

**光大保德信货币市场基金**  
**2016 年半年度报告**  
**2016 年 6 月 30 日**

基金管理人：光大保德信基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年八月二十七日

## 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>4 管理人报告</b> .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
<b>5 托管人报告</b> .....	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
<b>7 投资组合报告</b> .....	30
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 债券回购融资情况.....	31
<b>7.3 基金投资组合平均剩余期限</b> .....	31
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	32
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	32
7.6 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.....	33
7.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	33
7.8 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.....	33
7.9 投资组合报告附注.....	34
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	35
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	35
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	35
8.3 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.....	35
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	35

<b>10 重大事件揭示</b> .....	35
10.1 基金份额持有人大会决议.....	35
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	36
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	36
10.4 基金投资策略的改变.....	36
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	36
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	36
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	36
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	37
10.9 其他重大事件.....	37
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	39
<b>12 备查文件目录</b> .....	39
12.1 备查文件目录.....	39
12.2 存放地点.....	39
12.3 查阅方式.....	39

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	光大保德信货币市场基金
基金简称	光大保德信货币
基金主代码	360003
交易代码	360003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 6 月 9 日
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	5,870,110,809.08 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于高信用等级、高流动性的短期金融工具，为投资者提供流动性储备；并在保持基金资产本金安全和高流动性的前提下，获得稳健的超越业绩比较基准的当期收益。
投资策略	本基金按照自上而下的方法对基金资产进行动态的大类资产配置，类属资产配置和证券选择。一方面根据整体配置要求通过积极的投资策略主动寻找风险中蕴藏的投资机会，发掘价格被低估的且符合流动性要求的适合投资的品种；另一方面通过风险预算管理、平均剩余期限控制和个券信用等级限定等方式有效控制投资风险，从而在一定的风险限制范围内达到风险收益最佳配比。
业绩比较基准	税后活期存款利率。
风险收益特征	从长期平均值来看，本基金风险收益特征属于证券投资基金中的低风险品种，风险程度低于其他类型的基金品种。本基金按照风险收益配比原则对投资组合进行严格的风险管理，将风险水平控制在既定目标之内，在风险限制范围内追求收益最大化。

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	魏丹	张燕
	联系电话	021-80262888-605	0755-83199084
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4008-202-888	95555

传真	021-80262468	0755-83195201
注册地址	上海市延安东路222号外滩中心46楼	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址	上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢（北区3号楼）6层至10层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	200002	518040
法定代表人	林昌	李建红

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.epf.com.cn
基金半年度报告备置地点	光大保德信基金管理有限公司、招商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
注册登记机构	光大保德信基金管理有限公司	上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢（北区 3 号楼）6 层至 10 层

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2016年1月1日至2016年6月30日）
本期已实现收益	98,122,331.80
本期利润	98,122,331.80
本期净值收益率	1.2427%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末基金资产净值	5,870,110,809.08
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
累计净值收益率	37.5052%

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，由于货币市场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。

