

光大保德信信用添益债券型证券投资基金
2015 年年度报告摘要
2015 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：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年三月二十八日

§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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 25 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计，安永华明会计师事务所为本基金财务出具了 2015 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 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 基金简称 | 光大保德信信用添益债券 | |
| 基金主代码 | 360013 | |
| 交易代码 | 360013 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2011 年 5 月 16 日 | |
| 基金管理人 | 光大保德信基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国民生银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 236,015,985.68 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 光大保德信信用添益债券 A 类 | 光大保德信信用添益债券 C 类 |
| 下属分级基金的交易代码 | 360013 | 360014 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 177,154,483.28 份 | 58,861,502.40 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金在充分控制风险和保持资产流动性的基础上，通过严格的信用分析和利差变动趋势分析，在获取当期收益的同时，力争实现基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | 本基金在充分考虑债券市场运行状况和特征的基础上，将投资策略分解为资产配置策略、债券市场投资策略、股票市场投资策略和套利投资策略。结合国内债券市场的基本结构和流动性分析，本基金将债券市场投资策略主要分为利率策略、信用策略、可转债策略和杠杆策略。本基金将充分结合宏观经济和证券市场的形势，运用丰富的投资策略，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期增值。 |
| 业绩比较基准 | 中证全债指数 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的风险较低的品种，其预期收益和风险高于货币市场基金，但低于股票型基金和混合型基金。 |

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 | 中国民生银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 魏丹 | 罗菲菲 |
| | 联系电话 | 021-33074700-3226 | 010-58560666 |
| | 电子邮箱 | epfservice@epf.com.cn | tgbfxjdzx@cmbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4008-202-888，021-53524620 | 95568 |
| 传真 | | 021-63351152 | 010-58560798 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|----------------------------------|
| 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、中国民生银行股份有限公司的办公场所。 |

§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 | 2015 年 | | 2014 年 | | 2013 年 | |
|----------------------|-------------------------|-------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|---------------------|
| | 光大保德信 信用添益债 券 A 类 | 光大保德信 信用添益债 券 C 类 | 光大保德信信 用添益债券 A 类 | 光大保德信信 用添益债券 C 类 | 光大保德信信 用添益债券 A 类 | 光大保德信信用 添益债券 C 类 |
| 本期已实现收益 | 29,446,822.26 | 2,635,175.09 | 13,770,750.79 | 267,858.39 | 16,846,621.55 | 8,043,219.06 |
| 本期利润 | 23,675,091.03 | 728,055.60 | 69,108,384.02 | 10,351,155.81 | -23,025,219.96 | -7,717,688.96 |
| 加权平均 基金份额 本期利润 | 0.1166 | 0.0150 | 0.1853 | 0.1710 | -0.0612 | -0.0449 |
| 本期基金 份额净值 增长率 | 8.07% | 7.79% | 19.83% | 19.46% | -5.38% | -5.70% |
| 3.1.2 期末数 据和指标 | 2015 年末 | | 2014 年末 | | 2013 年末 | |
| | 光大保德信信用 添益债券 A 类 | 光大保德信信用 添益债券 C 类 | 光大保德信信用 添益债券 A 类 | 光大保德信信用 添益债券 C 类 | 光大保德信信用 添益债券 A 类 | 光大保德信信用添 益债券 C 类 |
| 期末可供 分配基金 份额利润 | 0.0092 | 0.0097 | 0.0388 | 0.0319 | -0.0611 | -0.0686 |
| 期末基金 资产净值 | 185,929,070.5 4 | 61,800,804.93 | 413,828,314.47 | 51,999,184.14 | 365,003,231.83 | 91,410,216.24 |
| 期末基金 份额净值 | 1.050 | 1.050 | 1.105 | 1.097 | 0.939 | 0.931 |

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 光大保德信信用添益债券 A 类：

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 | 2.39% | 0.14% | 2.75% | 0.07% | -0.36% | 0.07% |
| 过去六个月 | 1.38% | 0.25% | 5.39% | 0.07% | -4.01% | 0.18% |
| 过去一年 | 8.07% | 0.43% | 8.74% | 0.08% | -0.67% | 0.35% |
| 过去三年 | 22.54% | 0.31% | 14.90% | 0.09% | 7.64% | 0.22% |
| 自基金合同生效起至今 | 38.39% | 0.26% | 15.99% | 0.09% | 22.40% | 0.17% |

2. 光大保德信信用添益债券 C 类：

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 | 2.22% | 0.14% | 2.75% | 0.07% | -0.53% | 0.07% |
| 过去六个月 | 1.24% | 0.26% | 5.39% | 0.07% | -4.15% | 0.19% |
| 过去一年 | 7.79% | 0.44% | 8.74% | 0.08% | -0.95% | 0.36% |
| 过去三年 | 21.42% | 0.31% | 14.90% | 0.09% | 6.52% | 0.22% |
| 自基金合同生效起至今 | 36.50% | 0.27% | 15.99% | 0.09% | 20.51% | 0.18% |

