

**光大保德信现金宝货币市场基金**  
**2016 年年度报告**  
**2016 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年三月二十八日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料已经审计，安永华明会计师事务所为本基金财务出具了 2016 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 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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.....	6
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、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
<b>§4 管理人报告</b> .....	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
4.9 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.....	18
<b>§5 托管人报告</b> .....	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	19
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.....	19
<b>§6 审计报告</b> .....	19
6.1 管理层对财务报表的责任.....	19
6.2 注册会计师的责任.....	19
6.3 审计意见.....	20
<b>§7 年度财务报表</b> .....	20
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	25
<b>§8 投资组合报告</b> .....	50
8.1 期末基金资产组合情况.....	50
8.2 债券回购融资情况.....	50
<b>8.3 基金投资组合平均剩余期限</b> .....	50
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	51
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
8.6 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.....	52

8.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 .....	52
8.8 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 .....	53
8.9 投资组合报告附注 .....	53
<b>§9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>54</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
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 .....	54
<b>§10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>55</b>
<b>§11 重大事件揭示</b> .....	<b>55</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
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 .....	55
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
11.4 基金投资策略的改变 .....	55
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
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 .....	56
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	56
11.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况 .....	57
11.9 其他重大事件 .....	57
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>60</b>
<b>§13 备查文件目录</b> .....	<b>60</b>
13.1 备查文件目录 .....	60
13.2 存放地点 .....	60
13.3 查阅方式 .....	60

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	光大保德信现金宝货币市场基金	
基金简称	光大保德信现金宝货币	
基金主代码	000210	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 9 月 5 日	
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	8,393,667,117.21 份	
下属分级基金的基金简称	光大保德信现金宝货币 A	光大保德信现金宝货币 B
下属分级基金的交易代码	000210	000211
报告期末下属分级基金的份额总额	84,236,232.78 份	8,309,430,884.43 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力争保持基金资产的流动性和安全性，追求高于业绩比较基准的稳定收益。
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。银行存款一般具有收益稳定、风险低等基本特征，特别是机构投资者在投资银行存款时，往往能获得比普通投资者更高的收益率。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	人民币活期存款利率(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，其预期收益和风险低于债券型基金、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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	魏丹	李芳菲
	联系电话	021-80262888-605	010-66060069
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		4008-202-888	95599
传真		021-80262468	010-63201816
注册地址		上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢，6层至10层	北京市东城区建国门内大街69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	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		200002	100031
法定代表人		林昌	蒋超良

## 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、中国农业银行股份有限公司的办公场所。

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
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、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	2016 年		2015 年		2014 年	
	光大保德信现金宝货币 A	光大保德信现金宝货币 B	光大保德信现金宝货币 A	光大保德信现金宝货币 B	光大保德信现金宝货币 A	光大保德信现金宝货币 B
本期已实现收益	2,133,641.78	256,582,112.87	4,617,735.82	168,201,376.58	2,715,274.33	34,895,325.99
本期利润	2,133,641.78	256,582,112.87	4,617,735.82	168,201,376.58	2,715,274.33	34,895,325.99
本期净值收益率	2.4050%	2.6512%	3.6165%	3.8656%	4.1696%	4.4182%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末		2015 年末		2014 年末	
	光大保德信现金宝货币 A	光大保德信现金宝货币 B	光大保德信现金宝货币 A	光大保德信现金宝货币 B	光大保德信现金宝货币 A	光大保德信现金宝货币 B
期末基金资产净值	84,236,232.78	8,309,430,884.43	95,822,864.11	21,757,932,061.59	80,474,889.27	1,397,124,519.42
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2016 年末		2015 年末		2014 年末	
	光大保德信现金宝货币 A	光大保德信现金宝货币 B	光大保德信现金宝货币 A	光大保德信现金宝货币 B	光大保德信现金宝货币 A	光大保德信现金宝货币 B
累计净值收益率	11.9217%	12.8146%	9.2932%	9.9009%	5.4786%	5.8107%

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

##### 1. 光大保德信现金宝货币 A:

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
过去三个月	0.5677%	0.0017%	0.0894%	0.0000%	0.4783%	0.0017%
过去六个月	1.1983%	0.0019%	0.1789%	0.0000%	1.0194%	0.0019%
过去一年	2.4050%	0.0015%	0.3558%	0.0000%	2.0492%	0.0015%
过去三年	10.5328%	0.0033%	1.0656%	0.0000%	9.4672%	0.0033%
自基金合同生效 起至今	11.9217%	0.0033%	1.1803%	0.0000%	10.7414%	0.0033%