### 3.2 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

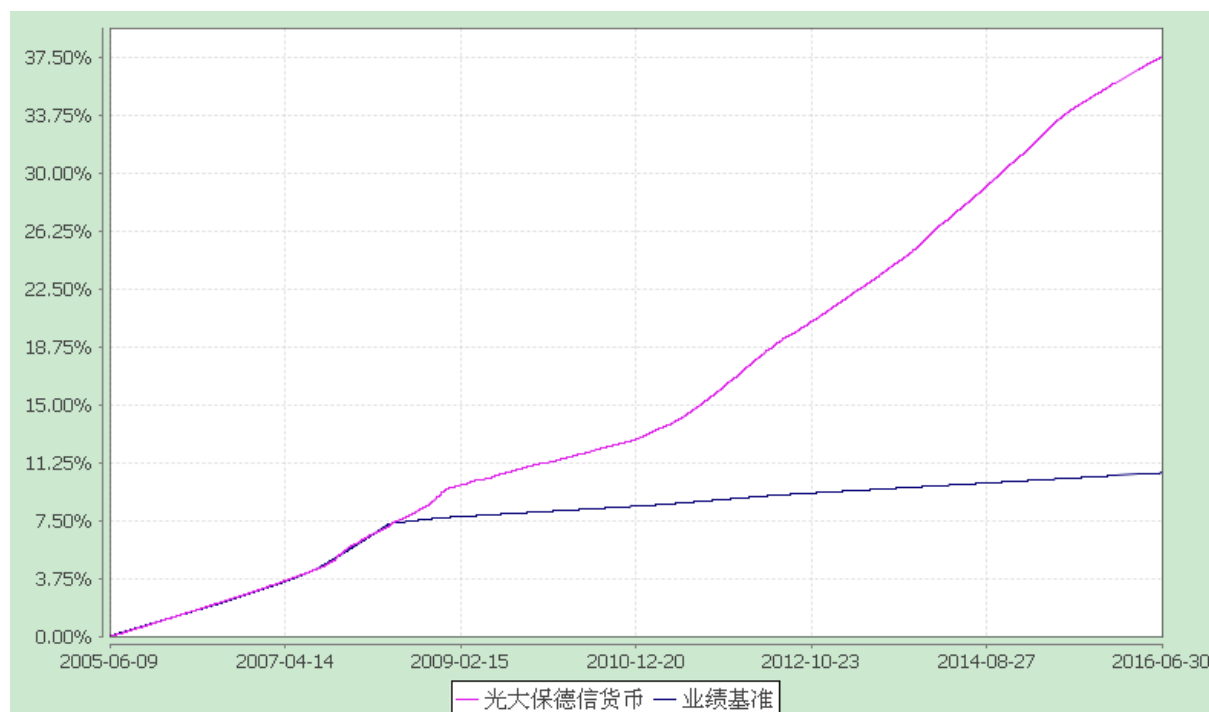
阶段	份额净值收 益率①	份额净值收 益率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.1999%	0.0025%	0.0292%	0.0000%	0.1707%	0.0025%
过去三个月	0.6112%	0.0021%	0.0885%	0.0000%	0.5227%	0.0021%
过去六个月	1.2427%	0.0017%	0.1769%	0.0000%	1.0658%	0.0017%
过去一年	2.7387%	0.0018%	0.3558%	0.0000%	2.3829%	0.0018%
过去三年	11.6252%	0.0032%	1.0656%	0.0000%	10.5596%	0.0032%
自基金合同生效 起至今	37.5052%	0.0057%	10.5657%	0.0028%	26.9395%	0.0029%

#### 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

光大保德信货币市场基金

自基金合同生效以来累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2005 年 6 月 9 日至 2016 年 6 月 30 日)



注：按照基金合同规定，本基金建仓期自基金合同生效日起一个月内。本基金合同生效日为 2005 年 6 月 9 日，本基金已于基金合同规定的期限内完成建仓并达到本基金合同约定的投资比例。

## 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 2016 年 6 月 30 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、光大保德信尊享一年定期开放债券型证券投资基金、光大保德信中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金和光大保德信风格轮动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		
王慧杰	基金经理	2014-08-28	-	7 年	王慧杰女士，硕士。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。
--	--	--	--	--	--

注：1、“任职日期”和“离任日期”分别为公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、本公司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 6 月 7 日开始休假，暂定休假持续至 2016 年 7 月 6 日止。在陈晓女士休产假期间，由杨焜超先生和王慧杰女士代为共同管理光大保德信增利收益债券型证券投资基金基金经理和光大保德信信用添益债券型证券投资基金基金经理。

#### 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 公平交易制度的执行情况

为充分保护持有人利益，确保本基金管理人旗下各基金在获得投研团队、交易团队支持等各方面得到公平对待，本基金管理人从投研制度设计、组织结构设计、工作流程制定、技术系统建设和完善、公平交易执行效果评估等各方面出发，建设形成了有效的公平交易执行体系。本报告期，本基金管理人各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的现象。

##### 4.3.2 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且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的交易。

#### 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

2016 年上半年，国内经济增长经历了 3 月的短暂反弹之后，重新返回下行态势。从生产端来看，4、5 月的工业增速再度回落，制造业 PMI 和发电耗煤增速也再度下滑，种种迹象显示经济依然疲弱。从需求端来看，新兴制造业体量太小，虽然处于高速增长阶段，但是仍然难以拉动整个制造业投资；

