcbank.com
客户服务电话		400-820-2888, 021-53524620	95595
传真		021-63351152	010-63639132
注册地址		上海市延安东路222号外滩中心46楼	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址		上海市延安东路222号外滩中心46楼	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
邮政编码		200002	100033
法定代表人		林昌	唐双宁

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.epf.com.cn
基金年度报告备置地点	光大保德信基金管理有限公司、中国光大银行股份有限公司的办公场所。

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市卢湾区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
注册登记机构	光大保德信基金管理有限公司	上海市延安东路222号外滩中心大厦46层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2012年6月19日（基金合同生效日）至2012年12月31日	
	光大保德信添天利理财债券A类	光大保德信添天利理财债券B类
本期已实现收益	6,344,205.19	2,223,971.29

本期利润	6,344,205.19	2,223,971.29
本期基金份额净值收益率	1.7205%	1.8520%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末	
	光大保德信添天利理财债券 A 类	光大保德信添天利理财债券 B 类
期末基金资产净值	64,513,114.11	45,838,816.96
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2012 年末	
	光大保德信添天利理财债券 A 类	光大保德信添天利理财债券 B 类
基金份额累计净值收益率	1.7205%	1.8520%

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，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

（2）本基金利润分配是按日结转份额。

（3）本基金合同生效日为 2012 年 6 月 19 日，在本报告期内生效。

## 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

#### 1. 光大保德信添天利理财债券 A 类

阶段	份额净值 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	0.8172%	0.0005%	0.7667%	0.0000%	0.0505%	0.0005%
过去六个月	1.6121%	0.0005%	1.5368%	0.0001%	0.0753%	0.0004%
自基金成立起至今	1.7205%	0.0005%	1.6451%	0.0002%	0.0754%	0.0003%

#### 2. 光大保德信添天利理财债券 B 类

阶段	份额净值 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	①-③	②-④
----	--------------	-------------------	--------------------	----------------------	-----	-----

				④		
过去三个月	0.8774%	0.0006%	0.7667%	0.0000%	0.1107%	0.0006%
过去六个月	1.7361%	0.0005%	1.5368%	0.0001%	0.1993%	0.0004%
自基金成立起 至今	1.8520%	0.0005%	1.6451%	0.0002%	0.2069%	0.0003%

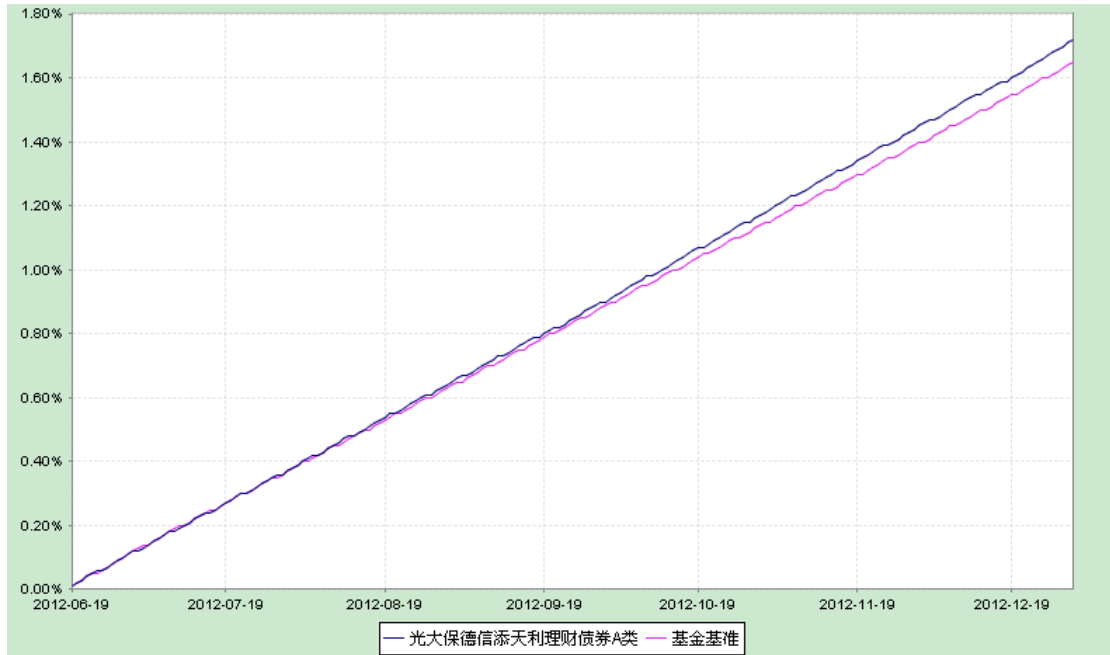
注：基金收益的分配是按日结转份额的。

### 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

光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金  
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