##### 2. 光大保德信现金宝货币 B:

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
过去三个月	0.6284%	0.0017%	0.0894%	0.0000%	0.5390%	0.0017%
过去六个月	1.3206%	0.0019%	0.1789%	0.0000%	1.1417%	0.0019%
过去一年	2.6512%	0.0015%	0.3558%	0.0000%	2.2954%	0.0015%
过去三年	11.3299%	0.0033%	1.0656%	0.0000%	10.2643%	0.0033%
自基金合同生效 起至今	12.8146%	0.0033%	1.1803%	0.0000%	11.6343%	0.0033%

#### 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

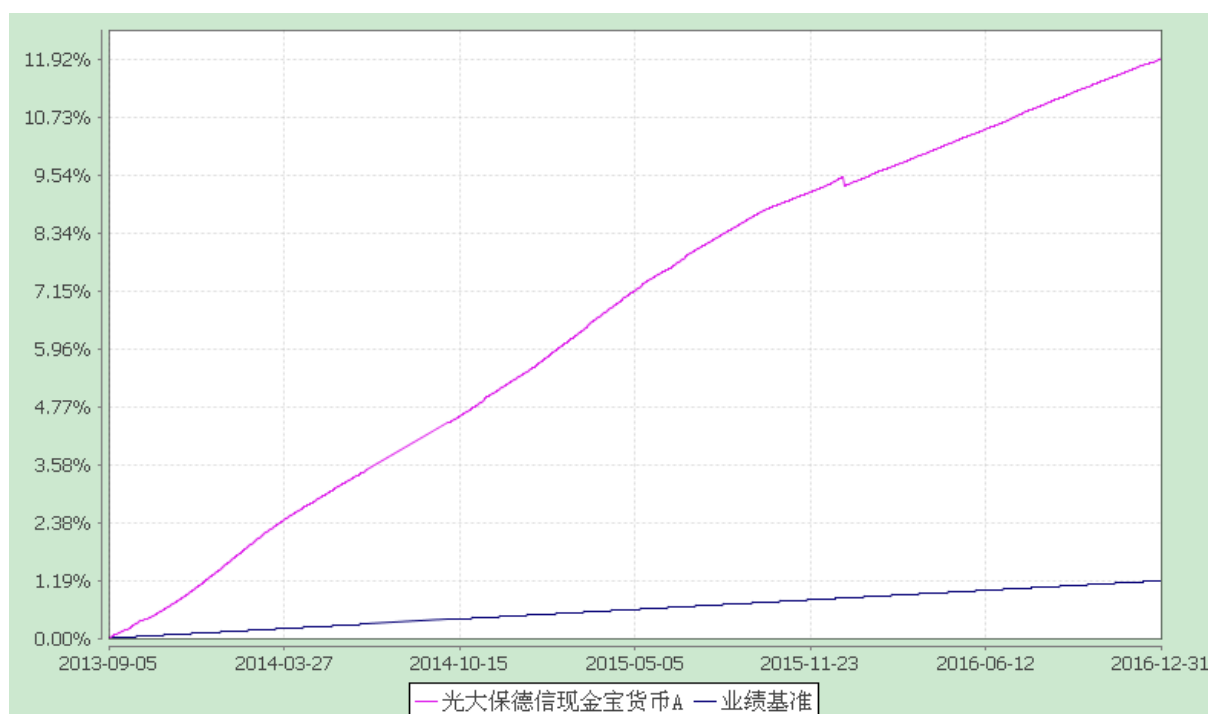
光大保德信现金宝货币市场基金

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

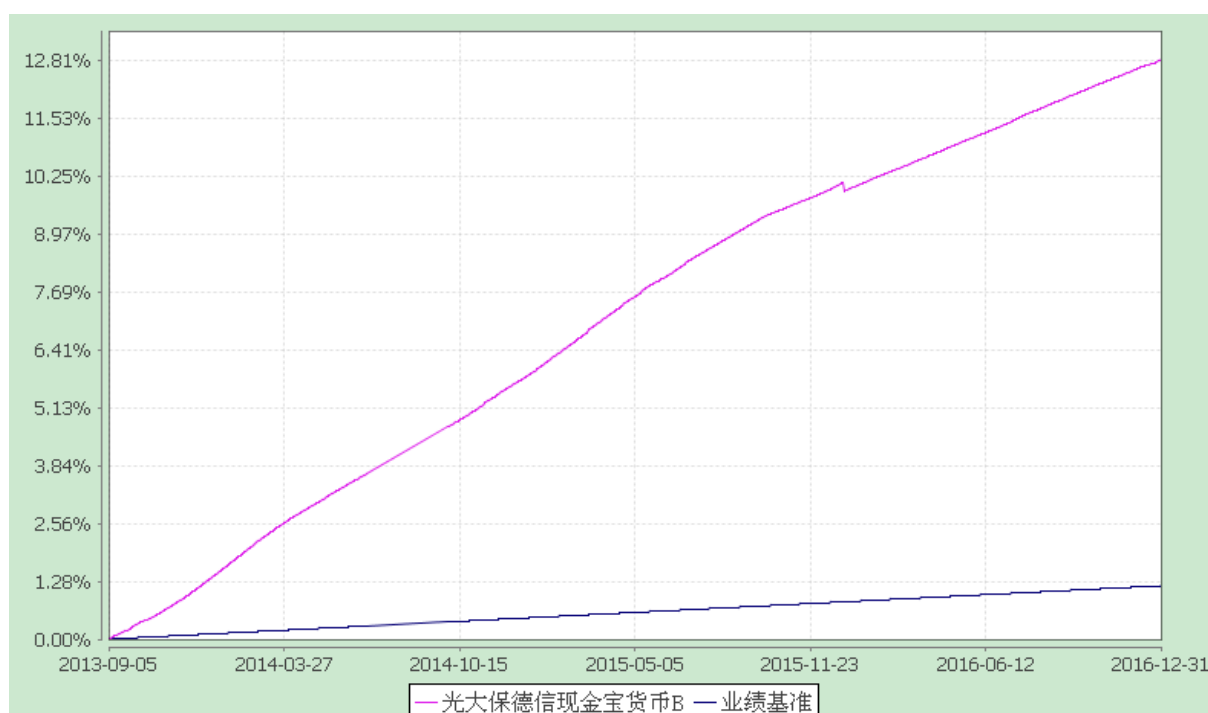
(2013 年 9 月 5 日至 2016 年 12 月 31 日)

##### 1、光大保德信现金宝货币 A





## 2、光大保德信现金宝货币 B



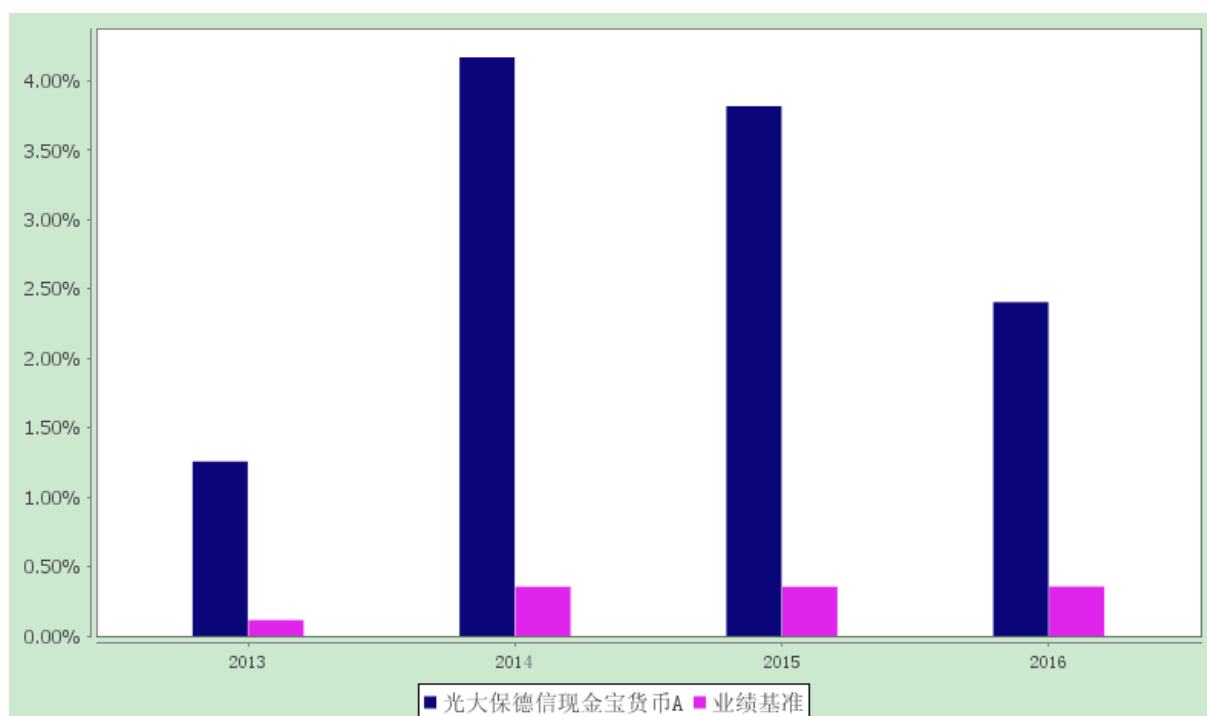
注：根据合同，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金已于基金合同规定的期限内完成建仓并达到本基金合同约定的投资比例。