房地产行业去库存为主的基调下，一二线城市的地产政策又压制了销售增长，地产投资在二季度末出现了放缓迹象；基建投资仍然发挥着托底作用，独木难支投资需求的萎缩。由于实体经济投资回报率的下降，民间投资增速持续下滑，经济仍然面临下行风险。从通胀水平来看，上半年核心通胀维持稳定，CPI 受食品价格下降的影响，在二季度见顶回落，但相对于去年，通胀水平有所抬升。受供给侧改革的影响，上半年工业品供需更为平衡，价格环比持续改善，同比跌幅缩窄。央行维持稳健货币政策，在一季度降准后，并没有再动用降息降准等意图明显的宽松货币政策，央行以逆回购等多种工具维持流动性合理充裕。在 6 月底面临半年末因素和 MPA 考核的情况下，银行间资金利率并未出现明显上行。

在债券市场运行方面，整体来看，上半年债券市场收益率处于区间震荡状态。二季度初受 3 月经济数据超预期改善、通胀预期抬头、中铁物资等信用事件频发、营改增政策等影响，债券市场出现大幅调整。直到 5 月营改增政策出台、月营改增补丁出台，城投提前偿还取消、铁物资风波得到后续处理，债市恐慌情绪得到缓解，走势重新回归基本面和政策面引导。上半年在信用尾部风险不断增大的背景下，信用利差走势内部分化，过剩产能行业民企收益率出现较大幅度的上行调整。2016 年上半年，货币基金以债券、存款作为主要配置资产，保持了适中的平均剩余期限，根据市场情况均衡投资存款、逆回购、金融债和短期融资券，在保持较高流动性的同时为投资者提供了较高的投资收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内份额净值增长率为 1.2427%，业绩比较基准收益率为 0.1769%。

#### 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 2016 年下半年，全球经济和金融体系的不确定性加大，加大了国内宏观政策应对的难度。而国内政策来看，目标定位仍然是“在适度扩大总需求和调整需求结构的同时，着力加强供给侧结构性改革”。预计三季度经济增长继续下行的概率加大，下行的幅度主要取决于地产投资放缓的幅度。如果经济增长下滑速度过快，则需要警惕政策向稳增长方向倾斜。通胀方面，预计三季度 CPI 水平或将继续回落，核心通胀水平弱势平稳运行。预计工业品价格环比有所走弱，但同比仍将改善。货币政策方面，央行仍将维持稳健基调，在面临多重目标的情况下，预计央行将谨慎使用降息等价格型工具。在应对外汇占款减少、维持金融稳定、保持经济平稳运行的情况下，仍然有可能动用降准等数量型工具。对于债券市场，资本回报率持续下滑和基本面的利好，利率水平仍处于长期缓慢下行通道之中；但考虑到多目标制下政策波动可能加大，利率波动性也将加大。

操作方面，货币基金将在流动性保证和风险可控的前提下，争取提高组合的收益。在银行存款

利率和银行间市场回购利率维持在低位的情况下，组合将根据流动性的情况适度拉长存款期限和回购期限，锁定长期收益。与此同时，货币基金将积极关注中高等级短期融资券的配置机会和高等级短期融资券的交易机会。

#### 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。

#### 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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：光大保德信货币市场基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	1,541,308,227.45	13,901,105,725.59

结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,155,746,818.86	3,671,592,429.70
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,155,746,818.86	3,671,592,429.70
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	2,143,009,314.12	8,061,373,532.03
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	23,785,230.26	73,455,550.76
应收股利		-	-
应收申购款		9,760,888.65	83,245.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,873,610,479.34	25,707,610,483.78
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015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		-	-
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		1,573,903.21	2,535,952.37
应付托管费		476,940.37	768,470.43
应付销售服务费		1,192,350.92	1,921,176.05
应付交易费用	6.4.7.7	93,420.24	103,210.82
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	163,055.52	309,000.00
负债合计		3,499,670.26	5,637,809.67
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	5,870,110,809.08	25,701,972,674.11
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		5,870,110,809.08	25,701,972,674.11
负债和所有者权益总计		5,873,610,479.34	25,707,610,483.78