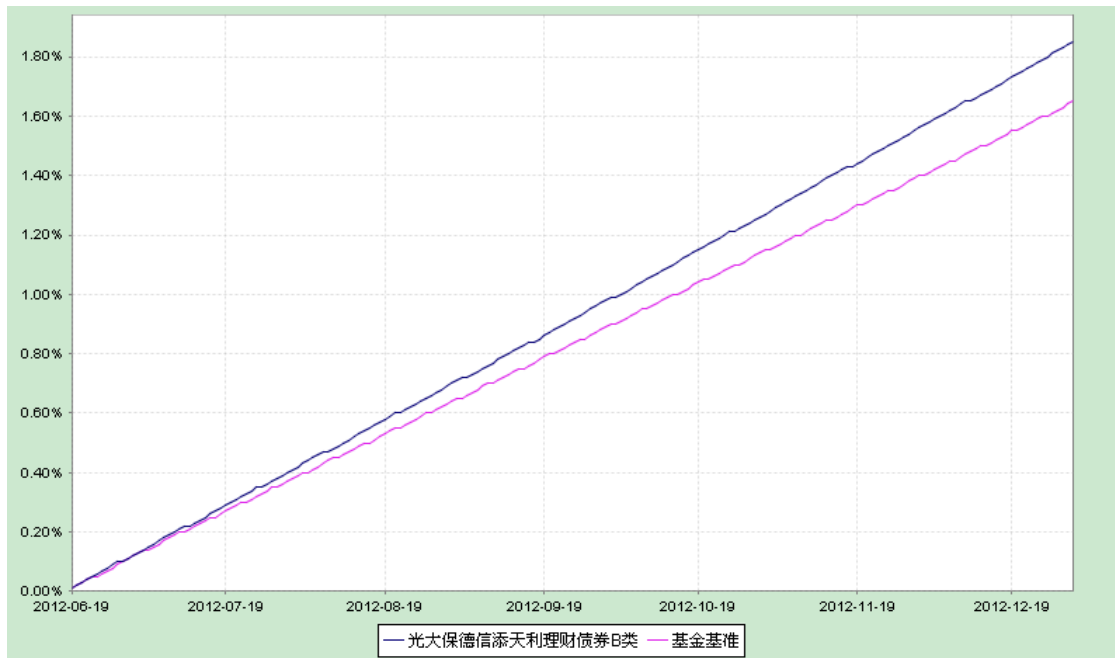
(2012年6月19日至2012年12月31日)

#### 1、光大保德信添天利理财债券 A 类



#### 2、光大保德信添天利理财债券 B 类





注：1、本基金合同于2012年6月19日生效，基金自合同生效起至报告期末不满一年。

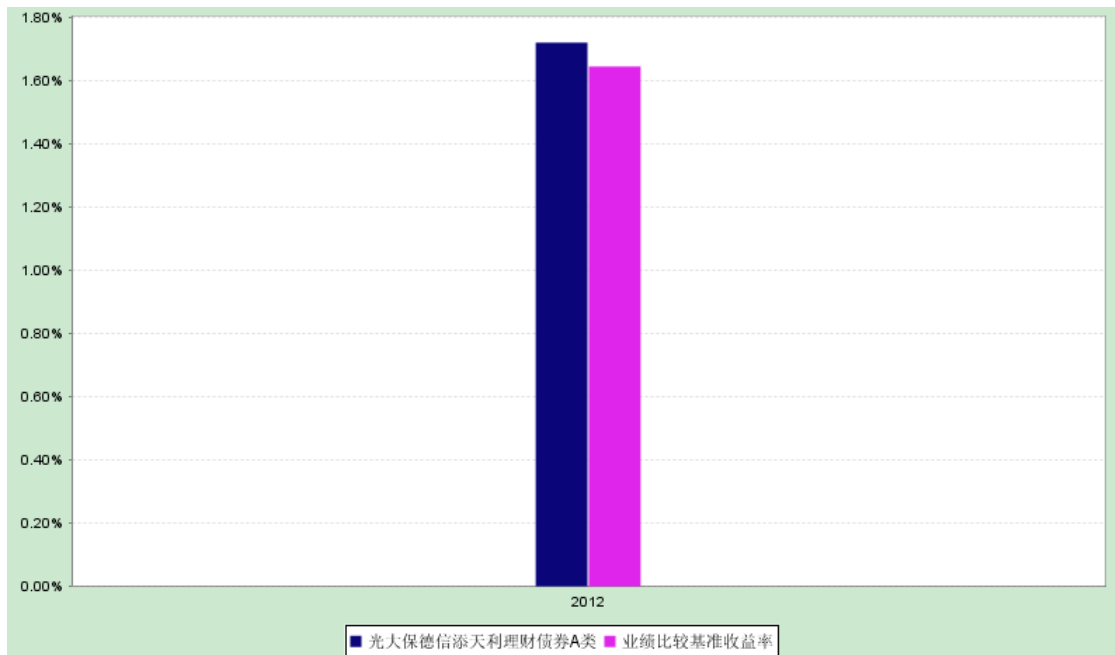
2、根据合同，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同第十四部分投资范围的有关约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

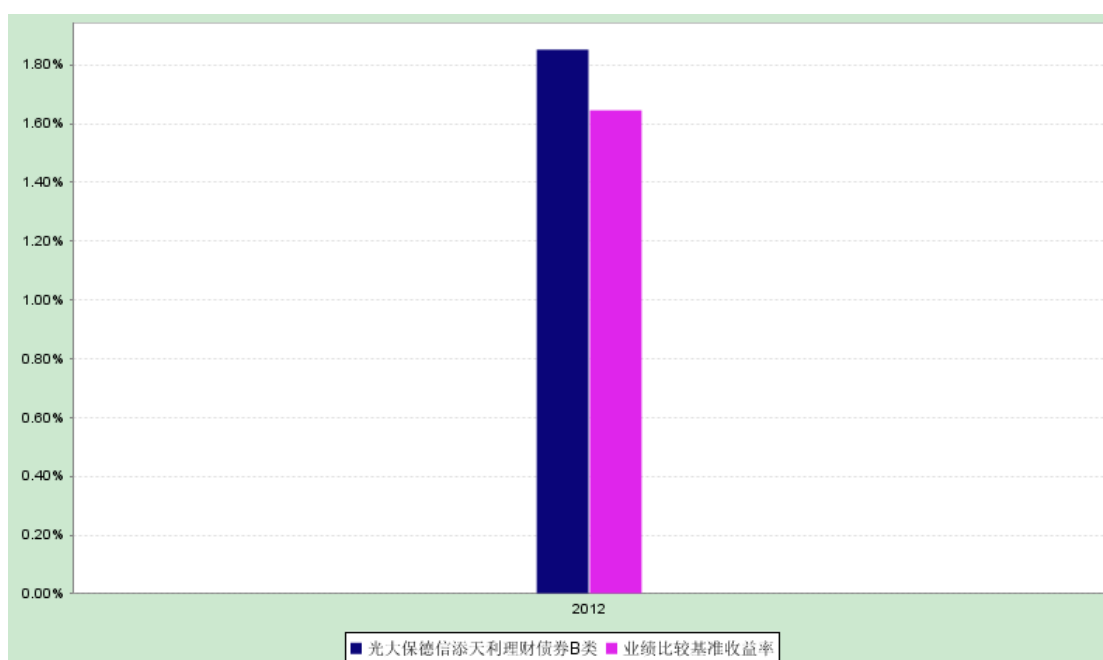
光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金

