

光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金

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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
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.....	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 债券回购融资情况.....	33
7.3 基金投资组合平均剩余期限	33
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	34
7.5 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.....	34
7.6“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	34
7.7 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.....	34
7.8 投资组合报告附注.....	34
8 基金份额持有人信息	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.....	36
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.....	36
9 开放式基金份额变动	36
10 重大事件揭示	37

10.1 基金份额持有人大会决议	37
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	37
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	37
10.4 基金投资策略的改变	37
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	37
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	37
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	37
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况	38
10.9 其他重大事件	39
11 影响投资者决策的其他重要信息	40
12 备查文件目录	40
12.1 备查文件目录	40
12.2 存放地点	40
12.3 查阅方式	41

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金	
基金简称	光大保德信添天盈理财债券	
基金主代码	360019	
交易代码	360019	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012 年 10 月 25 日	
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	531,869,439.07 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	光大保德信添天盈理财债券 A 类	光大保德信添天盈理财债券 B 类
下属分级基金的交易代码	360019	360020
报告期末下属分级基金的份额总额	7,203,320.41 份	524,666,118.66 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投资标的，力争获得超过人民币 7 天通知存款利率（税后）的投资回报。
投资策略	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。本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、外资银行中具有证券投资基金托管人资格、证券投资基金代销业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的商业银行的协议存款。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该运作周期的第一个开放日。本基金在投资银行存款时将针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。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为人民币 7 天通知存款利率（税后）。
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	中国建设银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	魏丹	田青
	联系电话	021-80262888-605	010-67595096
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008-202-888	010-67595096
传真		021-80262468	010-66275853
注册地址		上海市延安东路222号外滩中心46楼	北京市西城区金融大街25号
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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200002	100033
法定代表人		林昌	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金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、中国建设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-2016年6月30日）	
	光大保德信添天盈理财债券 A类	光大保德信添天盈理财债券 B类
本期已实现收益	134,981.33	7,493,603.07
本期利润	134,981.33	7,493,603.07
本期净值收益率	1.3276%	1.4490%
3.1.2 期末 数据和指标	报告期末(2016年6月30日)	
	光大保德信添天盈理财债券 A 类	光大保德信添天盈理财债券 B 类

期末基金资产净值	7,203,320.41	524,666,118.66
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计 期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
	光大保德信添天盈理财债券 A 类	光大保德信添天盈理财债券 B 类
累计净值收益率	14.6803%	13.3022%

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。

3.2 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. 光大保德信添天盈理财债券 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
过去一个月	0.1763%	0.0008%	0.1125%	0.0000%	0.0638%	0.0008%
过去三个月	0.5969%	0.0010%	0.3413%	0.0000%	0.2556%	0.0010%
过去六个月	1.3276%	0.0011%	0.6825%	0.0000%	0.6451%	0.0011%
过去一年	2.6315%	0.0014%	1.3725%	0.0000%	1.2590%	0.0014%
过去三年	11.9749%	0.0040%	5.1447%	0.0015%	6.8302%	0.0025%
自基金合同生 效起至今	14.6803%	0.0037%	6.9431%	0.0017%	7.7372%	0.0020%

2. 光大保德信添天盈理财债券 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④	①-③	②-④
过去一个月	0.1963%	0.0008%	0.1125%	0.0000%	0.0838%	0.0008%
过去三个月	0.6573%	0.0010%	0.3413%	0.0000%	0.3160%	0.0010%
过去六个月	1.4490%	0.0011%	0.6825%	0.0000%	0.7665%	0.0011%
过去一年	2.8790%	0.0014%	1.3725%	0.0000%	1.5065%	0.0014%
自基金合同生 效起至今	11.1741%	0.0042%	4.3214%	0.0014%	6.8527%	0.0028%