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 5,870,110,809.08 份。

## 6.2 利润表

会计主体：光大保德信货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>128,696,979.33</b>	<b>87,243,633.41</b>
1.利息收入		125,615,428.95	87,407,444.55
其中：存款利息收入	6.4.7.11	60,539,693.53	44,696,539.08
债券利息收入		46,116,554.45	28,559,370.00
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		18,959,180.97	14,151,535.47
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,081,550.38	-163,811.14
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	3,081,550.38	-163,811.14
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
<b>减：二、费用</b>		<b>30,574,647.53</b>	<b>12,919,987.24</b>
1. 管理人报酬		13,274,870.43	5,730,210.89
2. 托管费		4,022,688.00	1,736,427.48
3. 销售服务费		10,056,719.99	4,341,068.87
4. 交易费用	6.4.7.18	575.00	1,210.49
5. 利息支出		3,007,502.84	909,029.77
其中：卖出回购金融资产支出		3,007,502.84	909,029.77
6. 其他费用	6.4.7.19	212,291.27	202,039.74
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>98,122,331.80</b>	<b>74,323,646.17</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>98,122,331.80</b>	<b>74,323,646.17</b>

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：光大保德信货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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）	25,701,972,674.11	-	25,701,972,674.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	98,122,331.80	98,122,331.80
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）	-19,831,861,865.03	-	-19,831,861,865.03
其中：1.基金申购款	9,122,729,748.46	-	9,122,729,748.46
2.基金赎回款	-28,954,591,613.49	-	-28,954,591,613.49
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）	-	-98,122,331.80	-98,122,331.80
五、期末所有者权益（基金净值）	5,870,110,809.08	-	5,870,110,809.08
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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）	2,605,844,121.61	-	2,605,844,121.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	74,323,646.17	74,323,646.17
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）	2,392,871,337.91	-	2,392,871,337.91
其中：1.基金申购款	11,669,625,270.84	-	11,669,625,270.84
2.基金赎回款	-9,276,753,932.93	-	-9,276,753,932.93
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）	-	-74,323,646.17	-74,323,646.17
五、期末所有者权益（基金净值）	4,998,715,459.52	-	4,998,715,459.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

光大保德信货币市场基金(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”)证监基金字[2005]69 号文《关于同意光大保德信货币市场基金募集的批复》的核准,由光大保德信基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行募集,基金合同于 2005 年 6 月 9 日正式生效,首次设立募集规模为 1,439,643,105.95 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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金通过投资于高信用等级、高流动性的短期金融工具,为投资者提供流动性储备;并在保持基金资产本金安全和高流动性的前提下,获得稳健的超越业绩比较基准的当期收益。本基金的投资范围为具有良好流动性的短期金融工具,目前主要包括现金;一年以内(含一年)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;期限在一年以内(含一年)的债券回购;期限在一年以内(含一年)的中央银行票据;中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

本基金的业绩比较基准为:税后活期存款利率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《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编报规则》第 5 号《货币市场基金信息披露特别规定》、《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。

#### 6.4.3 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明



本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 6.4.5 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。

#### 6.4.6 税项

##### 1. 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》，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[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。

##### 2. 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[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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	308,227.45
定期存款	1,541,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	397,000,000.00
存款期限 1 个月内	144,000,000.00
存款期限 3 个月-1 年	1,000,000,000.00
其他存款	-
合计	1,541,308,227.45

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016年6月30日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	2,155,746,818.86	2,159,681,000.00	3,934,181.14	0.0670
	合计	2,155,746,818.86	2,159,681,000.00	3,934,181.14	0.0670

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	2,143,009,314.12	-
合计	2,143,009,314.12	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	159.25
应收定期存款利息	1,070,283.31
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	21,511,633.06
应收买入返售证券利息	1,203,154.64
应收申购款利息	-
其他	-
合计	23,785,230.26

**6.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末未有其他资产。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	93,420.24
合计	93,420.24

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	163,055.52
合计	163,055.52

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	25,701,972,674.11	25,701,972,674.11
本期申购	9,122,729,748.46	9,122,729,748.46
本期赎回（以“-”号填列）	-28,954,591,613.49	-28,954,591,613.49
本期末	5,870,110,809.08	5,870,110,809.08