业绩比较基准收益率=100%*中债综合指数收益率，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

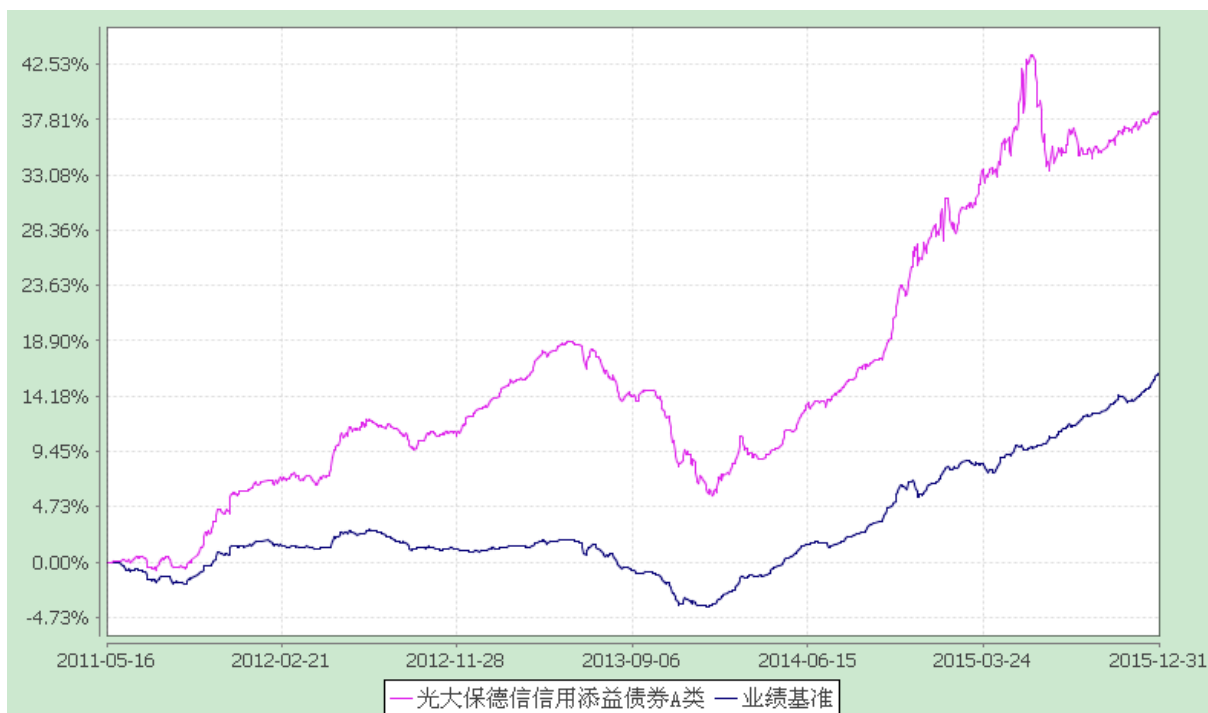
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

光大保德信信用添益债券型证券投资基金

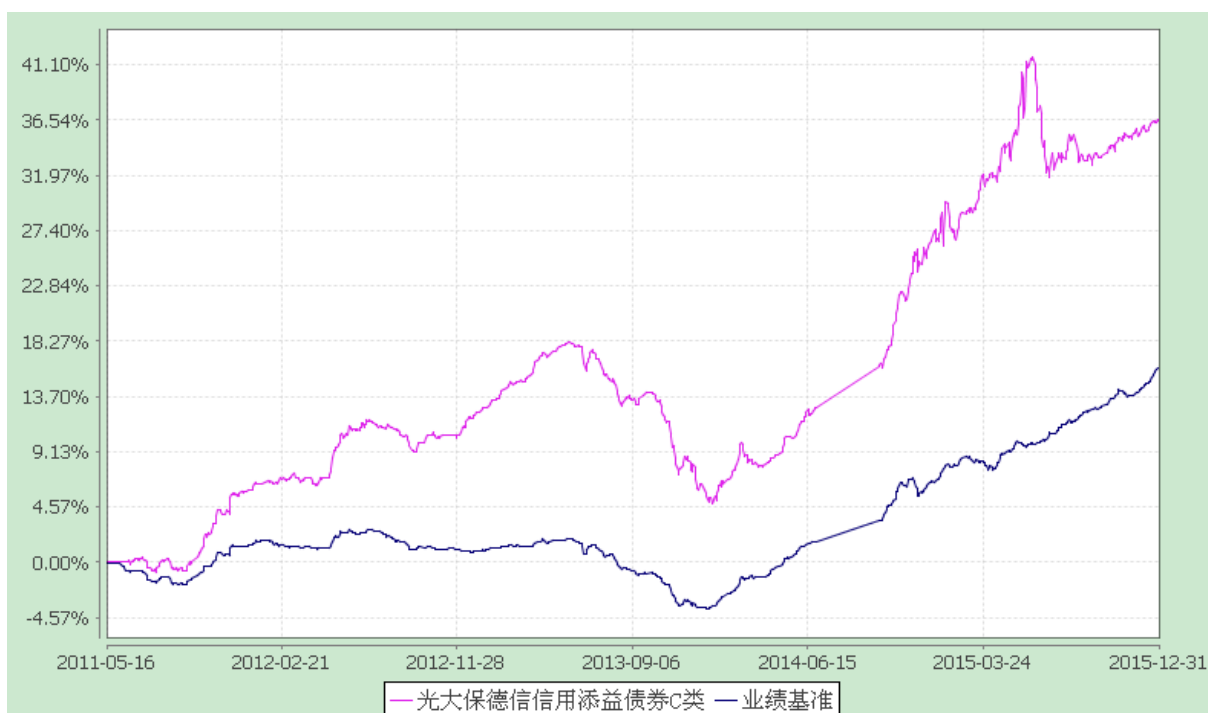
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2011 年 5 月 16 日至 2015 年 12 月 31 日)