注：B 类基金份额于 2013 年 4 月 25 日全部赎回。

B 类基金份额于 2013 年 10 月 23 日重新成立。

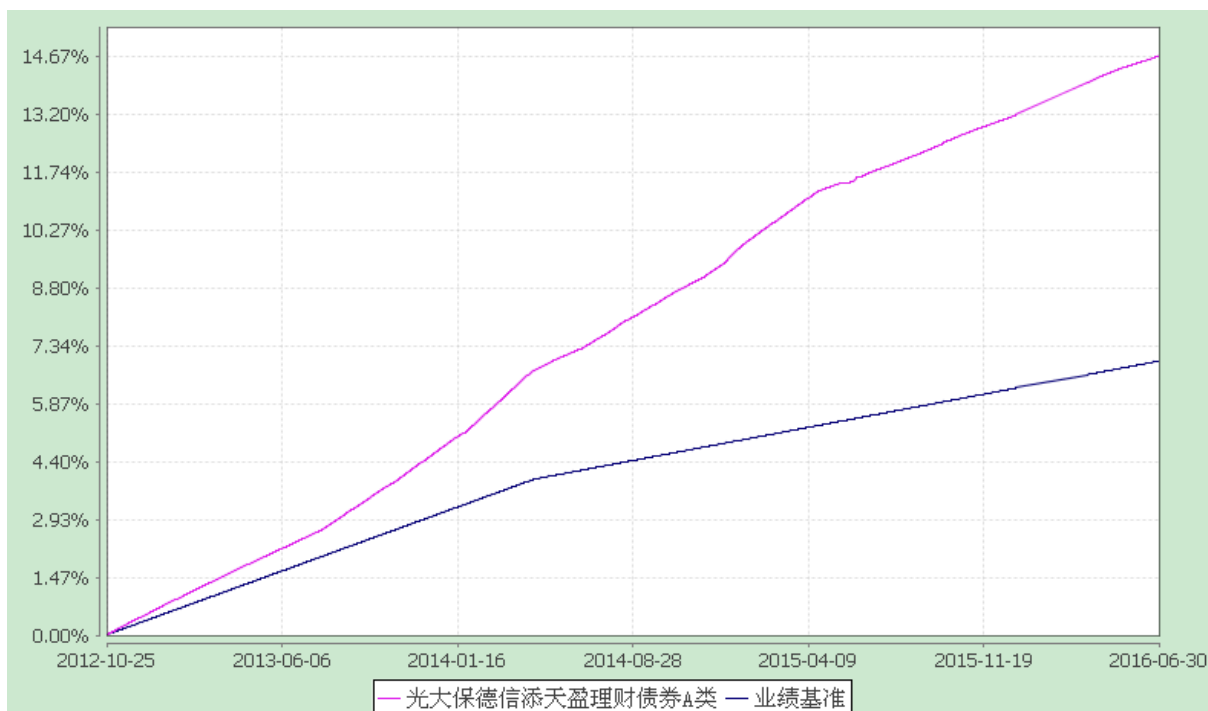
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

较

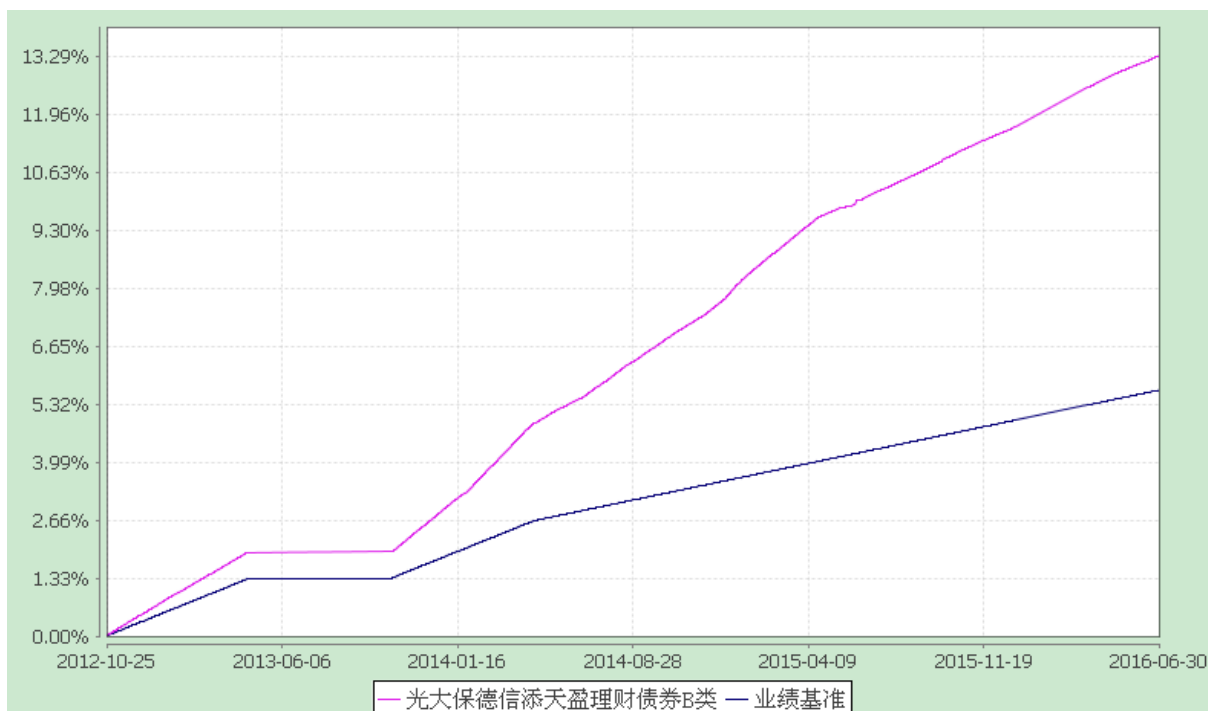
光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金