合同生效日以来净值收益率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

#### 1、光大保德信添天利理财债券A类



## 2、光大保德信添天利理财债券 B 类



注：本基金基金合同于 2012 年 6 月 19 生效，合同生效当年净值收益率按实际存续期计算，未按整个自然年度折算。

## 3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况

### 1、光大保德信添天利理财债券 A 类

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2012 年	6,344,205.19	-	-	6,344,205.19	-
合计	6,344,205.19	-	-	6,344,205.19	-

### 2、光大保德信添天利理财债券 B 类

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2012 年	2,223,971.29	-	-	2,223,971.29	-
合计	2,223,971.29	-	-	2,223,971.29	-

## § 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

光大保德信基金管理有限公司（以下简称“光大保德信”）成立于 2004 年 4 月，由中国光大集团控股的光大证券股份有限公司和美国保德信金融集团旗下的保德信投资管理有限公司共同创建，公司总部设在上海，注册资本为人民币 1.6 亿元人民币，两家股东分别持有 55% 和 45% 的股份。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务（涉及行政许可的凭许可证经营），今后，将在法律法规允许的范围内为各类投资者提供更多资产管理服务。

截至 2012 年 12 月 31 日，光大保德信旗下管理着 14 只开放式基金，即光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信货币市场基金、光大保德信红利股票型证券投资基金、光大保德信新增长股票型证券投资基金、光大保德信优势配置股票型证券投资基金、光大保德信增利收益债券型证券投资基金、光大保德信均衡精选股票型证券投资基金、光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信中小盘股票型证券投资基金、光大保德信信用添益债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金、光大保德信添盛双月理财债券型证券投资基金和光大保德信添天盈季度理财债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
韩爱丽	基金经 理	2012-06-19	-	6 年	韩爱丽女士，复旦大学经济学硕士，CFA。2006 年 7 月至 2010 年 8 月在上海浦东发展银行总行资金部从事固定收益交易、研究工作；2010 年 8 月加盟光大保德信基金管理有限公司，任高级债券研究员，现任光大保德信货币市场基金基金经理、光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金基金经理、光大保德

					信添盛双月理财债券型证券投资基金基金经理、光大保德信添天盈季度理财债券型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：对基金的首任基金经理，其任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司做出决定之日；非首任基金经理，其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

#### 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守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内未有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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规，制定了《光大保德信基金管理有限公司公平交易制度》，并建立《投资研究管理制度》及细则、《集中交易管理制度》、《异常交易监控与报告制度》、《投资对象备选库建立与维护管理办法》等制度作为公平交易执行的制度保障。在投资管理活动中公平的对待公司管理包括开放式基金、特定客户资产管理组合在内的所有组合，范围包括股票、债券等所有投资品种，以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。实行事前控制、事中监控、事后分析的全过程控制，形成有效的公平交易体系。具体的控制方法包括：

事前控制：1、研究人员通过内部晨会、邮件和统一的研究报告平台系统发布投资建议，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策等方面均享有平等机会；2、各个投资主体有明确的职责和权限划分，投资组合经理在权限范围内自主决策，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离；3、建立规范的一级市场股票债券询价申购和配售等审批流程、银行间债券价格公允性审批流程；建立和定期维护二级市场投资对象备选库和银行间市场交易对手库。

事中监控：1、主动管理型的基金，严禁同一投资组合或不同投资组合在同一交易日进行股票的反向交易，严禁不同投资组合在同一交易日进行债券的反向交易，确有需要进行日

---

内反向交易的，需要进行严格的审批流程；2、交易环节中所有指令严格按照“时间优先、价格优先”的原则执行指令，交易所指令均需通过恒生系统公平交易模块进行分发和委托下单。

事后分析：对公平交易的事后分析主要集中在对同一投资组合或不同投资组合临近交易日的反向交易和不同投资组合临近交易日的同向交易，同时在每季度和每年度，对公司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）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。特别的，对同一投资组合经理管理的不同投资组合之间的同向交易和反向交易重点进行分析。若出现异常交易行为，则及时进行核查并在向中国证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

对于公平交易同向交易价差分析，具体的分析方法如下：第一步，在 A 组合买入或者卖出某只证券的当日（3日、5日）内，统计 A 组合在此期间的买入或者卖出该股票的均价，同时统计 B 组合在同期、同方向交易同一只证券的均价，然后比较两者的均价差异，其中买入溢价率 =  $(B \text{ 组合交易均价} / A \text{ 组合交易均价} - 1)$ ，卖出溢价率 =  $(A \text{ 组合交易均价} / B \text{ 组合交易均价} - 1)$ ；第二步，将发生的所有交易价差汇总进行 T 检验，置信区间 95%，得到交易价差是否趋近于 0 的判断结果，并计算 A 组合与 B 组合同向交易中占优次数的比例为占优比例，用溢价率乘以成交量较少方的成交量计算得到 B 组合对 A 组合溢价金额大小，将所有同向交易溢价金额求和，除以 A 组合平均资产净值来计算对 A 组合净值的影响，称为单位溢价率。判断同向交易价格是否有显著差异有以下四条标准：交易价差不趋向于零、样本数大于 30、单位溢价率大于 1%、占优比例不在 45%-55%之间。