1、光大保德信信用添益债券 A 类



2、光大保德信信用添益债券 C 类



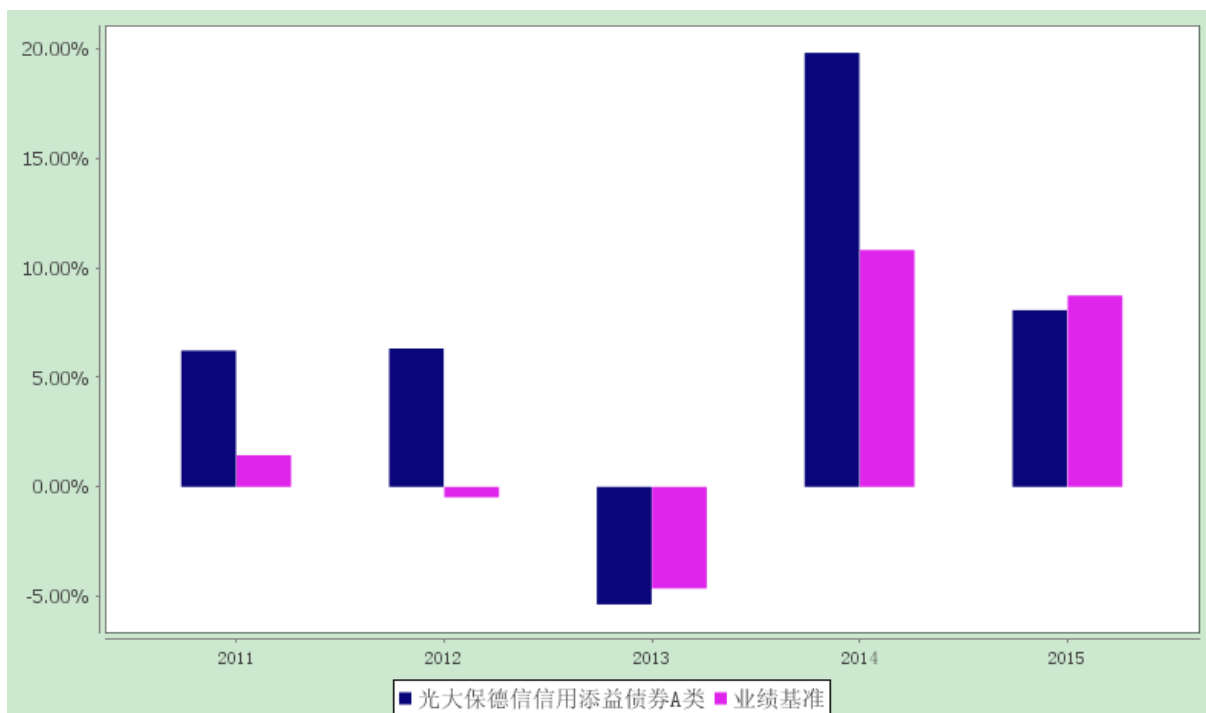
注：根据基金合同的规定，本基金建仓期为 2011 年 5 月 16 日至 2011 年 11 月 15 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

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

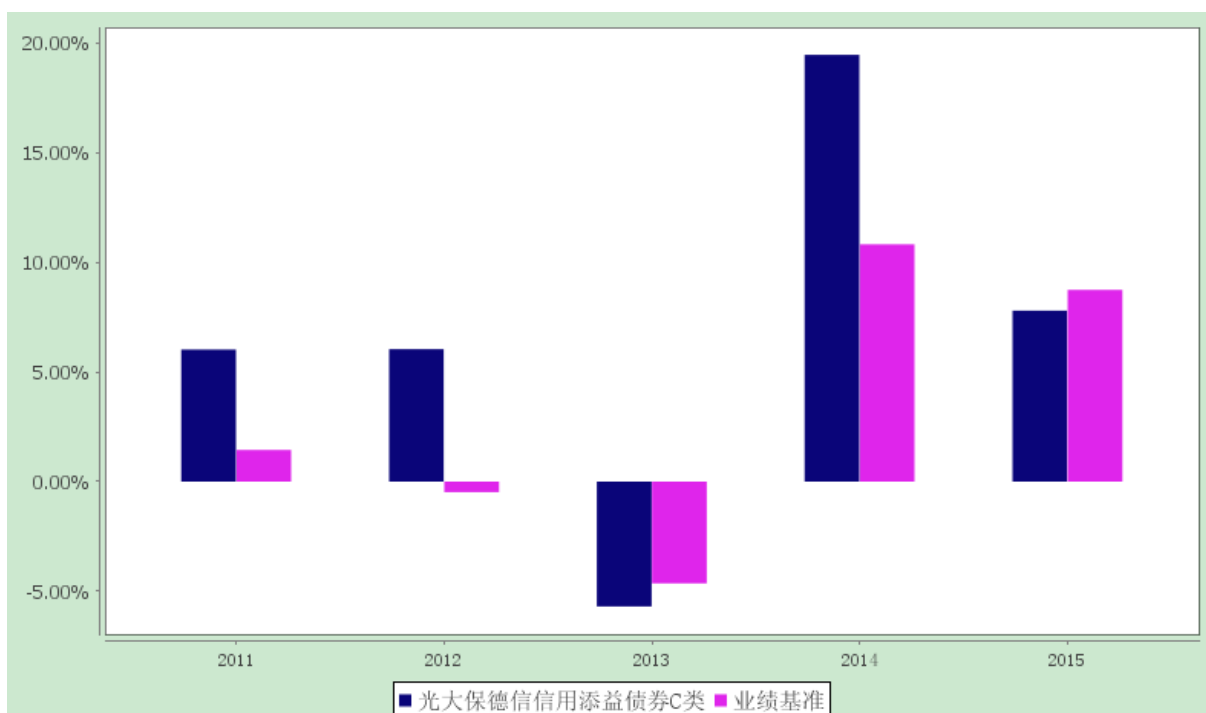
光大保德信信用添益债券型证券投资基金

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、光大保德信信用添益债券 A 类



2、光大保德信信用添益债券 C 类



注：本基金基金合同于 2011 年 5 月 16 日生效，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 过去三年基金的利润分配情况

1、光大保德信信用添益债券 A 类：

单位：人民币元

| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|------|-------------|---------------|--------------|---------------|----|
| 2014 | 0.200 | 7,367,980.09 | 139,480.20 | 7,507,460.29 | - |
| 2013 | 0.500 | 8,032,630.71 | 8,411,379.74 | 16,444,010.45 | - |
| 2015 | 1.415 | 33,685,473.77 | 775,254.36 | 34,460,728.13 | - |
| 合计 | 2.115 | 49,086,084.57 | 9,326,114.30 | 58,412,198.87 | - |

2、光大保德信信用添益债券 C 类：

单位：人民币元

| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|------|-------------|---------------|--------------|---------------|----|
| 2014 | 0.150 | 583,054.47 | 113,902.94 | 696,957.41 | - |
| 2013 | 0.500 | 7,137,499.78 | 1,621,742.28 | 8,759,242.06 | - |
| 2015 | 1.300 | 5,836,434.41 | 1,108,797.44 | 6,945,231.85 | - |
| 合计 | 1.950 | 13,556,988.66 | 2,844,442.66 | 16,401,431.32 | - |