自基金合同生效以来累计份额净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2012 年 10 月 25 日至 2016 年 6 月 30 日)

光大保德信添天盈理财债券 A 类



光大保德信添天盈理财债券 B 类



注：B 类基金份额于 2013 年 4 月 25 日全部赎回。

B 类基金份额于 2013 年 10 月 23 日重新成立。

根据基金合同的规定，本基金建仓期为 2012 年 10 月 25 日至 2013 年 4 月 24 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。

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		
蔡乐	基金经理	2014-09-11	-	12 年	蔡乐女士，金融投资学学士。2003 年 7 月至 2005 年 2 月任方正证券固定收益部项目经理；2005 年 3 月至 2014 年 8 月历任中再资产管

					理股份有限公司固定收益部研究员兼交易员、投资经理助理、自有账户投资经理。2014 年 8 月加入光大保德信基金管理有限公司，现任光大保德信现金宝货币市场基金基金经理、光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金基金经理、光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、光大保德信耀钱包货币市场基金基金经理、光大保德信欣鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、光大保德信尊享一年定期开放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。

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，美国经济保持弱复苏格局，日本和欧洲经济增长缓慢，而英国脱欧事件导致全球避险情绪升温，黄金、美元等大幅上涨，德国、日本等已经进入负利率时代，美联储加息预期一再延后，全球经济增长预期进一步下调。国内经济在年初的天量信贷刺激下保持了稳定的增长，工业企业经历了去库存小周期，企业盈利有所好转，但企业再投资意愿低迷，制造业投资未见显著回升，经济在房地产投资和基建投资拉动下保持了平稳增长的态势。上半年通胀水平前高后低，汇率贬值压力不减，货币政策保持中性稳健，央行不断通过公开市场操作日常化以及 MLF 操作常态化呵护资金面，保证了货币市场资金的稳定。债券市场在经济和通胀预期波动下表现为震荡行情，利率债收益率先升后降，总体保持小幅上行，信用债 4 月份受中铁物资等信用事件影响出现了较大幅度调整，高等级收益率整体小幅上行，中低等级收益率小幅下行。2016 年上半年中债综合全价（总值）指数下跌 0.02%。权益市场经历了年初的熔断风险后，春节后逐渐回升，结构化行情特征突出，整体体现出宽幅震荡的走势。

按照契约要求，添天盈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盈理财债券 A 份额净值增长率为 1.3276%，业绩比较基准收益率为 0.6825%；光大保德信添天盈理财债券 B 份额净值增长率为 1.4490%，业绩比较基准收益率为 0.6825%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，美国经济虽然保持了弱复苏格局，但近期政治黑天鹅事件频出，导致国际风险偏好持续降低，同时，不景气的欧洲经济也引发市场对各国货币的宽松预期，对债市形成利好。国内经济增长压力依然较大，房地产销售和投资增速连续回落，加之去年下半年的高基数，下半年房地产的增速可能明显回落。基建投资面临下行压力，民间投资增速回升乏力，经济增长压力将进一步加大。通胀预计下半年前低后高，保持温和增长。但在去产能、去杠杆的大背景下，预计货币政策将继续维持稳健。在基本面的推动下，预期债券市场将保持慢牛格局，收益率中枢进一步下行，但信用风险仍对市场造成影响，信用利差有扩大的可能。权益市场仍将维持震荡格局，主题性行情仍将为市场提供绝对收益机会。