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

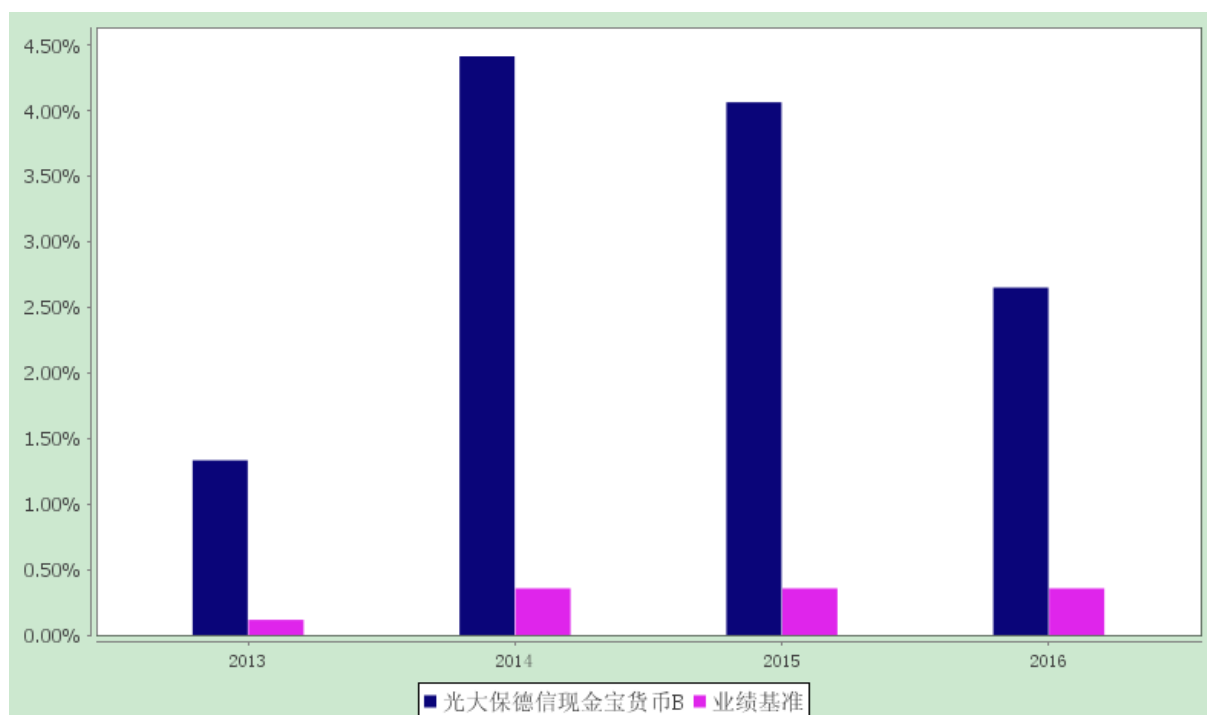
光大保德信现金宝货币市场基金

自基金合同生效以来基金净收益率与业绩比较基准收益率的对比图

### 1、光大保德信现金宝货币 A



### 2、光大保德信现金宝货币 B



注：本基金基金合同于 2013 年 9 月 5 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

光大保德信现金宝货币 A:

单位：人民币元

年度	已按再投资 形式转实收 基金	直接通过应付赎 回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合 计	备注
2016	2,133,641.78	-	-	2,133,641.78	-
2015	4,617,735.82	-	-	4,617,735.82	-
2014	2,715,274.33	-	-	2,715,274.33	-
合计	9,466,651.93	-	-	9,466,651.93	-

光大保德信现金宝货币 B:

单位：人民币元

年度	已按再投资 形式转实收 基金	直接通过应付赎 回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合 计	备注
2016	256,582,112. 87	-	-	256,582,112.87	-
2015	168,201,376. 58	-	-	168,201,376.58	-
2014	34,895,325.9 9	-	-	34,895,325.99	-
合计	459,678,815. 44	-	-	459,678,815.44	-

## §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 12 月 31 日，光大保德信旗下管理着 30 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