#### **4.3.2 公平交易制度的执行情况**

本报告期内，各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行。本基金主要投资标的为银行存款，与其他投资组合未发生交易所和银行间市场同向交易，未发现存在违反公平交易原则的现象。

#### **4.3.3 异常交易行为的专项说明**

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金与其他投资组合未发生交易所公开竞价同日反向交易。

---

#### 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

2012 年经济经历了上半年加速下行在政策放松刺激下企稳反弹。四季度，工业增加值连续三月走高，12 月达到 10.3%，较年内 8.9%的低点上涨 1.4 个百分点，投资和消费也稳中有升，固定资产投资四季度基本稳定在 20.7%，而 12 月消费也达到 15.2%，较 11 月上涨 0.3 个百分点。年末通胀符合预期，尽管 12 月在蔬菜价格超季节性上涨的带动下，食品价格环比上升将使得 CPI 有所反弹，但受翘尾因素影响，1 月又恢复 2%的低位。进出口方面，受海外经济疲软影响国内出口增速疲软，短期持续大幅改善可能性不大。信贷持续低迷，M2 维持在 14%左右的增速，虽然直接融资的力度在逐步加大，但仍无法撼动银行中长期贷款在社会融资总量中的主导地位，而且随着理财资金的膨胀，对实体经济资金产生了很大的分流作用。政策方面，货币政策持续宽松，央行上半年两次下调存款准备金率，6 月和 7 月初分别将基准利率下调 0.25%，而下半年则主要在公开市场上进行资金净投放，除了央票持续停发外，还通过持续逆回购以及新创设的 SLO 为市场提供流动性，抑制资金价格波动。资金面的宽松使得信用债收益率曲线呈现陡峭化下行，特别是短融的信用利差从年初的 300BP 缩减到目前的 150BP 左右，尽管由于信用违约的风险暴露在三季度有所反复，但总体下行态势明显。同业存款方面，4 季度进入年底阶段，较上季度继续好转，价格趋于稳定。特别是跨元旦和跨春节因素明显，银行报价呈现脉冲式上涨。按照契约要求，添天利基金主要投资于银行协议存款和银行间质押式回购，我们通过扩大交易对手范围、多方询价来提高组合的收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内光大保德信添天利理财债券 A 份额净值增长率为 1.7205%，业绩比较基准收益率为 1.6451%；光大保德信添天利理财债券 B 份额净值增长率为 1.8520%，业绩比较基准收益率为 1.6451%。

#### 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 2013 年 1 季度，通胀受翘尾因素影响 3 月会下探在 2.5%左右，整体不高，需求端将继续改善，政策存在放松空间。从公开市场到期投放来看，全年仅一万亿左右，尚未扣除约 6000 亿的逆回购到期。加上 SLO 的推出，预计资金面将维持整体宽松。但目前阶段的反弹不会改变经济增速中枢下移的趋势，特别是在结构调整过程中会出现个别行业企业盈利恶

---

化带来的信用违约事件，信用利差将向合理水平回归。在此背景下，添天利基金在兼顾收益性、流动性的前提下，会适时调整信用债的投资比例。操作上把平衡性作为第一位，谨慎投资，力求在投资标的种类、比例方面做到平衡和风险的可控。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在开展内部监察稽核工作时本着合规运作、防范风险、保障基金份额持有人利益的宗旨，由独立于各业务部门的督察长和监察稽核部对公司的经营管理、基金的投资运作、基金的销售等公司所有业务及员工行为规范等方面进行定期和不定期检查，及时发现问题并督促相关部门进行整改，并定期制作监察稽核报告报中国证监会、董事会和公司管理层。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面：

督察长和监察稽核部督促、协助各业务部门按照法律法规和监管机构规定对相关制度的合法性、规范性和时效性完善各项内部管理制度和业务流程，明确风险控制职责并具体落实相应措施，提高全体员工的风险意识，有效保障基金份额持有人的利益。

督察长和监察稽核部针对各部门具体业务建立了相应的检查指标及检查重点，通过现场检查、电脑监控、人员询问、重点抽查等一系列方法，定期对公司和基金日常运作的各项业务进行合法合规检查，并对基金投资交易行为过程实施实时监控，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理，并按规定定期出具监察稽核报告报送监管机关、董事会和公司管理层。此外，监察稽核部每年实施若干内部审计项目，以风险为导向，对公司重要业务环节提出流程改进建议。

根据中国证监会的规定，督察长和监察稽核部及时准确地向监管机关报送各项报告，并对公司所有对外信息，包括基金法定信息披露、基金产品宣传推介材料和媒体稿件等的合法合规情况进行事前审阅，确保其内容真实、准确、完整并符合中国证监会的相关规定。督察长和监察稽核部组织、协调各相关部门及时完成信息披露，确保公司的信息披露工作严格按照中国证监会规定的时间和方式进行。

在全公司范围内开展持续的学习和培训。督察长和监察稽核部先后组织了新员工入司培训，对相关人员进行法律法规的专项培训和年度监察培训，并组织员工开展学习、讨论，提高和加深了公司员工对基金法律法规的认识和理解，明确风险控制职责，树立全员内控意识。

根据董事会和管理层的要求，以及法规要求和公司业务发展的需要，督察长和监察稽核部

---

以风险为导向，计划并实施了数个内部专项审计项目，及时发现潜在的问题和风险，促使公司规范运作，切实保障基金份额持有人的合法权益。

通过上述工作，在本报告期内，本基金管理人对本基金的管理始均按照法律法规、基金合同、招募说明书和公司制度进行，充分维护和保障了基金持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用资金资产，以风险控制为核心，进一步提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》及监管机关有关规定和《光大保德信基金管理有限公司基金估值委员会工作制度》进行。日常估值由基金管理人和本基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计的财务核对同时进行。