操作方面，添天盈基金在兼顾收益性、流动性的前提下，会适时调整各类资产的投资比例。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，在控制组合风险

的基础上，为投资者积极赚取收益。

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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，光大保德信添天盈月度理财债券型 A 实施利润分配的金额为 134,981.33 元。

报告期内，光大保德信添天盈月度理财债券型 B 实施利润分配的金额为 7,493,603.07 元。

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

本托管人复核审查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。

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：光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金

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	6.4.8.1	451,586,606.07	457,441,826.08
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-

交易性金融资产	6.4.8.2	-	-
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	6.4.8.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.8.4	80,000,360.00	70,000,465.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.8.5	495,599.42	424,048.15
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.8.6	-	-
资产总计		532,082,565.49	527,866,339.23
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		109,315.98	111,981.31
应付托管费		34,981.14	35,834.02
应付销售服务费		6,213.61	6,683.72
应付交易费用	6.4.8.7	3,889.65	3,473.00
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.8.8	58,726.04	119,000.00
负债合计		213,126.42	276,972.05
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.8.9	531,869,439.07	527,589,367.18
未分配利润	6.4.8.10	-	-
所有者权益合计		531,869,439.07	527,589,367.18
负债和所有者权益总计		532,082,565.49	527,866,339.23

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 531,869,439.07 份，其中 A 级基金份额总额 7,203,320.41 份，B 级基金份额总额 524,666,118.66 份。

6.2 利润表

会计主体：光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金

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
一、收入		8,614,951.71	12,738,595.06
1.利息收入		8,614,951.71	12,400,489.03
其中：存款利息收入	6.4.8.11	7,447,965.56	9,580,712.63
债券利息收入		-	167,305.46
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,166,986.15	2,652,470.94
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-	338,106.03
其中：股票投资收益	6.4.8.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.8.13	-	338,106.03
资产支持证券投资收益	6.4.8.14	-	-
衍生工具收益	6.4.8.15	-	-
股利收益	6.4.8.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.8.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.8.18	-	-
减：二、费用		986,367.31	1,070,268.23
1. 管理人报酬		660,552.33	692,637.40
2. 托管费		211,376.75	221,644.02
3. 销售服务费		38,670.63	78,558.72
4. 交易费用	6.4.8.19	-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.8.20	75,767.60	77,428.09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,628,584.40	11,668,326.83
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,628,584.40	11,668,326.83

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金

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）	527,589,367.18	-	527,589,367.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,628,584.40	7,628,584.40
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）	4,280,071.89	-	4,280,071.89
其中：1.基金申购款	9,735,435.35	-	9,735,435.35
2.基金赎回款	-5,455,363.46	-	-5,455,363.46
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）	-	-7,628,584.40	-7,628,584.40
五、期末所有者权益（基金净值）	531,869,439.07	-	531,869,439.07
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）	595,468,834.16	-	595,468,834.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,668,326.83	11,668,326.83
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）	-69,787,228.80	-	-69,787,228.80
其中：1.基金申购款	102,176,117.18	-	102,176,117.18
2.基金赎回款	-171,963,345.98	-	-171,963,345.98
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）	-	-11,668,326.83	-11,668,326.83
五、期末所有者权益（基金净值）	525,681,605.36	-	525,681,605.36