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、光大保德信崇尚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、光大保德信风格轮动混合型证券投资基金、光大保德信产业新动力灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信永鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信恒利纯债债券型证券投资基金、光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信诚鑫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		
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、光大保德信崇尚一年定期开放债券型证券投资基金基金经理、光大保德信吉鑫灵活配置混

					合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---------------

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人本着诚实信用、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，本基金在同日内、3 日内、5 日内同向成交价格与其他投资组合无显著差异，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

2016 年一季度债市博弈多空双方势力均衡，二季度小的流动性危机爆发。2 月份降准前后货币政策上宽松预期利好多头，然而物价数据、信贷数据等对通胀预期压力增加利空债市，因而整个一季度呈现震荡格局。但是到了二季度央行降准使得货币宽松的利好阶段性出尽，而政府工作报告出台显示财政赤字目标增加，积极的财政政策使得市场对经济过热的预期加剧，加之经济数据显示基本面有短暂回暖，进一步对债市形成压制。在众多不利因素不断发酵的过程中，信用事件 3-4 月份的频发成为 4 月份流动性危机爆发的导火索。2016 年 3 月，东北特钢短期融资券发生实质违约，投

资人对于地方国有企业刚性兑付的幻想破灭，实质性违约逐步向评级高、期限短、股东背景较强的方向演化；4月11日，中铁物资股份有限公司公告暂停15铁物资SCP004的交易；4月20日、21日两只城投债分别公告提前还款被打上另类违约的标签。短端风险溢价快速增加，投资者不得不快速去杠杆，债市在4月下旬经历一波快速调整，10年期国债收益率上行至2.95%。三季度以配置力量推动为主。进入6月份，国内方面，基本面数据较弱使得前期对实体经济转暖的猜测被证伪，通胀担忧下降。外部环境方面，6月美国非农数据较差、英国退欧的大环境下，避险情绪升温。从而配置力量强势发力，推动了近2个月的债券牛市。具体来看，此轮债牛又可以从理财新规出台前后分为两个阶段。6月到7月，由于全球的负利率背景加上国内的投资增速偏弱，共同推动收益率重新回到2.8%一线，随后10年期国债收益率短暂横盘整理。7月27日理财新规出台，对理财资金投资在权益和非标做出限制，刺激了追求绝对收益的理财资金的委外需求，强化了配置牛的逻辑。长端利率突破前期箱体，债市展开第二个阶段的快牛，市场上的超长期债券、中低评级债券、分级A等一切价值洼地被快速填平，10年期国债收益率最低下探到2.65%。但是从8月份开始，央行的货币政策其实已经开始悄悄的变化。8月份央行增加对14D的续作比例，通过拉长公开市场操作资金的久期的方式引导市场降杠杆，打破关于收益率下行的一致性预期，债市收益率先在恐慌中展开调整，10年期国债在9月上旬上行至2.75%附近。但是投资者并没有对央行降杠杆的决心给予足够的重视，9月中旬开始，收益率又开始一波回调。尤其是十一期间出台了房地产调控政策后，对国庆节后的债市形成进一步的利好刺激。10年国债收益率从2.75%快速下行至2.65%左右。四季度流动性拐点，利空因素集中爆发。到了四季度，国际上不确定事件增多，国内债市更多的受到国际资本市场的影响。欧洲央行释放信号声称逐步退出量化宽松，美联储12月加息临近，全球的低利率环境在逐步转变。9月以来美国、欧洲等世界主要发达国家的10年期国债收益率快速上行，致使国内外债券收益率利差拉大，进一步引起资本外逃。11月初，特朗普获胜，其主张的积极财政政策成为众多不确定事件中较为确定的因素，对债市进一步形成恐慌性打压。国内环境方面，商品价格快速上涨、春节时间错位等因素致使对通胀上升的担忧加剧；尤其是临近年关，资金面紧张因素增加，加上12月中旬爆发的债券代持违约事件，使得本已利空重重的债市更加不堪一击，终于再次爆发了更严重的流动性风险，利率展开了12月下旬的大踏步上行，10年期国债收益率从12月初的3.0%最高触及到3.4%。

本报告期内，本基金保持了仓位调整的灵活性，由于同业存款价格大幅走低，组合配置上增加了中高等级短融和逆回购的仓位，大幅降低了同业存款的仓位。同时由于期限利差甚小，组合久期也有所缩短。通过审慎和积极的管理，在把握流动性的基础上，积极努力为投资者赚取收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内 A 份额净值增长率为 2.4050%，业绩比较基准收益率为 0.3558%；B 份额净值增长率为 2.6512%，业绩比较基准收益率为 0.3558%。