报告期内，公司设立由公司分管高管、监察稽核部、运营部、投资研究部（包括基金经理、研究团队、数量分析小组）、IT 部代表人员组成的估值委员会。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，选择基金估值模型及估值模型假设，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。基金估值政策的议定和修改采用集体决策机制，对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由公司估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行、审计师沟通后形成建议，经公司管理层批准后由运营部具体执行。估值委员会向公司管理层提交推荐建议前，应审慎平衡托管行、审计师和基金同业的意见，并必须获得估值委员会三分之二以上成员同意。

公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和长期相关工作经历，并具有广泛的代表性，成员包括监察稽核代表 1 人、研究团队代表 1 人、基金经理代表 1 人、数量分析小组代表 1 人、基金会计代表 3 人、与估值相关的 IT 工程师 1 人、运营部主管 1 人、公司分管运营的高管 1 人。基金经理作为估值委员会成员参与讨论，仅享有一票表决权。

委员会对各相关部门和代表人员的分工如下：投资研究部和运营部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济



---

环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；运营部根据估值的专业技术对需要进行估值政策调整的品种提出初步意见提交估值委员会讨论，负责就估值政策调整的合规事宜与监察稽核部协商，负责执行基金估值政策进行日常估值业务并定期审核估值政策和程序的一致性，负责与托管行、审计师、基金同业、监管机关沟通估值调整事项；监察稽核部就估值程序的合法合规发表意见；投资研究部负责估值政策调整对投资业绩影响的评估，数量小组负责估值政策调整对投资绩效的评估；IT部就估值政策调整的技术实现进行评估。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据本基金合同及招募说明书（更新）等有关规定，本基金每日将基金净收益分配给基金份额持有人，并按自然月结转为相应的基金份额。

### **§ 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**

2012 年度，中国光大银行股份有限公司在光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，依法安全托管了基金的全部资产，对光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

#### **5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明**

2012 年度，中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、

托管协议等的规定，对基金管理人——光大保德信基金管理有限公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规的要求；各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人——光大保德信基金管理有限公司编制的“光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金 2012 年年度报告”进行了复核，报告中相关财务指标、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是真实、准确和完整的。

## § 6 审计报告

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字（2013）第20132号
审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金(以下简称“光大保德信添天利理财基金”)的财务报表，包括2012年12月31日的资产负债表、2012年6月19日(基金合同生效日)至2012年12月31日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是光大保德信添天利理财基金的基金管理人 光大保德信基金管理有限公司 管理层的责任。这种责任包括： (1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映； (2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我

	<p>们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	<p>我们认为，上述光大保德信添天利理财基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了光大保德信添天利理财基金2012年12月31日的财务状况以及2012年6月19日(基金合同生效日)至2012年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
注册会计师的姓名	薛竞 张晓艺
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所有限公司
会计师事务所的地址	上海市卢湾区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
审计报告日期	2013-03-25

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金

报告截止日：2012年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	110,550,268.56
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	-

其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	179,449.54
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		110,729,718.10
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2012年12月31日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		36,077.99
应付托管费		15,034.25
应付销售服务费		25,274.79
应付交易费用	7.4.7.7	-
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	301,400.00
负债合计		377,787.03
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	110,351,931.07
未分配利润	7.4.7.10	-
所有者权益合计		110,351,931.07
负债和所有者权益总计		110,729,718.10

注：1. 报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 110,351,931.07 份，其中 A 级基金份额总额 64,513,114.11 份；B 级基金份额总额 45,838,816.96 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2012 年 6 月 19 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金

本报告期：2012年6月19日（基金合同生效日）至2012年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012年6月19日（基金合同生效日）至2012年12月31日
<b>一、收入</b>		<b>10,307,620.86</b>
1. 利息收入		10,291,145.12
其中：存款利息收入	7.4.7.11	10,291,145.12
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		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	16,475.74
<b>减：二、费用</b>		<b>1,739,444.38</b>
1. 管理人报酬		663,595.21
2. 托管费		266,041.15
3. 销售服务费		507,408.02
4. 交易费用	7.4.7.18	-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.19	302,400.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>8,568,176.48</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>8,568,176.48</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金

本报告期：2012年6月19日（基金合同生效日）至2012年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2012年6月19日（基金合同生效日）至2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	823,786,627.31	-	823,786,627.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,568,176.48	8,568,176.48
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-713,434,696.24	-	-713,434,696.24
其中：1. 基金申购款	16,461,610.71	-	16,461,610.71
2. 基金赎回款	-729,896,306.95	-	-729,896,306.95
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-8,568,176.48	-8,568,176.48
五、期末所有者权益（基金净值）	110,351,931.07	-	110,351,931.07

报告附注为财务报表的组成部分

本报告从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：傅德修，主管会计工作负责人：梅雷军，会计机构负责人：王永万

### 7.4 报表附注

#### 7.4.1 基金基本情况

光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金(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[2012]第672号《关于核准光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金募集的批复》核准，由光大保德信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《光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集823,502,104.88元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第197号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金基金合同》于2012年6月19日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为823,786,627.31份基金份额，其中认

---

购资金利息折合 284,522.43 份基金份额。本基金的基金管理人为光大保德信基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金根据投资者认(申)购本基金的金额，对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用，因此形成不同的基金份额等级。本基金设 A 级和 B 级两级基金份额，两级基金份额分别设置基金代码，并单独公布每万份基金净收益和 7 日年化收益率。投资者可自行选择认(申)购的基金份额等级，不同基金份额等级之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为现金、通知存款、短期融资券、1 年及 1 年以内的银行定期存款、大额存单、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、期限在 1 年以内(含 1 年)的债券回购、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的资产支持证券及中期票据、期限在 1 年以内(含 1 年)的中央银行票据以及中国证监会、中国人民银行认可的其他货币市场工具。其中，本基金投资于银行存款的比例不低于基金资产的 80%，其中银行存款包括银行通知存款、银行定期存款、银行协议存款和备付金存款。本基金在每个开放期之前 10 个工作日至开放期后 10 个工作日的期间，不受上述投资比例限制，但必须保持现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：税后 1 年期定期存款收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人光大保德信基金管理有限公司于 2012 年 3 月 25 日批准报出。