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

光大保德信添天盈季度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] 1069 号《关于核准光大保德信添天盈季度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《光大保德信添天盈季度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 2,051,940,874.41 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 412 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《光大保德信添天盈季度理财债券型证券投资基金基金合同》于 2012 年 10 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,052,329,955.03 份基金份额,其中认购资金利息折合 389,080.62 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金份额持有人大会以通讯方式召开,表决期限为 2014 年 2 月 26 日起至 2014 年 3 月 18 日 24 时止,会议审议通过了《关于修改光大保德信添天盈季度理财债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《光大保德信添天盈季度理财债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致,基金管理人已对本基金基金合同的内容进行修改,并已于 2014 年 4 月 15 日完成中国证监会备案手续,本次基金份额持有人大会决定的事项自 2014 年 4 月 15 日起生效。《光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金基金合同》自本次基金份额持有人大会决议生效日所在运作周期届满的次日起生效。该议案涉及基金名称、运作周期及最低存续规模等内容修改。

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《光大保德信添天盈月度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、逆回购、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

于银行存款和到期日不晚于最近一个开放日的逆回购的比例不低于基金资产的 80%，其中银行存款包括现金、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：人民币 7 天通知存款利率（税后）。

6.4.2 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》、《光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金的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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 重要会计政策和会计估计

6.4.5.1 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号

《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》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

6.4.6 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.6.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.6.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.6.3 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。

6.4.7 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。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(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派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

6.4.8重要财务报表项目的说明

6.4.8.1 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	1,586,606.07
定期存款	450,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	300,000,000.00
存款期限 1 个月内	-
存款期限 3 个月-1 年	150,000,000.00
其他存款	-
合计	451,586,606.07

6.4.8.2 交易性金融资产

本基金本报告期末无交易性金融资产余额。

6.4.8.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.8.4 买入返售金融资产

6.4.8.4.1 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	80,000,360.00	-
合计	80,000,360.00	-

6.4.8.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.8.5 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	416.12
应收定期存款利息	426,250.11
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	68,933.07
应收申购款利息	-
其他	0.12
合计	495,599.42

6.4.8.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.8.7 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	3,889.65
合计	3,889.65

6.4.8.8 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	-
其他	-
应付银行划款手续费	-
预提审计费	24,863.02
预提信息披露费	24,863.02
账户维护费	9,000.00
合计	58,726.04

6.4.8.9 实收基金

光大保德信添天盈理财债券 A 类

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	10,416,851.59	10,416,851.59
本期申购	2,241,832.28	2,241,832.28
本期赎回（以“-”号填列）	-5,455,363.46	-5,455,363.46
本期末	7,203,320.41	7,203,320.41

光大保德信添天盈理财债券 B 类

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	517,172,515.59	517,172,515.59
本期申购	7,493,603.07	7,493,603.07
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	524,666,118.66	524,666,118.66

注：申购份额含红利再投、转换入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。

6.4.8.10 未分配利润

光大保德信添天盈理财债券 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
上年度末	0.00	0.00	-
本期利润	134,981.33	-	134,981.33
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	-134,981.33	-	-134,981.33
本期末	-	-	-

光大保德信添天盈理财债券 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
上年度末	0.00	0.00	-
本期利润	7,493,603.07	-	7,493,603.07

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	-7,493,603.07	-	-7,493,603.07
本期末	-	-	-

6.4.8.11 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	24,213.44
定期存款利息收入	7,423,729.30
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	22.70
其他	0.12
合计	7,447,965.56

6.4.8.12 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.8.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.8.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.8.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具投资收益。

6.4.8.16 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.8.17 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

6.4.8.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.8.19 交易费用

本基金本报告期无交易费用。

6.4.8.20 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	24,863.02
信息披露费	24,863.02
银行间汇划费用	7,241.56
帐户维护费	18,000.00
其他费用	800.00
合计	75,767.60

6.4.9 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无要披露的资产负债表日后事项。

6.4.10 关联方关系

6.4.10.1 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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

6.4.10.2 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
中国建设银行股份有限公司（简称“建设银行”）	基金托管人、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

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。

6.4.11 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.11.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.11.1.1 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。

6.4.11.1.2 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。

6.4.11.1.3 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。

6.4.11.1.4 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。

6.4.11.1.5 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。

6.4.11.2 关联方报酬

6.4.11.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的管理费	660,552.33	692,637.40
其中：支付销售机构的客户维护费	6,385.59	37,135.60

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。

当出现巨额赎回时，为保护投资者利益，本基金管理人与基金托管人协商一致后，有权不计提巨额赎回日下一个工作日的管理费。

6.4.11.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	211,376.75	221,644.02