§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 2015 年 12 月 31 日，光大保德信旗下管理着 24 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、光大保德信红利混合型证券投资基金、光大保德信新增长混合型证券投资基金、光大保德信优势配置混合型证券投资基金、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混合型证券投资基金、光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信中小盘混合型证券投资基金、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混合型证券投资基金、光大保德信添盛双月理财债券型证券投资基金、光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金、光大保德信现金宝货币市场基金、光大保德信银发商机主题混合型证券投资基金、光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金、光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金、光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信一带一路战略主题

混合型证券投资基金、光大保德信耀钱包货币市场基金、光大保德信欣鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信尊尚一年定期开放债券型证券投资基金和光大保德信中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金。

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 | | |
| 陈晓 | 基金经理 | 2014-01-30 | - | 6 年 | 陈晓女士，硕士。2007 年毕业于哈尔滨工业大学数学专业，2010 年获得南开大学精算学专业硕士学位。2010 年 7 月加入光大保德信基金管理有限公司，先后担任投资部研究助理、固定收益研究员、固定收益高级研究员。现任光大保德信增利收益债券型证券投资基金基金经理、光大保德信信用添益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。

陈晓女士因个人原因（休产假）无法正常履行职务，本基金管理人依据有关法律法规及公司制度的规定，批准陈晓女士自 2016 年 2 月 18 日开始休假，暂定休假持续至 2016 年 6 月 6 日止。在陈晓女士休产假期间，由杨焯超先生和王慧杰女士代为共同管理本基金。

杨焯超先生简历：

2007 年毕业于复旦大学世界经济系，2010 年获得复旦大学世界经济系的硕士学位。

自 2010 年 7 月加入光大保德信基金管理有限公司，先后担任市场部产品助理、产品经理（负责产品设计研究等），2014 年 3 月至今担任固定收益部研究员，现任光大保德信耀钱包货币市场基金基金经理，光大保德信增利收益债券型证券投资基金基金经理（暂代），光大保德信信用添益债券型证券投资基金基金经理（暂代），光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

王慧杰女士简历：

2006 年毕业于南开大学数学系信息与计算科学专业，2009 年获得美国普渡大学计算金融方向硕士学位和应用统计学研究生学历资格认证。

王慧杰女士于 2009 年 6 月至 2011 年 8 月在彭博资讯社纽约总部担任利率衍生品研发员；2011

年 8 月加入光大保德信基金管理有限公司，担任固定收益研究员。现任光大保德信货币市场基金基金经理、光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金基金经理，光大保德信增利收益债券型证券投资基金基金经理（暂代），光大保德信信用添益债券型证券投资基金基金经理（暂代）。

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。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，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。在同向交易价差分析中，出现溢价率统计显著主要原因是市场交易价格波动较大且组合经理交易时机的选择不同，本基金管理人旗下所有投资组合从投资信息的获取、投资决策到交易执行的各个环节均按照公平交易制度的要求进行，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。本基金与公司旗下其他投资组合在交易所市场与银行间市场未发生较少单边成交量大于 5% 的同日反向交易。

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

2015 年宏观经济数据显示我国经济运行总体仍呈现下行趋势。从公布的经济数据来看，今年以来工业增加值整体呈现下行态势，虽然 11 月工业增加值略有反弹，但仍不改趋势性回落。从经济数据的分项指标来看，2015 年固定资产投资继续放缓，数据显示今年前 11 个月同比增长下滑至 10.2%，较三季度进一步下台阶。房地产投资也继续放缓，最新 11 月份的房地产投资累计增速仅为 1.3%，相比三季度末的 2.6% 进一步下行。虽然 2015 年全年在放松的房地产政策和宽松的货币环境带动下，

房地产销售数据持续回升，但开发商拿地热情始终低迷，房地产投资也一直未有起色，未来房地产行业整体下行的态势还将维持很长时间。前 11 个月制造业投资增速也不理想，从年初 10.6% 的累计增速一路下滑至 11 月份的 8.4%。进出口方面，4 季度进出口和贸易顺差维持稳定。通货膨胀方面，2015 年 4 季度 CPI 相比 3 季度进一步下行，11 月份当月 CPI 同比增长 1.5%。PPI 则同比持续在低位徘徊，价格指数变化也显示 2015 年 4 季度实体经济的需求仍比较弱。展望 2016 年，总需求扩张仍然乏力，在供给侧改革和产能出清的背景下，短期内增长放缓的趋势仍将持续，通胀水平整体温和可控，工业品价格和 PPI 也将在低位运行。

汇率方面，12 月美联储加息之后，人民币汇率继 8 月之后再次出现了较大幅度的贬值，并且贬值预期目前仍然处在相对较高的水平。预期未来外汇占款的流失或将继续，我们认为未来央行采取降准等对冲性政策的概率依然较高。货币政策方面，央行在 2015 年 4 季度宽松的步伐略有放缓，仅在 10 月下旬实施双降，此后尚未有进一步宽松操作。受制于美联储加息的外部压力，货币政策降息的空间相对有限，但是通过降准对冲外汇占款流失的空间仍比较大。财政政策方面，在货币政策空间受限及利率传导机制不畅的背景下，明年财政政策有望扮演更重要的角色，但受制于经济下行和财政收入的放缓，2016 年国债的发行量有望较 2015 年有所增长，全年财政赤字率预期在 3% 附近。整体维持未来货币政策偏宽松和财政政策偏中性的预期。