#### **7.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2012 年 6 月 19 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年 6 月 19 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情

---

况等有关信息。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### **7.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2012 年 6 月 19 日(基金合同生效日) 至 2012 年 12 月 31 日。

##### **7.4.4.2 记账本位币**

本基金的记账本位币为人民币。

##### **7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

###### **(1)金融资产的分类**

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

###### **(2)金融负债的分类**

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金承担的其他金融负债包括各类应付款项等。

##### **7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认**

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部



---

分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### **7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则**

为了避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用债券投资的公允价值计算影子价格。当基金资产净值与影子价格的偏离达到或超过基金资产净值的 0.25% 时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括因类别调整而引起的 A、B 级基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

#### **7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量**

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.9 费用的确认和计量**

---

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.10 基金的收益分配政策**

每一基金份额等级的基金份额享有同等分配权。申购的基金份额不享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并按基金份额面值 1.00 元分配后转入所有者权益，每月集中宣告收益分配并将当月收益结转到投资人基金账户。

#### **7.4.4.11 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并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### **7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### **7.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实

务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 对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。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入，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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日
活期存款	1,550,268.56
定期存款	109,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	109,000,000.00
其他存款	-
合计	110,550,268.56

- 注：1. 定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。  
2. 本基金本期末未发生定期存款提前支取的情况。

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

本基金本期末未持有交易性金融资产。

##### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本期末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日
应收活期存款利息	341.11
应收定期存款利息	179,108.43
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	179,449.54

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

本基金本期末无应付交易费用。

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日
应付券商交易单元保证金	
应付赎回费	
预提费用	300,000.00
应付银行划款手续费	1,400.00
合计	301,400.00

#### 7.4.7.9 实收基金

##### 光大保德信添天利理财债券 A 类

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年6月19日（基金合同生效日）至2012年12月31日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	631,159,302.13	631,159,302.13
本期申购	12,800,241.10	12,800,241.10
本期赎回（以“-”号填列）	-579,446,429.12	-579,446,429.12
本期末	64,513,114.11	64,513,114.11

##### 光大保德信添天利理财债券 B 类

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年6月19日（基金合同生效日）至2012年12月31日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	192,627,325.18	192,627,325.18
本期申购	3,661,369.61	3,661,369.61
本期赎回（以“-”号填列）	-150,449,877.83	-150,449,877.83
本期末	45,838,816.96	45,838,816.96

注：1. 申购份额含红利再投和因份额升降级导致的强制调增份额，赎回份额含因份额升降级导致的强制调减份额。

2. 本基金自2012年5月28日至2012年6月12日止期间公开发售，共募集有效净认购资金823,502,104.88元。根据《光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入284,522.43元在本基金成立后，折算为284,522.43份基金份额，划入基金份额持有人账户。

#### 7.4.7.10 未分配利润

##### 光大保德信添天利理财债券 A 类

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	6,344,205.19	-	6,344,205.19
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	-6,344,205.19	-	-6,344,205.19
本期末	-	-	-

##### 光大保德信添天利理财债券 B 类

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	2,223,971.29	-	2,223,971.29
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	-2,223,971.29	-	-2,223,971.29
本期末	-	-	-

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2012年6月19日（基金合同生效日） 至2012年12月31日
活期存款利息收入	6,869.03
定期存款利息收入	10,277,211.09
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	7,065.00
其他	-
合计	10,291,145.12

#### 7.4.7.12 股票投资收益

本基金本期无股票投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

本基金本期无债券投资收益。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本期无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

本基金本期无股利收益。

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本期无公允价值变动收益。

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期2012年6月19日（基金合同生效日） 至2012年12月31日
基金赎回费收入	-
募集期间认购资金产生的利息收入	16,475.74
合计	16,475.74

#### 7.4.7.18 交易费用

本基金本期无交易费用。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期2012年6月19日（基金合同生效日） 至2012年12月31日
审计费用	60,000.00
信息披露费	240,000.00
银行划款手续费	2,400.00
合计	302,400.00

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
光大保德信基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司（“光大银行”）	基金托管人、基金代销机构
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
保德信投资管理有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期2012年6月19日（基金合同生效日） 至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	663,595.21
其中：支付销售机构的客户维护费	268,773.02

注：支付基金管理人光大保德信基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 6 月 19 日（基金合同生效日） 至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	266,041.15

注：支付基金托管人光大银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1%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 X 0.1% / 当年天数。

###### 7.4.10.2.3 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 2012年6月19日（基金合同生效日）至2012年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	光大保德信添天利理财 债券 A 类	光大保德信添天利理 财债券 B 类	合计
光大保德信基金管理有限公司	233.07	2,398.96	2,632.03
光大银行	230,134.97	3,357.49	233,492.46
光大证券	18.22	0.00	18.22
合计	230,386.26	5,756.45	236,142.71

注：支付基金销售机构的光大保德信添天利理财基金 A 级和光大保德信添天利理财基

金 B 级的销售服务费分别按前一日该类基金资产净值 0.25% 和 0.01% 的年费率计提。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times \text{约定年费率} / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2012年6月19日（基金合同生效日）至2012年12月31日	
	光大保德信添天利理财债券A类	光大保德信添天利理财债券B类
基金合同生效日（2012年6月19日）持有的基金份额	-	45,008,100.00
期间申购/买入总份额	-	830,716.96
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	-	45,838,816.96
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	100%