注：支付基金托管人建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.08% 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 0.08% / 当年天数。

6.4.11.2.3 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		
	光大保德信添天盈 理财债券 A 类	光大保德信添天盈理财 债券 B 类	合计
光大保德信	29.32	25,911.72	25,941.04
光大证券	40.02	-	40.02
建设银行	7,539.08	-	7,539.08
合计	7,608.42	25,911.72	33,520.14
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		
	光大保德信添天盈 理财债券A类	光大保德信添天盈理财 债券B类	合计
光大证券	185.01	-	185.01
建设银行	17,508.33	-	17,508.33
光大保德信	1,024.98	25,071.03	26,096.01
合计	18,718.32	25,071.03	43,789.35

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

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 X 约定年费率 / 当年天数。

当出现巨额赎回时，为保护投资者利益，本基金管理人与基金托管人协商一致后，有权不计提巨额赎回日下一个工作日的销售服务费。

6.4.11.3 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。

6.4.11.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.11.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间管理人未投资本基金。

6.4.11.4.2 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

光大保德信添天盈理财债券 A 类

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。

光大保德信添天盈理财债券 B 类

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。

6.4.11.5 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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	1,586,606.07	24,213.44	7,292,974.83	21,956.05

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.11.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.11.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.12 利润分配情况

1、光大保德信添天盈理财债券 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
134,981.33	-	-	134,981.33	-

2、光大保德信添天盈理财债券 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
7,493,603.07	-	-	7,493,603.07	-

注：本基金在本年度累计分配收益 7,628,584.40 元，以红利再投资方式转入实收基金 7,628,584.40 元。

6.4.13 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.13.1 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/增发证券而持有的流通受限的证券。

6.4.13.2 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。

6.4.13.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.13.3.1 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。

6.4.13.3.2 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。

6.4.14 金融工具风险及管理

6.4.14.1 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，并向风险管理工作委员会报告评估情况。

风险管理工作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工作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。

6.4.14.2 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。

本期末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。

6.4.14.3 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和到期日不晚于最近一个开放

日的逆回购的比例不低于基金资产的 80%，其中银行存款包括现金、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的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%。

本期末本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个半月以内且不计息，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。

6.4.14.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.14.4.1 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。

6.4.14.4.1.1 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
资产							
银行存款	1,586,606.07	300,000.00	150,000.00	-	-	-	451,586.606.07
结算备付金	-	-	-	-	-	-	0.00
买入返售金融资产	80,000.36	-	-	-	-	-	80,000.36
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	0.00
应收利息	-	-	-	-	-	495,599.4	495,599.4

						2	2
资产总计	81,586,966.07	300,000,000.00	150,000,000.00	0.00	0.00	495,599.42	532,082,565.49
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	109,315.98	109,315.98
应付托管费	-	-	-	-	-	34,981.14	34,981.14
应付销售服务费	-	-	-	-	-	6,213.61	6,213.61
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,889.65	3,889.65
其他负债	-	-	-	-	-	58,726.04	58,726.04
负债总计	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	213,126.42	213,126.42
利率敏感度缺口	81,586,966.07	300,000,000.00	150,000,000.00	0.00	0.00	282,473.00	531,869,439.07
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	457,441,826.08	-	-	-	-	-	457,441,826.08
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	70,000,465.00	-	-	-	-	-	70,000,465.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	424,048.15	424,048.15
资产总计	527,442,291.08	-	-	-	-	424,048.15	527,866,339.23
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	111,981.31	111,981.31
应付托管费	-	-	-	-	-	35,834.02	35,834.02
应付销售服务费	-	-	-	-	-	6,683.72	6,683.72
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,473.00	3,473.00
其他负债	-	-	-	-	-	119,000.00	119,000.00

						0	0
负债总计						276,972.05	276,972.05
利率敏感度缺口	527,442,291.08					147,076.10	527,589,367.18

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

6.4.14.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末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。

6.4.14.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.14.4.3 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。

6.4.14.4.3.1 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 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	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	80,000,360.00	15.04
	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	451,586,606.07	84.87
4	其他各项资产	495,599.42	0.09
5	合计	532,082,565.49	100.00