在债券市场的运行方面，2015 年债券行情整体涨势良好，尤其下半年利率出现较大幅度下行，12 月底 10Y 国开利率水平在 3.13% 附近。信用债也得益于配置需求的强劲，延续此前的牛市。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内光大保德信信用添益债券 A 份额净值增长率为 8.07%，业绩比较基准收益率为 8.74%，光大保德信信用添益债券债券 C 份额净值增长率为 7.79%，业绩比较基准收益率为 8.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在基金的日常操作中，在 2015 年组合仍然以信用债持仓为主，配合参与利率债波段行情的操作风格。我们根据宏观经济的走势，我们继续维持中等久期和适度杠杆的策略，密切关注由短期市场调整带来的阶段性波段操作机会，较为有效的控制债市波动的风险，获得相对稳定的投资收益。信用债资质方面，在 2015 年继续降低了低等级信用债的配置，增持优质公司债，组合规避信用风险和流动性风险。

根据目前已经公布的宏观经济数据和国际经济形势，宏观经济增速将在窄幅区间波动，宏观政策将以调结构为主。至少 2016 年上半年来看，经济未见起色、通缩风险持续、机构再投资需求强烈，都成为支撑利率下行的有力因素，即与资金面相关的短期利率的上行风险基本可控，与基本面相关的中长期利率趋势下行确定性较大，因此，利率债和高等级信用债仍然具备配置价值，大概率来讲上半年纯债市场的利率走势不会出现拐头向上的迹象，所以债券牛市应该还能持续。在这种情况下，我们将会关注国际国内经济形势的最新发展，积极关注各项财政政策和货币政策对市场的中长期影响，在固定收益类资产投资方面，我们会继续根据基本面变化和市场变化调整组合久期，严控组合信用风险，规避低等级信用债的持仓，增持优质公司债或城投债，择机参与利率债的阶段性行情来获得相对稳定的投资回报。同时，作为二级债基我们将密切关注权益市场走势变化，适度参与权益市场行情，并且保持对权益类市场谨慎乐观的观点。从获得绝对收益的角度，在控制组合净值波动的前提下，为组合增强收益。

4.6 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，公司设立由负责运营的高管、运营部代表（包括基金会计）、投研部门代表、监察稽核部代表、IT 部代表、金融工程部门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二分之一以上成员同意。

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，估值委员会中的投研人员比例不超过三分之一。

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知识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，负责执行基金估值政策进行日常估值业务，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；金融工程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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同以及基金实际运作情况，2015 年 3 月 23 日本基金 A 类基金份额每 10 份派发红利 0.40 元，C 类基金份额每 10 份派发红利 0.40 元；2015 年 6 月 29 日本基金 A 类基金份额每 10 份派发红利 0.80 元，C 类基金份额每 10 份派发红利 0.80 元；2015 年 9 月 25 日本基金 A 类基金份额每 10 份派发红利 0.015 元；2015 年 12 月 25 日本基金 A 类基金份额每 10 份派发红利 0.20 元，C 类基金份额每 10 份派发红利 0.10 元；

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

本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者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

本报告期内，本基金托管人在对光大保德信信用添益债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金管理人——光大保德信基金管理有限公司在光大保德信信用添益债券型证券投资基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复

核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，本基金实施利润分配的金额为 41,405,959.98 元。

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

由光大保德信信用添益债券型证券投资基金管理人—光大保德信基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

本基金指定的会计师事务所安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）及其注册会计师边卓群 蒋燕华对本基金 2015 年度财务会计报告进行了审计，并于 2016 年 3 月 25 日为本基金出具了无保留意见的审计报告，审计报告文号为安永华明（2016）审字第 60467078_B10 号，投资者可通过年度报告正文查看审计报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：光大保德信信用添益债券型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2015 年 12 月 31 日 | 上年度末 2014 年 12 月 31 日 |
|-------|-------------------------|--------------------------|
| 资产： | - | - |
| 银行存款 | 1,125,162.36 | 5,936,600.39 |
| 结算备付金 | 11,104,916.84 | 10,885,604.97 |

| | | |
|-----------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 存出保证金 | 116,143.28 | 158,969.28 |
| 交易性金融资产 | 211,880,983.30 | 702,273,503.29 |
| 其中：股票投资 | 9,015,427.00 | 28,500,562.19 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 202,865,556.30 | 673,772,941.10 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | 3,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | - | - |
| 应收利息 | 5,167,597.65 | 16,498,946.94 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 110,304,309.71 | 771,942.22 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 339,699,113.14 | 739,525,567.09 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2015 年 12 月 31 日 | 上年度末 2014 年 12 月 31 日 |
| 负 债： | - | - |
| 短期借款 | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | 81,999,870.00 | 270,249,763.62 |
| 应付证券清算款 | 9,373,067.40 | 1,852,342.90 |
| 应付赎回款 | 61,563.39 | 478,240.72 |
| 应付管理人报酬 | 88,572.46 | 278,981.35 |
| 应付托管费 | 25,306.41 | 79,708.94 |
| 应付销售服务费 | 15,765.02 | 13,467.37 |
| 应付交易费用 | 89,987.52 | 292,319.44 |

| | | |
|-------------------|-----------------------|-----------------------|
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | 6,105.18 | 134,113.72 |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 309,000.29 | 319,130.42 |
| 负债合计 | 91,969,237.67 | 273,698,068.48 |
| 所有者权益： | - | - |
| 实收基金 | 236,015,985.68 | 422,009,085.46 |
| 未分配利润 | 11,713,889.79 | 43,818,413.15 |
| 所有者权益合计 | 247,729,875.47 | 465,827,498.61 |
| 负债和所有者权益总计 | 339,699,113.14 | 739,525,567.09 |

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.050 元，基金份额总额 236,015,985.68 份，其中 A 类基金份额参考净值 1.050 元，份额总额 177,154,483.28 份；C 类基金份额参考净值 1.050 元，份额总额 58,861,502.40 份。