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

**6.4.7.10 未分配利润**

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
本期利润	98,122,331.80	-	98,122,331.80
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	-98,122,331.80	-	-98,122,331.80
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	27,010.83
定期存款利息收入	60,510,682.81
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	1,999.89
合计	60,539,693.53

#### 6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	3,081,550.38
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	3,081,550.38

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	6,829,282,196.26
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	6,757,121,585.22
减：应收利息总额	69,079,060.66
买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	3,081,550.38

**6.4.7.14 资产支持证券投资收益**

本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

本基金在本报告期内无衍生工具投资。

**6.4.7.16 股利收益**

本基金不投资股票。

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

本基金无公允价值变动收益。

**6.4.7.18 其他收入**

本基金在本报告期内无其他收入。

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	575.00
合计	575.00

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	34,809.32
信息披露费	119,344.68
账户维护费	17,901.52
其他费用	897.07
银行汇划费用	39,338.68
合计	212,291.27

**6.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明**

**6.4.8.1或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至财务报表批准日，本基金无需做披露的资产负债表日后事项。

**6.4.9 关联方关系**

**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
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
招商银行股份有限公司（简称“招商银行”）	基金托管人、基金代销机构
光大证券股份有限公司（简称“光大证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

**6.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

**6.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.3 债券交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

**6.4.10.1.4 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。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

**6.4.10.2 关联方报酬**

**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2016年1月1日至2016年6月 30日	2015年1月1日至2015年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	13,274,870.43	5,730,210.89
其中：支付销售机构的客户维护费	325,525.46	611,277.36

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.33% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

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,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月 30日	2015年1月1日至2015年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,022,688.00	1,736,427.48

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

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,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起 2 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、公休日等,支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
光大保德信	9,512,731.91
光大证券	487.32
招商银行	15,683.62
合计	9,528,902.85

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
光大保德信	3,588,870.67	
光大证券	2,742.31	
招商银行	55,695.41	
合计	3,647,308.39	

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售、服务等各项费用，由基金管理人支配使用。在通常情况下，基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付；由基金管理人向基金托管人发送基金销售费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2016年1月1日至2016年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	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
招商银行	-	-	-	-	230,000,000.00	12,539.73
上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	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
-	-	-	-	-	-	-

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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



份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
期初持有的基金份额	16,149,665.72	301,609,718.94
期间申购/买入总份额	200,664.69	65,268,894.98
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	77,000,000.00
期末持有的基金份额	16,350,330.41	289,878,613.92
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.28%	5.80%

注：“期间申购/买入总份额”中申购、基金转换入、红利再投份额之和，本期红利再投份额为 200,664.68 份（上年度可比期间红利再投资份额为 6,698,894.98 份）

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2016年6月30日		2015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
光大证券股份有限公司	500,000,000.00	8.52%	1,800,612,128.87	7.01%

注：本报告期内，光大证券股份有限公司赎回本基金 1,802,413,945.58 份，赎回费 0 元；光大证券股份有限公司申购本基金 500,000,000.00 元，申购费 0 元；按照招募说明书公示费率收费。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	308,227.45	27,010.83	823,158.78	14,840.89

注：1.上述当期利息收入中包含本基金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算公司等结算账户的证券交易结算资金的利息收入。

2.当期利息收入含存放于基金托管人招商银行的协议存款利息收入。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

**6.4.11 利润分配情况**

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
98,122,331.80	-	-	98,122,331.8 0	-

**6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

**6.4.13 金融工具风险及管理****6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金在日常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。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人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，并报请风险管理工作委员会审议批准；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，报请风险管理工作委员会审议批准；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。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金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管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、信誉良好的国债、企业债及央行票据等，除在证券交易所的债券回购交易，其余均在银行间同业市场交易。因此均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。对于个券和交易市场活跃度所带来的流动性风险，本基金在操作中始终密切关注各个券种的市场报价情况，并通过换手率、日均成交量与周均成交量、单只个