#### 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 2017 年,国内经济自去年四季度开始企稳,通胀逐渐升温。央行在人民币持续贬值压力的背景下,用锁短放长的操作方式,去杠杆防风险意图明显,我们认为短期内央行政策很难宽松。另外,今年以来金融监管趋严,理财新规、资管八条底线、将表外理财纳入 MPA 广义信贷测算等政策逐渐加码,未来配置压力将会有所减弱,多种因素合力作用,我们认为债市未来仍存回调风险。利率债方面,2017 年经济趋稳,通胀中枢也可能比今年高。在人民币汇率压力和资产泡沫因素的制约下,货币政策大概率会维持紧平衡。我们预计明年债市依然会维持震荡。明年债券市场风险不可低估,尤其是一季度,利率调整力度可能较大。全年来看,我们认为依然延续今年震荡市行情。信用债方面,三季报显示,16 年前三季度 A 股非金融企业整体营业收入、营业利润和净利润增速持续走高,整体信用基本面短期改善,短期偿债能力增强。但我们注意到,价格的上涨主要是由于供给侧收缩,而需求并没有明显改善,这种价格的上涨不具有可持续性。另外,下游复苏的行业集中在地产和汽车等,这些行业受政策影响较大,未来政策的变化可能会给这些行业带来不利影响。另外我们还注意到,过剩产能行业的资产负债率并没有下降,明年随着债转股的进一步推进,信用风险也可能随之上升。

操作方面,管理人将继续把握基金的流动性和收益性的平衡,保持对短融和逆回购的重点配置,同时捕捉阶段性利率走高的机会,锁定高收益资产。在保持基金良好流动性的同时提高静态收益,同时积极灵活把握市场波段操作。我们将密切跟踪经济走势、政策和资金面的情况,秉承稳健、专业的投资理念,优化组合结构,控制风险,勤勉尽责地维护持有人的利益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期内,基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面:

督察长和监察稽核部督促、协助各业务部门按照法律法规和监管机构规定对相关制度的合法性、规范性和时效性完善各项内部管理制度和业务流程,明确风险控制职责并具体落实相应措施,提高



全体员工的风险意识，有效保障基金份额持有人的利益。

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

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

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

根据董事会和管理层的要求，以及法规要求和公司业务发展需要，督察长和监察稽核部以风险为导向，计划并实施了数个内部专项审计项目，及时发现潜在的问题和风险，促使公司规范运作，切实保障基金份额持有人的合法权益。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

报告期内，公司设立由负责运营的高管、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

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。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

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

#### **4.9 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**

在托管光大保德信现金宝货币市场基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵循《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《光大保德信现金宝货币市场基金合同》、《光

大保德信现金宝货币市场基金托管协议》的约定，对光大保德信现金宝货币市场基金管理人—光大保德信基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，光大保德信基金管理有限公司在光大保德信现金宝货币市场基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《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

本托管人认为，光大保德信基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的光大保德信现金宝货币市场基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## §6 审计报告

安永华明（2017）审字第 60467078\_B12 号

光大保德信现金宝货币市场基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的光大保德信现金宝货币市场基金财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表和 2016 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

### 6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是基金管理人光大保德信基金管理有限公司的责任。这种责任包括：

（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

### 6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守

则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 审计意见

我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了光大保德信现金宝货币市场基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）中国注册会计师

濮晓达 朱宝钦

上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼

2017-03-27

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：光大保德信现金宝货币市场基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	3,147,230,638.02	10,312,691,263.63
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	3,433,119,284.30	4,877,428,920.68
其中：股票投资		-	-

基金投资		-	-
债券投资		3,433,119,284.30	4,877,428,920.68
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	1,771,531,457.30	6,575,973,223.94
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	44,829,060.51	91,347,078.74
应收股利		-	-
应收申购款		300.00	77,412.02
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>8,396,710,740.13</b>	<b>21,857,517,899.01</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬	7.4.10.2	2,021,936.63	2,567,999.71
应付托管费	7.4.10.2	640,577.89	778,181.73
应付销售服务费	7.4.10.2	81,625.24	97,817.20
应付交易费用	7.4.7.7	70,483.16	155,474.67
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	7.4.7.8	229,000.00	163,500.00
<b>负债合计</b>		<b>3,043,622.92</b>	<b>3,762,973.31</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	7.4.7.9	8,393,667,117.21	21,853,754,925.70
未分配利润	7.4.7.10	-	-
<b>所有者权益合计</b>		<b>8,393,667,117.21</b>	<b>21,853,754,925.70</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>8,396,710,740.13</b>	<b>21,857,517,899.01</b>