7.2 利润表

会计主体：光大保德信信用添益债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 |
| 一、收入 | 31,519,303.60 | 97,433,894.28 |
| 1.利息收入 | 17,713,661.16 | 38,679,249.47 |
| 其中：存款利息收入 | 250,077.57 | 277,227.50 |
| 债券利息收入 | 17,243,686.35 | 38,325,311.36 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 219,897.24 | 76,710.61 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | 21,464,679.93 | -6,671,509.23 |

| | | |
|----------------------------|----------------------|----------------------|
| 其中：股票投资收益 | 7,656,065.72 | 17,898,628.74 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 13,479,107.61 | -24,570,137.97 |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 贵金属投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 329,506.60 | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -7,678,850.72 | 65,420,930.65 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 19,813.23 | 5,223.39 |
| 减：二、费用 | 7,116,156.97 | 17,974,354.45 |
| 1. 管理人报酬 | 1,971,276.43 | 3,038,567.26 |
| 2. 托管费 | 563,221.88 | 868,162.14 |
| 3. 销售服务费 | 155,830.89 | 180,329.03 |
| 4. 交易费用 | 1,090,411.55 | 556,443.07 |
| 5. 利息支出 | 2,990,490.01 | 12,961,299.00 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 2,990,490.01 | 12,961,299.00 |
| 6. 其他费用 | 344,926.21 | 369,553.95 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 24,403,146.63 | 79,459,539.83 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 24,403,146.63 | 79,459,539.83 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：光大保德信信用添益债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| | |
|----|----------------------------------|
| 项目 | 本期 |
| | 2015 年 1 月 1 日至 2015 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） | 422,009,085.46 | 43,818,413.15 | 465,827,498.61 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 24,403,146.63 | 24,403,146.63 |
| 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） | -185,993,099.78 | -15,101,710.01 | -201,094,809.79 |
| 其中：1.基金申购款 | 566,989,149.10 | 62,558,645.69 | 629,547,794.79 |
| 2.基金赎回款 | -752,982,248.88 | -77,660,355.70 | -830,642,604.58 |
| 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） | - | -41,405,959.98 | -41,405,959.98 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 236,015,985.68 | 11,713,889.79 | 247,729,875.47 |
| 项目 | 上年度可比期间 | | |
| | 2014 年 1 月 1 日至 2014 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） | 486,902,355.33 | -30,488,907.26 | 456,413,448.07 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 79,459,539.83 | 79,459,539.83 |
| 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） | -64,893,269.87 | 3,052,198.28 | -61,841,071.59 |

| | | | |
|--|-----------------|---------------|-----------------|
| 其中：1.基金申购款 | 271,169,826.74 | 1,824,251.50 | 272,994,078.24 |
| 2.基金赎回款 | -336,063,096.61 | 1,227,946.78 | -334,835,149.83 |
| 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） | - | -8,204,417.70 | -8,204,417.70 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 422,009,085.46 | 43,818,413.15 | 465,827,498.61 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：林昌，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

光大保德信信用添益债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2011]465 号文《关于核准光大保德信信用添益债券型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人光大保德信基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2011 年 5 月 16 日正式生效，首次设立募集规模为 2,627,358,006.58 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为光大保德信基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金基金份额分为 A 类和 C 类基金份额。对于 A 类基金份额，投资者申购时需缴纳申购费，赎回基金份额时缴纳赎回费；对于 C 类基金份额，投资者申购时无需缴纳申购费，赎回基金份额时缴纳赎回费。赎回时份额持有不满 30 天的，收取赎回费，持有满 30 天以上（含 30 天）的，不收取赎回费。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金为债券型基金，可投资的固定收益类品种主要包括公司债券、企业债券、可转换债券、短期融资券、金融债、资产支持证券、国债、央行票据等。本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，其中对金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转债、分离交易可转债、资产支持证券等非国家

信用债券的投资比例不低于固定收益类资产的 80%。本基金投资于股票、权证等非固定收益类证券的比例为基金资产的 0%-20%。现金或到期日在一年之内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金可以直接从二级市场购入股票或权证、参与一级市场股票首次发行或增发新股，并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票派发以及因投资可分离债券而产生的权证等。

本基金的业绩比较基准为：中证全债指数。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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。

7.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证

券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

7.4.6.2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

7.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 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（简称“光大保德信”） | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国民生银行股份有限公司（简称“民生银行”） | 基金托管人、基金销售机构 |
| 光大证券股份有限公司（简称“光大证券”） | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 保德信投资管理有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 光大保德信资产管理有限公司 | 基金管理人控制的子公司 |

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2015年1月1日至2015年12月31日 | | 上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日 | |
|-------|-----------------------------|--------------|----------------------------------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 光大证券 | 337,309,181.93 | 47.83% | 99,847,725.49 | 28.06% |

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2015年1月1日至2015年12月31日 | | 上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日 | |
|-------|-----------------------------|------|----------------------------------|------|
| | 成交金额 | 占当期债 | 成交金额 | 占当期债 |

| | | | | |
|------|---------------|--------------|---------------|--------------|
| | | 券成交总 额的比例 | | 券成交总 额的比例 |
| 光大证券 | 51,855,439.01 | 6.95% | 72,439,774.89 | 4.88% |

7.4.8.1.4 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回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2015年1月1日至2015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 |
| 光大证券 | 300,663.65 | 47.22% | 59,495.91 | 67.15% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2014年1月1日至2014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 |
| 光大证券 | 88,355.45 | 27.49% | 62,279.27 | 22.06% |

注：上述佣金按市场佣金率计算,扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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 2015年1月1日至2015年12 月31日 | 上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| | 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,971,276.43 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 111,823.34 | 230,260.10 |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.70% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.70\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人于次月首日起 5 个工作日内向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2015年1月1日至2015年12月31日 | 2014年1月1日至2014年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 563,221.88 | 868,162.14 |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人于次月首日起 5 个工作日内向基金托管人并发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

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 | | |
|----------------|-----------------------|-----------------|------------|
| | 2015年1月1日至2015年12月31日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 光大保德信信用添益债券 A 类 | 光大保德信信用添益债券 C 类 | 合计 |
| 民生银行 | - | 45,966.30 | 45,966.30 |
| 光大保德信 | - | 74,362.25 | 74,362.25 |
| 光大证券 | - | 36.03 | 36.03 |
| 合计 | - | 120,364.58 | 120,364.58 |
| 获得销售服务费的各 | 上年度可比期间 | | |

| 关联方名称 | 2014年1月1日至2014年12月31日 | | |
|-------|-----------------------|---------------|------------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 光大保德信信用添益债券A类 | 光大保德信信用添益债券C类 | 合计 |
| 民生银行 | - | 75,667.93 | 75,667.93 |
| 光大保德信 | - | 29,889.29 | 29,889.29 |
| 光大证券 | - | 38.13 | 38.13 |
| 合计 | - | 105,595.35 | 105,595.35 |