券历史成交情况等指标的分析，集中进行系统的流动性管理。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金所投资的债券品种的市场投资风险主要为由于市场整体利率水平的变动带来的市场价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1个月以内	1-3 个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>							
银行存款	144,308,227.45	1,160,000,000.00	237,000,000.00	-	-	-	1,541,308,227.45
交易性金融资产	379,883,803.35	348,608,086.15	1,427,254,929.36	-	-	-	2,155,746,818.86
买入返售金融资产	2,143,009,314.12	-	-	-	-	-	2,143,009,314.12
应收利息	-	-	-	-	-	23,785,230.26	23,785,230.26
应收申购款	-	-	-	-	-	9,760,888.65	9,760,888.65
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,667,201,344.92	1,508,608,086.15	1,664,254,929.36	-	-	33,546,118.91	5,873,610,479.34
<b>负债</b>							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,573,903.21	1,573,903.21
应付托管费	-	-	-	-	-	476,940.37	476,940.37
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,192,350.92	1,192,350.92
应付交易费用	-	-	-	-	-	93,420.24	93,420.24
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	163,055.52	163,055.52
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-	-	3,499,670.26	3,499,670.26
利率敏感度缺口	2,667,201,344.92	1,508,608,086.15	1,664,254,929.36	-	-	30,046,448.65	5,870,110,809.08

上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	11,251,105,725.59	2,400,000,000.00	250,000,000.00	-	-	-	13,901,105,725.59
交易性金融资产	189,993,328.62	290,040,527.40	3,191,558,573.68	-	-	-	3,671,592,429.70
买入返售金融资产	8,061,373,532.03	-	-	-	-	-	8,061,373,532.03
应收利息	-	-	-	-	-	73,455,550.76	73,455,550.76
应收申购款	-	-	-	-	-	83,245.70	83,245.70
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	19,502,472,586.24	2,690,040,527.40	3,441,558,573.68	-	-	73,538,796.46	25,707,610,483.78
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,535,952.37	2,535,952.37
应付托管费	-	-	-	-	-	768,470.43	768,470.43
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,921,176.05	1,921,176.05
应付交易费用	-	-	-	-	-	103,210.82	103,210.82
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	309,000.00	309,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-	-	5,637,809.67	5,637,809.67
利率敏感度缺口	19,502,472,586.24	2,690,040,527.40	3,441,558,573.68	-	-	67,900,986.79	25,701,972,674.11

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	资产净值变动与利率变动成负相关，相关系数为资产组合的货币久期		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	利率上升 0.25%	减少约 66	减少约 471
	利率下降 0.25%	增加约 66	增加约 471

注：上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险。市场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间同业市场交易的固定收益品种，且以摊余成本进行后续计量，因此无重大市场价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,159,681,000.00	36.79	3,681,717,000.00	14.32
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,159,681,000.00	36.79	3,681,717,000.00	14.32

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金无其他说明事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
----	----	----	------------------

1	固定收益投资	2,155,746,818.86	36.70
	其中：债券	2,155,746,818.86	36.70
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,143,009,314.12	36.49
	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	1,541,308,227.45	26.24
4	其他各项资产	33,546,118.91	0.57
5	合计	5,873,610,479.34	100.00

## 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额		4.16
	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	-	-

注：上表中，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个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

## 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	76
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	87
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	34

## 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内未出现平均剩余期限超过 120 天的情况。

## 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	47.77	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	4.77	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	20.93	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	3.57	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	22.44	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.49	-

注：由于本基金持有定期存款 2 笔：1.业务日期 2016 年 6 月 29 日，金额 137000000.00，于 2016 年 7 月 29 日发生提前支取；2. 业务日期 2016 年 6 月 30 日，金额 144000000.00，于 2016 年 7 月 26 日发生提前支取。提前支取日均发生在半年报披露日后，造成半年报数据与半年报不一致。

## 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内未出现平均剩余期限超过 240 天的情况。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	519,188,990.45	8.84
	其中：政策性金融债	519,188,990.45	8.84
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,239,527,565.00	21.12



6	中期票据	-	-
7	同业存单	397,030,263.41	6.76
8	其他	-	-
9	合计	2,155,746,818.86	36.72
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