注：1. “期间申购/买入总份额”中为红利再投份额，本期红利再投份额为 830,716.96 份。

2. 基金管理人光大保德信基金管理有限公司在本期认购本基金的交易委托光大证券办理。

##### 7.4.10.4.2 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

注：本基金本期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

##### 7.4.10.5 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 2012年6月19日（基金合同生效日）至2012年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
光大银行	34,550,268.56	61,974.08

注：本基金的银行存款由基金托管人光大银行保管，活期存款部分按银行同业利率计息，定期存款部分按协议利率计息。

##### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况



本基金本期未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 1、光大保德信添天利理财债券 A 类

单位：人民币元

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
6,344,205.19	-	-	6,344,205.19	-

##### 2、光大保德信添天利理财债券B类

单位：人民币元

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
2,223,971.29	-	-	2,223,971.29	-

注：本基金在本年度累计分配收益8,568,176.48元，以红利再投资方式转入实收基金8,568,176.48元。

#### 7.4.12 期末（2012年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末无暂时停牌等流通受限的股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的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。

本基金的基金管理人的风险管理体系包括三个层次：第一层次是基于自我评估和管理的业务/职能部门；第二层次是公司经营层的风险管理工作委员会；第三层次是董事会下设的

---

风险管理委员会。

各业务/职能部门是公司风险管理工作最直接的实施者，负责根据公司风险管理政策和制度，制订本部门的风险管理计划、工作流程及相关管理责任，并报请风险管理委员会审议批准；对本部门的主要风险指标，以及相关的测量、管理方法提出建议，并及时更新，报请风险管理委员会审议批准；实施本部门的风险管理日常工作，定期进行自我评估，并向风险管理委员会报告评估情况。

风险管理委员会是公司经营层面负责风险管理的最高权力机构，根据公司董事会和风险管理委员会制订的风险管理政策和授权，负责公司日常的风险管理工作。

风险管理委员会是公司风险管理的最高权力机构，其机构组成、运行方式和相应职责应由董事会规定。

本基金的基金管理人风险管理部门建立了对基金进行风险评估的数量化系统，可以从各个不同的层面对基金所承受的各类风险进行密切跟踪。

#### **7.4.13.2 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。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金投资于同一发行主体发行的信用类投资品种不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。本基金存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款不超过基金资产净值的 30%，存放在不具有基金托管资格而具有基金代销业务资格或合格境外机构投资者托管资格的同一商业银行的存款不超过基金资产净值的 5%。本基金主要投资于银行存款，银行存款由银行信用作为支撑，信用风险相对其他信用类货币市场工具更小。本基金的活期银行存款和部分定期银行存款存放在本基金的托管行中国光大银行股份有限公司，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。其他定期存款存放在具有基金托管资格的上海浦东发展银行股份有限公司、平安银行股份有限公司和华夏银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金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。在现券的选择方面，本基金所投资的央行票据、国债、金融债等投资品种其发行主体分别为央行、财政部和政策性银行，因此不存在重大违约风险。而信用品种的投资，本基金主要对发行主体的资质、发行人长期评级、发行人授信额度等指标进行综合考量，以控制投资品种的

---

违约风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下的债券，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2012 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

#### **7.4.13.3 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于开放期内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于开放期内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主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资于银行存款的比例不低于基金资产的 80%，其中银行存款包括银行通知存款、银行定期存款、银行协议存款和备付金存款。本基金在每个开放期之前 10 个工作日至开放期后 10 个工作日的期间，不受上述投资比例限制，但必须保持现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。

本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还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，正回购上限一般不超过基金资产净值的 20%。

于 2012 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行存款，因此存在相应的利率风险。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012年12 月31日	1个月以内	1-3 个月	3个月 -1年	1年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	1,550,268.56	109,000,000.00	-	-	-	110,550,268.56
应收利息	-	-	-	-	179,449.54	179,449.54
资产总计	1,550,268.56	109,000,000.00	-	-	179,449.54	110,729,718.10
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	36,077.99	36,077.99
应付托管费	-	-	-	-	15,034.25	15,034.25
应付销售服务费	-	-	-	-	25,274.79	25,274.79
其他负债	-	-	-	-	301,400.00	301,400.00
负债总计	-	-	-	-	377,787.03	377,787.03
利率敏感度缺口	1,550,268.56	109,000,000.00	-	-	-198,337.49	110,351,931.07

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。

##### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

---

于 2012 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### **7.4.13.4.2 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。

#### **7.4.13.4.3 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。本基金主要投资于银行存款，因此无重大其他价格风险。

##### **7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口**

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。本基金主要投资于银行存款，因此无重大其他价格风险。

#### **7.4.14 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)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。

###### **(b)以公允价值计量的金融工具**

###### **(i)金融工具公允价值计量的方法**

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

###### **(ii)各层级金融工具公允价值**

于 2012 年 12 月 31 日，本基金未持有以公允价值计量的金融工具。

###### **(iii)公允价值所属层级间的重大变动**

无。

(iv)第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(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	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	110,550,268.56	99.84
4	其他各项资产	179,449.54	0.16
	合计	110,729,718.10	100.00

### 8.2 债券回购融资情况

本报告期本基金未进行债券回购融资。

### 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	76
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	92
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	0

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

报告期内投资组合平均剩余期限未有违规超过 120 天的情况。

### 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	1.40	-
	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	98.77	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—180 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天 (含)	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	100.17	-

### 8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末本基金未投资债券。

### 8.5 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

报告期末本基金未投资债券。

### 8.6 “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	0
报告期内偏离度的最高值	-
报告期内偏离度的最低值	-
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	-