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金份额分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额销售服务费年费率为0.30%。本基金C类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人于次月首日起 5 个工作日内向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给注册登记机构，由注册登记机构支付给基金销售机构。

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

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。

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 | | 上年度可比期间 | |
|-----------|-----------------------|---------------|-----------------------|---------------|
| | 2015年1月1日至2015年12月31日 | | 2014年1月1日至2014年12月31日 | |
| | 光大保德信信用添益债券A类 | 光大保德信信用添益债券C类 | 光大保德信信用添益债券A类 | 光大保德信信用添益债券C类 |
| 期初持有的基金份额 | 0.00 | - | 29,999,000.00 | - |
| 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 | - | - | 29,999,000.00 | - |
| 期末持有的基金份 额 | - | - | 0.00 | - |
| 期末持有的基金份 额占基金总份额比 例 | - | - | 0.00% | - |

注：本报告期内基金管理人未投资本基金。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

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 | | 上年度可比期间 | |
|-------|-----------------------|-----------|-----------------------|-----------|
| | 2015年1月1日至2015年12月31日 | | 2014年1月1日至2014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 |
| 民生银行 | 1,125,162.36 | 45,190.15 | 5,936,600.39 | 32,848.84 |

7.4.8.6 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均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.9 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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 (单位：股) | 期末 成本总额 | 期末 估值总额 | 备注 |
|----------|----------|------------|----------|------------|------------|------------|--------------|------------|--------------|----|
| 600978 | 宜华木业 | 2015-06-18 | 重大资产重组 | 21.31 | 2016-01-21 | 20.10 | 70,000.00 | 986,584.62 | 1,491,700.00 | - |

7.4.9.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.2.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 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金融资产款余额 19,999,870.00 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 |
|--------|----------|------------|------------|------------|---------------|
| 150218 | 15 国开 18 | 2016-01-04 | 105.02 | 200,000.00 | 21,004,000.00 |
| 合计 | | | | 200,000.00 | 21,004,000.00 |

7.4.9.2.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 62,000,000.00 元，于 2016 年 1 月 4 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

§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 | 9,015,427.00 | 2.65 |
| | 其中：股票 | 9,015,427.00 | 2.65 |
| 2 | 固定收益投资 | 202,865,556.30 | 59.72 |
| | 其中：债券 | 202,865,556.30 | 59.72 |
| | 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 | - | - |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| | 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 | 12,230,079.20 | 3.60 |
| 7 | 其他各项资产 | 115,588,050.64 | 34.03 |
| 8 | 合计 | 339,699,113.14 | 100.00 |

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

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 | 941,400.00 | 0.38 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 3,024,527.00 | 1.22 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 1,760,000.00 | 0.71 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| 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 | 1,800,000.00 | 0.73 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 1,489,500.00 | 0.60 |

| | | | |
|---|----|--------------|------|
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 9,015,427.00 | 3.64 |

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 | 601318 | 中国平安 | 50,000 | 1,800,000.00 | 0.73 |
| 2 | 000516 | 国际医学 | 80,000 | 1,760,000.00 | 0.71 |
| 3 | 600978 | 宜华木业 | 70,000 | 1,491,700.00 | 0.60 |
| 4 | 300133 | 华策影视 | 50,000 | 1,489,500.00 | 0.60 |
| 5 | 600521 | 华海药业 | 40,000 | 1,015,600.00 | 0.41 |
| 6 | 002714 | 牧原股份 | 20,000 | 941,400.00 | 0.38 |
| 7 | 002588 | 史丹利 | 15,900 | 517,227.00 | 0.21 |

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 <http://www.epf.com.cn> 网站的本基金年度报告正文。

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 | 601318 | 中国平安 | 20,564,846.00 | 4.41 |
| 2 | 601601 | 中国太保 | 14,826,313.98 | 3.18 |
| 3 | 000002 | 万科A | 14,646,809.80 | 3.14 |
| 4 | 600000 | 浦发银行 | 13,301,586.00 | 2.86 |
| 5 | 000961 | 中南建设 | 9,564,232.03 | 2.05 |
| 6 | 601628 | 中国人寿 | 8,100,975.93 | 1.74 |
| 7 | 002241 | 歌尔声学 | 7,869,675.00 | 1.69 |
| 8 | 300369 | 绿盟科技 | 7,869,340.00 | 1.69 |
| 9 | 600643 | 爱建集团 | 7,408,932.00 | 1.59 |
| 10 | 002191 | 劲嘉股份 | 7,367,521.00 | 1.58 |
| 11 | 002400 | 省广股份 | 6,797,744.00 | 1.46 |
| 12 | 300295 | 三六五网 | 6,556,350.00 | 1.41 |
| 13 | 601988 | 中国银行 | 6,144,000.00 | 1.32 |
| 14 | 002373 | 千方科技 | 5,921,515.00 | 1.27 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 15 | 600690 | 青岛海尔 | 5,857,462.61 | 1.26 |
| 16 | 601688 | 华泰证券 | 5,814,332.00 | 1.25 |
| 17 | 600048 | 保利地产 | 5,754,487.00 | 1.24 |
| 18 | 002572 | 索菲亚 | 5,633,584.98 | 1.21 |
| 19 | 600366 | 宁波韵升 | 5,588,477.89 | 1.20 |
| 20 | 600340 | 华夏幸福 | 5,506,350.41 | 1.18 |