7.2 债券回购融资情况

本报告期本基金未进行债券回购融资。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本报告期本基金未进行债券回购融资。

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	72
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	84
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	1

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。

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	15.34	-
	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	84.61	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

合计	99.95	-
----	-------	---

7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未投资债券。

7.5 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

本基金本报告期末未投资债券。

7.6“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	0.0000%
报告期内偏离度的最低值	0.0000%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0000%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内无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

本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

7.7 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

本基金本报告期末未投资资产支持证券。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 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。

7.8.2 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。

7.8.3 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	495,599.42
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	495,599.42

7.8.4 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

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
光大保德信添天盈理财债券 A 类	558	12,909.18	0.00	0.00%	7,203,320.41	100.00%

光大保德信添天盈理财债券 B 类	1	524,666,118.66	524,666,118.66	100.00%	0.00	0.00%
合计	559	951,465.90	524,666,118.66	98.65%	7,203,320.41	1.35%

8.2 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	光大保德信添天盈理财债券 A 类	2,174.30	0.03%
	光大保德信添天盈理财债券 B 类	0.00	0.00%
	合计	2,174.30	0.00%

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	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	光大保德信添天盈理财债券 A 类	0
	光大保德信添天盈理财债券 B 类	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	光大保德信添天盈理财债券 A 类	0
	光大保德信添天盈理财债券 B 类	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	光大保德信添天盈理财债券 A 类	光大保德信添天盈理财债券 B 类
基金合同生效日（2012 年 10 月 25 日）基金份额总额	1,727,443,165.54	324,886,789.49
本报告期期初基金份额总额	10,416,851.59	517,172,515.59
本报告期基金总申购份额	2,241,832.28	7,493,603.07
减：本报告期基金总赎回份额	5,455,363.46	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	7,203,320.41	524,666,118.66

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	
安信证券	1	-	-	-	-	-

注：本报告期内本基金未通过租用证券公司交易单元进行股票投资。

(1) 报告期内租用证券公司交易单元变更情况

报告期内本基金租用的证券公司交易单元无变更。

(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。

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
安信证券	-	-	4,000,000.00	100.00%	-	-

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)以上的情况。

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	《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	《证券时报》	2016-01-08
3	光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金 2016 年第 1 期运作周期开放日安排的公告	《证券时报》	2016-01-13
4	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	《证券时报》	2016-01-14
5	关于旗下部分基金产品新增上海长量基金销售投资顾问有限公司为代销机构并参与其交易费率优惠的公告	《证券时报》	2016-01-20
6	光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	《证券时报》	2016-01-20
7	关于旗下部分基金产品新增深圳新兰德证券投资咨询有限公司为代销机构并参与其交易费率优惠活动的公告	《证券时报》	2016-01-21
8	光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金 2016 年第 2 期运作周期开放日安排的公告	《证券时报》	2016-02-15
9	光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金 2016 年第 3 期运作周期开放日安排的公告	《证券时报》	2016-03-15
10	光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金 2015 年年度报告	《证券时报》	2016-03-28
11	光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金 2015 年年度报告摘要	《证券时报》	2016-03-28
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	《证券时报》	2016-04-07
13	光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金 2016 年第 4 期运作周期开放日安排的公告	《证券时报》	2016-04-13
14	光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	《证券时报》	2016-04-22
15	光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金 2016 年第 5 期运作周期开放日安排的公告	《证券时报》	2016-05-13
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	《证券时报》	2016-05-27

	动的公告		
17	光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金招募说明书（更新）	《证券时报》	2016-06-08
18	光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金 招募说明书（更新）摘要	《证券时报》	2016-06-08
19	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	《证券时报》	2016-06-14
20	光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金 2016 年第 6 期运作周期开放日安排的公告	《证券时报》	2016-06-15
21	光大保德信基金管理有限公司关于旗下光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金新增上海陆金所资产管理有限公司为代销机构的公告	《证券时报》	2016-06-27
22	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	《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添天盈月度理财债券型证券投资基金的文件
- 2、光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金基金合同
- 3、光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金招募说明书
- 4、光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金托管协议
- 5、光大保德信添天盈月度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盈月度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

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
第 40 页共 41 页

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。

光大保德信基金管理有限公司

二〇一六年八月二十七日