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 8,393,667,117.21 份（A 类 84,236,232.78 份；B 类 8,309,430,884.43 份）。

## 7.2 利润表

会计主体：光大保德信现金宝货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>317,523,386.38</b>	<b>200,644,695.26</b>
1.利息收入		328,083,926.98	196,823,664.87
其中：存款利息收入	7.4.7.11	145,249,059.18	84,285,382.36
债券利息收入		156,668,000.97	70,432,320.05
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		26,166,866.83	42,105,962.46
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-10,560,540.60	3,793,469.40
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-10,560,540.60	3,793,469.40
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-

股利收益	7.4.7.15	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	27,560.99
<b>减：二、费用</b>		<b>58,807,631.73</b>	<b>27,825,582.86</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2	32,675,794.00	17,741,644.89
2. 托管费	7.4.10.2	9,929,625.60	5,380,185.88
3. 销售服务费	7.4.10.2	1,208,273.32	866,567.81
4. 交易费用	7.4.7.18	-	1,114.63
5. 利息支出		14,569,135.01	3,452,730.10
其中：卖出回购金融资产支出		14,569,135.01	3,452,730.10
6. 其他费用	7.4.7.19	424,803.80	383,339.55
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>258,715,754.65</b>	<b>172,819,112.40</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>258,715,754.65</b>	<b>172,819,112.40</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：光大保德信现金宝货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	21,853,754,925.70	-	21,853,754,925.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	258,715,754.65	258,715,754.65
三、本期基金份额交易产生	-13,460,087,808.49	-	-13,460,087,808.49

的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	42,636,312,884.03	-	42,636,312,884.03
2.基金赎回款	-56,096,400,692.52	-	-56,096,400,692.52
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）	-	-258,715,754.65	-258,715,754.65
五、期末所有者权益（基金净值）	8,393,667,117.21	-	8,393,667,117.21
项目	上年度可比期间		
	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）	1,477,599,408.69	-	1,477,599,408.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	172,819,112.40	172,819,112.40
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）	20,376,155,517.01	-	20,376,155,517.01
其中：1.基金申购款	49,432,190,734.05	-	49,432,190,734.05
2.基金赎回款	-29,056,035,217.04	-	-29,056,035,217.04
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）	-	-172,819,112.40	-172,819,112.40
五、期末所有者权益（基金净值）	21,853,754,925.70	-	21,853,754,925.70

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：包爱丽，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

光大保德信现金宝货币市场基金（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”）证监许可[2013]700 号文《关于核准光大保德信现金宝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基金管理人向社会公开募集，基金合同于 2013 年 9 月 5 日生效，首次设立募集规模为 1,972,398,150.89 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和注册登记机构为光大保德信基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金根据投资者认（申）购本基金的金额，对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用，因此形成不同的基金份额等级，即 A 类和 B 类两类基金份额。若基金份额持有人在单个基金交易账户保留的 A 类基金份额达到或超过 500 万份时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金交易账户保留的 A 类基金份额全部升级为 B 类基金份额。若基金份额持有人在单个基金交易账户保留的 B 类基金份额低于 500 万份时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金交易账户保留的 B 类基金份额全部降级为 A 类基金份额。

根据基金管理人光大保德信基金管理有限公司于 2016 年 11 月 19 日发布的《光大保德信基金管理有限公司关于光大保德信现金宝货币市场基金修订基金合同部分条款的公告》，本基金的投资范围进行如下变更。变更前，本基金的投资范围为：现金；通知存款；短期融资券；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券；1 年以内（含 1 年）的银行定期存款、大额存单；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；期限在 1 年以内（含 1 年）的中央银行票据；变更后，本基金的投资范围为：1、现金；2、期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；3、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；4、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：人民币活期存款利率(税后)。

### 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

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。

#### 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金的金融资产分类为交易类金融资产及贷款和应收款项，在初始确认时以公允价值计量。本基金对所持有的债券投资以摊余成本法进行后续计量。本会计期间内，本基金持有的债券投资的摊余成本接近其公允价值。

本基金的金融负债于初始确认时归类为其他金融负债，以公允价值计量，并以摊余成本进行后续计量。

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

###### (1) 债券投资

买入银行间同业市场交易的债券，于成交日确认为债券投资；

债券投资按实际支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，

作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本，对于贴息债券，应作为债券投资成本；

卖出银行间同业市场交易的债券，于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (2) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金估值采用摊余成本法，其相当于公允价值。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，在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失。