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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 | 601318 | 中国平安 | 21,740,599.48 | 4.67 |
| 2 | 600000 | 浦发银行 | 17,648,093.05 | 3.79 |
| 3 | 601601 | 中国太保 | 14,875,257.00 | 3.19 |
| 4 | 600340 | 华夏幸福 | 13,664,802.56 | 2.93 |
| 5 | 000002 | 万科A | 13,499,336.15 | 2.90 |
| 6 | 000961 | 中南建设 | 11,216,839.15 | 2.41 |
| 7 | 601988 | 中国银行 | 10,032,016.00 | 2.15 |
| 8 | 300369 | 绿盟科技 | 8,612,906.50 | 1.85 |
| 9 | 002400 | 省广股份 | 8,432,286.22 | 1.81 |
| 10 | 600643 | 爱建集团 | 8,380,307.72 | 1.80 |
| 11 | 300124 | 汇川技术 | 7,995,091.67 | 1.72 |
| 12 | 002241 | 歌尔声学 | 7,984,725.00 | 1.71 |
| 13 | 002191 | 劲嘉股份 | 7,956,039.10 | 1.71 |
| 14 | 600366 | 宁波韵升 | 7,452,864.60 | 1.60 |
| 15 | 601628 | 中国人寿 | 6,591,703.00 | 1.42 |
| 16 | 601688 | 华泰证券 | 6,443,426.84 | 1.38 |
| 17 | 002572 | 索菲亚 | 6,381,404.35 | 1.37 |
| 18 | 002373 | 千方科技 | 6,164,354.00 | 1.32 |
| 19 | 600690 | 青岛海尔 | 5,908,981.10 | 1.27 |
| 20 | 002065 | 东华软件 | 5,693,001.00 | 1.22 |

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

| | |
|---------------|----------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 340,341,282.62 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 365,255,277.56 |

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.3 项“买入股票成本”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 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 | 5,381,814.00 | 2.17 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 72,697,000.00 | 29.35 |
| | 其中：政策性金融债 | 72,697,000.00 | 29.35 |
| 4 | 企业债券 | 112,010,342.30 | 45.21 |
| 5 | 企业短期融资券 | 10,023,000.00 | 4.05 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 2,753,400.00 | 1.11 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 202,865,556.30 | 81.89 |

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 | 150218 | 15 国开 18 | 200,000 | 21,004,000.00 | 8.48 |
| 2 | 150208 | 15 国开 08 | 200,000 | 20,978,000.00 | 8.47 |
| 3 | 150203 | 15 国开 03 | 200,000 | 20,672,000.00 | 8.34 |
| 4 | 122082 | 11 发展债 | 160,000 | 11,374,400.00 | 4.59 |
| 5 | 122784 | 11 中兴新 | 100,000 | 10,772,000.00 | 4.35 |

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金报告期末未持有资产支持证券。

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

报告期末未投资贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金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

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于股指期货。

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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 本报告期内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 | 116,143.28 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 5,167,597.65 |
| 5 | 应收申购款 | 110,304,309.71 |
| 6 | 其他应收款 | - |

| | | |
|---|------|----------------|
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 115,588,050.64 |

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(%) |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1 | 113008 | 电气转债 | 2,753,400.00 | 1.11 |

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 |
|----|--------|------|--------------|--------------|----------|
| 1 | 600978 | 宜华木业 | 1,491,700.00 | 0.60 | 重大资产重组 |

§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 |
| 光大保德信信用添益债券 A 类 | 1,417 | 125,020.81 | 161,402,681.99 | 91.11% | 15,751,801.29 | 8.89% |
| 光大保德信信用添益债券 C 类 | 1,041 | 56,543.23 | 38,074,706.04 | 64.69% | 20,786,796.36 | 35.31% |
| 合计 | 2,458 | 96,019.52 | 199,477,388.03 | 84.52% | 36,538,597.65 | 15.48% |

9.2 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 | 光大保德信信用添益债券 A 类 | 1.89 | 0.00% |
| | 光大保德信信用添益债券 C 类 | 14,198.78 | 0.02% |
| | 合计 | 14,200.67 | 0.01% |

9.3 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 | 光大保德信信用添益债券 A 类 | 0 |
| | 光大保德信信用添益债券 C 类 | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 光大保德信信用添益债券 A 类 | 0 |
| | 光大保德信信用添益债券 C 类 | 0~10 |
| | 合计 | 0~10 |

§10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 光大保德信信用添益债券 A 类 | 光大保德信信用添益债券 C 类 |
|--------------------------------|-----------------|------------------|
| 基金合同生效日（2011 年 5 月 16 日）基金份额总额 | 677,320,442.33 | 1,950,037,564.25 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 374,627,421.05 | 47,381,664.41 |
| 本报告期基金总申购份额 | 490,328,266.71 | 76,660,882.39 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 687,801,204.48 | 65,181,044.40 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 177,154,483.28 | 58,861,502.40 |

§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

李常青先生自 2015 年 2 月 28 日起担任本基金管理人督察长；自李常青先生担任督察长职务之日起，陶耿先生不再代行督察长职务。经公司管理层批准及八届十九次董事会审议通过，自 2015 年 11 月 11 日起，张弛因个人原因正式离职。经公司八届二十一次董事会会议审议通过，自 2016 年 3 月 3 日起，陶耿先生正式离任公司总经理一职，由林昌先生代任公司总经理。

本报告期内，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

本报告期本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，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所情况。报告年度应支付给聘任安永华明会计师事务所的报酬情况是 6 万元，目前该审计机构已提供审计服务的连续年限为 5 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

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 | 1 | 337,309,181.93 | 47.83% | 300,663.65 | 47.22% | - |
| 东方证券 | 1 | 367,964,448.25 | 52.17% | 336,009.56 | 52.78% | - |

注：（1）报告期内租用证券公司交易单元变更情况

报告期内未新增和停止租用交易单元。

（2）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。

(3) 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(2)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。

11.7.2 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 | | 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 | 51,855,439.01 | 6.95% | - | - | - | - |
| 东方证券 | 693,885,035.46 | 93.05% | 8,837,300,000.00 | 100.00% | - | - |

光大保德信基金管理有限公司

二〇一六年三月二十八日