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

报告期末本基金未投资资产支持证券。

## 8.8 投资组合报告附注

### 8.8.1 基金计价方法说明

(1)、本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内摊销，每日计提损益。(2)、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，采用市场利率或交易价格，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当基金资产净值与影子定价的偏离达到或超过基金资产净值的一定幅度时，或基金管理人认为发生了其他的重大偏离时，基金管理人可以与基金托管人商定后进行调整，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值，确保以摊余成本法计算的基金资产净值不会对基金持有人造成实质性的损害。

(3)、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方法估值。(4)、如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。

**8.8.2** 本报告期内不存在剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20%的情况。

**8.8.3** 本基金本报告期内投资的前十名证券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。

### 8.8.4 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	179,449.54
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	179,449.54



## § 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
光大保德信添天利理财债券A类	1,772	36,406.95	4,869,659.55	7.55%	59,643,454.56	92.45%
光大保德信添天利理财债券B类	1	45,838,816.96	45,838,816.96	100.00%	0.00	0.00%
合计	1,773	62,240.23	50,708,476.51	45.95%	59,643,454.56	54.05%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

本报告期末基金管理人的从业人员均未持有本基金的份额。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	光大保德信添天利理财债券 A 类	光大保德信添天利理财债券 B 类
基金合同生效日(2012年6月19日)基金份额总额	631,159,302.13	192,627,325.18
本报告期基金总申购份额	12,800,241.10	3,661,369.61
减：本报告期基金总赎回份额	579,446,429.12	150,449,877.83
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	64,513,114.11	45,838,816.96

---

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 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、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金聘任普华永道中天为其审计的会计师事务所。报告年度应支付给聘任普华永道中天会计师事务所的报酬为人民币 6 万元,目前该审计机构已提供审计服务的连续年限为 1 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未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

本报告期末租用交易单元。

专用交易单元的选择标准和程序

(1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

基金管理人选择证券经营机构，并选用其交易单元供本基金买卖证券专用，应本着安全、高效、低成本，能够为本基金提供高质量增值研究服务的原则，对该证券经营

机构的经营情况、治理情况、研究实力等进行综合考量。

基本选择标准如下：

实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；

- 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
  - 经营行为规范，近两年未发生重大违规行为而受到证监会处罚；
  - 内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
  - 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求，并能为本基金提供全面的信息服务；
  - 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务；
  - 对于某一领域的研究实力超群，或是能够提供全方面，高质量的服务。
- (2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序
- 投资研究团队按照 (1) 中列出的有关经营情况、治理情况的选择标准，对备选的证券经营机构进行初步筛选；
  - 对通过初选的各证券经营机构，投资研究团队各成员在其分管行业或领域的范围内，对该机构所提供的研究报告和信息资讯进行评分。
  - 根据各成员评分，得出各证券经营机构的综合评分。
  - 投资研究团队根据各机构的得分排名，拟定要选用其专用交易单元的证券经营机构，并报本管理人董事会批准。
  - 经董事会批准后，由本管理人交易部门、运营部门配合完成专用交易单元的具体租用事宜。

### 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

报告期内偏离度绝对值没有超过 0.5%(含)以上。

### 11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金托管协议	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2012-12-17
2	光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金基金合同	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2012-12-17
3	关于修改《光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金基金合同》和《光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金托管协议》的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2012-12-17
4	光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金 2012 年第 2 期运作周期开放日安排的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2012-12-05
5	关于光大保德信基金管理有限公司开通移	《中国证券报》、《上海	2012-11-16

	动终端网上直销基金交易、查询业务的公告	证券报》、《证券时报》	
6	关于旗下部分基金新增北京展恒基金销售有限公司为代销机构并参与北京展恒交易费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2012-10-31
7	光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金 2012 年第 3 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2012-10-25
8	关于光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金收益率的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2012-09-20
9	关于旗下基金新增诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2012-09-15
10	关于对使用中国农业银行借记卡通过网上直销系统办理基金申购业务实施申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2012-09-14
11	光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金 2012 年第 1 期运作周期开放日安排的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2012-09-11
12	关于旗下光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金新增上海浦东发展银行股份有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2012-08-21
13	关于光大保德信基金管理有限公司网上直销系统开通通联支付基金业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2012-07-21
14	关于旗下基金新增上海天天基金销售有限公司为代销机构并参与上海天天基金销售有限公司交易费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2012-07-18
15	关于旗下光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金新增浙江稠州商业银行股份有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2012-07-17
16	关于旗下基金新增上海好买基金销售有限公司为代销机构并参与上海好买基金销售有限公司网上交易费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2012-07-12
17	关于旗下基金新增杭州数米基金销售有限公司为代销机构并参与杭州数米基金销售有限公司交易费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2012-07-12
18	关于旗下基金新增杭州数米基金销售有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2012-07-03
19	光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金基金合同生效公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2012-06-20
20	关于旗下光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金新增中国工商银行股份有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2012-06-06
21	关于旗下光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金新增深圳众禄基金销售有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2012-06-05

22	关于旗下光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金新增平安银行股份有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2012-06-02
23	关于旗下光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金新增上海好买基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2012-05-26
24	光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金基金份额发售公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2012-05-25
25	光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金招募说明书	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2012-05-25
26	光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金基金合同摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2012-05-25

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金的文件
- 2、光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金基金合同
- 3、光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金招募说明书
- 4、光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金托管协议
- 5、光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金法律意见书
- 6、光大保德信基金管理有限公司的业务资格批件、营业执照、公司章程
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 8、报告期内光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

---

### 13.2 存放地点

上海市延安东路 222 号外滩中心大厦 46 层本基金管理人办公地址。

### 13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。客户服务中心电话：4008-202-888，021-53524620。公司网址：[www.epf.com.cn](http://www.epf.com.cn)。

光大保德信基金管理有限公司

二〇一三年三月二十七日