### 7.6 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

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	160204	16 国开 04	2,200,000	219,617,549.77	3.74
2	160209	16 国开 09	2,000,000	199,568,697.12	3.40
3	150215	15 国开 15	1,000,000	100,002,743.56	1.70
4	011699728	16 首旅 SCP004	1,000,000	99,992,788.80	1.70
5	011699750	16 中海运 SCP001	1,000,000	99,986,253.89	1.70
6	011699898	16 国药控股 SCP003	1,000,000	99,952,029.18	1.70
7	041659015	16 义乌国资 CP002	1,000,000	99,944,610.65	1.70
8	111611129	16 平安 CD129	1,000,000	99,899,971.73	1.70
9	111612106	16 北京银行 CD106	1,000,000	99,311,473.97	1.69
10	111694700	16 吉林银行 CD098	1,000,000	99,308,679.75	1.69

### 7.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1551%
报告期内偏离度的最低值	0.0379%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0994%

注：数据均按报告期内的交易日统计。

### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内未发生负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内未发生正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

### 7.8 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.9 投资组合报告附注

### 7.9.1 基金计价方法说明

(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。

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

### 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	23,785,230.26
4	应收申购款	9,760,888.65
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	33,546,118.91

### 7.9.4 其他需说明的重要事项

无其他需说明的重要事项。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
123,166	47,660.16	5,291,794,040.99	90.15%	578,316,768.09	9.85%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	2,154,117.11	0.04%

### 8.3 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	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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2005年6月9日）基金份额总额	1,439,760,614.07
本报告期期初基金份额总额	25,701,972,674.11
本报告期基金总申购份额	9,122,729,748.46
减：本报告期基金总赎回份额	28,954,591,613.49
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,870,110,809.08

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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。经公司九届二次董事会会议审议通过，自 2016 年 7 月 19 日起，包爱丽女士正式担任公司总经理一职，林昌先生不再代任公司总经理，将继续担任公司董事长。

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。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 10.4 基金投资策略的改变

本基金在本报告期内的投资策略未发生改变。

## 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

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。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的基金管理人和基金托管人的托管业务部门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。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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	
东方证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：本报告期本基金未新增租用交易单元。

本报告期本基金未撤销租用交易单元。

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。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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
东方证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

### 10.8 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。

### 10.9 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	光大保德信基金管理有限公司旗下基金 2015 年 12 月 31 日资产净值公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-01-04
2	关于旗下部分基金新增联讯证券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》	2016-01-08
3	光大保德信基金管理有限公司新增海银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》	2016-01-14
4	光大保德信货币市场基金招募说明书（更新）摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-01-22
5	光大保德信货币市场基金招募说明书（更新）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-01-22
6	光大保德信货币市场基金 2015 年第 4 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-01-22
7	关于“耀钱包”账户对应基金产品变更及购买基金享交易费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-01-28
8	光大保德信货币市场基金“春节”假期前暂停申购及基金转换转入交易提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-01-29
9	光大保德信货币市场基金 2015 年年度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-03-28
10	光大保德信货币市场基金 2015 年年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-03-28
11	光大保德信货币市场基金“清明”假期前暂停申购及基金转换转入交易提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-03-29
12	光大保德信基金管理有限公司关于调整招商银行“一卡通”借记卡网上直销平台（含移动终端）交易费率的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-04-07
13	光大保德信货币市场基金 2016 年第 1 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-04-22
14	有关光大保德信直销平台假期前申购及基金转换转入旗下货币市场基金的交易提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-04-26
15	光大保德信货币市场基金“劳动节”假期前暂停申购及基金转换转入交易提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-04-27
16	关于旗下部分基金新增和耕传承基金销售有限公司为代销机构并参与其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》	2016-05-27
17	光大保德信货币市场基金“端午节”假期前暂停申购及基金转换转入交易提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-06-07
18	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在平安证券开通定期定额投资及转换业务并参与其费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-06-14
19	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定期定额投资业务并参与其交易费率优惠活动	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-06-24

	的公告		
20	光大保德信基金管理有限公司旗下部分基金参与交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-06-29

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

无

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立光大保德信货币市场基金的文件
- 2、光大保德信货币市场基金基金合同
- 3、光大保德信货币市场基金招募说明书
- 4、光大保德信货币市场基金托管协议
- 5、光大保德信货币市场基金法律意见书
- 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货币市场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

### 12.2 存放地点

上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢（北区 3 号楼）6 层至 10 层本基金管理人办公地址。

### 12.3 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。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

二〇一六年八月二十七日