本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值；

本基金金融工具的估值方法具体如下：

#### 1) 银行存款

基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际协议利率逐日计提利息；

#### 2) 债券投资

基金持有的付息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

#### 3) 回购协议

(1) 基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；

(2) 基金持有的买断式回购以协议成本列示，所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产；若融券业务到期无法履约，则继续持有债券资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值；

#### 4) 其他

(1) 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价格估值;

(2) 为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离,从而对基金份额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,采用其他可参考公允价值指标,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价格产生重大偏离,基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施,使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值;

(3) 如有新增事项,按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购、赎回引起的实收基金的变动分别于基金申购确认日、赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款,按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入,并根据提前支取所实际收到的利息收入与帐面已确认的利息收入的差额确认利息收入损失,列入利息收入减项,存款利息收入以净额列示。另外,根据中国证监会令第 120 号《货币市场基金监督管理办法》的规定,自 2016 年 2 月 1 日起,如果出现因提前支取而导致的利息损失的情形,基金管理人应当使用风险准备金予以弥补,风险准备金不足的,应当使用固有资金予以弥补;

(2) 债券利息收入按实际持有期内逐日计提。付息债券、贴现券购买时采用实际支付价款(包含

交易费用) 确定初始成本, 每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入;

(3) 买入返售金融资产收入, 按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时, 也可以用合同利率), 在回购期内逐日计提;

(4) 债券投资收益/损失于卖出债券成交日确认, 并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账;

(5) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方, 经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.33% 的年费率逐日计提;

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率逐日计提;

(3) A 类基金份额销售服务费按前一日 A 类基金资产净值 0.25% 的年费率逐日计提; B 类基金份额销售服务费按前一日 B 类基金资产净值 0.01% 的年费率逐日计提;

(4) 卖出回购金融资产支出, 按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时, 也可以用合同利率) 在回购期内逐日计提;

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定, 按实际支出金额, 列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的, 则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

(1) 本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权;

(2) 本基金收益分配方式为红利再投资, 免收再投资的费用;

(3) “每日分配、按月支付”。本基金根据每日基金收益情况, 以每万份基金已实现收益为基准, 为投资人每日计算当日收益并分配, 每月集中支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位, 小数点后第 3 位按去尾原则处理。因去尾形成的余额进行再次分配, 直到分完为止;

(4) 本基金根据每日收益情况, 将当日收益全部分配, 若当日已实现收益大于零时, 为投资人记正收益; 若当日已实现收益小于零时, 为投资人记负收益; 若当日已实现收益等于零时, 当日投资人不记收益;

(5) 本基金每日进行收益计算并分配时, 每月累计收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式, 投资人可通过赎回基金份额获得现金收益; 若投资人在每月累计收益支付时, 其累计收益为正值, 则为投资人增加相应的基金份额, 其累计收益为负值, 则缩减投资人基

金份额。若投资人赎回基金份额时，其对应收益将立即结清；若收益为负值，则从投资人赎回基金款中扣除；

(6) 当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；

(7) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.11 其他重要的会计政策和会计估计

本年度本基金无其他重要的会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 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 营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[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；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

#### 7.4.6.2 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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[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。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
活期存款	230,638.02	49,691,263.63
定期存款	3,147,000,000.00	10,263,000,000.00
其中：存款期限		
1-3 个月	2,675,000,000.00	1,491,000,000.00
存款期限 1 个月 内	65,000,000.00	7,265,000,000.00
存款期限 3 个月 -1 年	407,000,000.00	1,507,000,000.00
其他存款	-	-
合计	3,147,230,638.02	10,312,691,263.63

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末			
		2016 年 12 月 31 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	3,433,119,284.30	3,431,576,000.00	-1,543,284.30	-0.0184
	合计	3,433,119,284.30	3,431,576,000.00	-1,543,284.30	-0.0184
项目		上年度末			
		2015 年 12 月 31 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	4,877,428,920.68	4,889,152,000.00	11,723,079.32	0.0536
	合计	4,877,428,920.68	4,889,152,000.00	11,723,079.32	0.0536

注：1：偏离金额=影子定价-摊余成本；

2：偏离度=偏离金额/基金资产净值。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。



7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	1,771,531,457.30	-
合计	1,771,531,457.30	-
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	6,575,973,223.94	-
交易所市场	-	-
合计	6,575,973,223.94	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	121.02	17,064.85
应收定期存款利息	13,402,899.32	18,525,621.91
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	30,822,148.32	65,168,980.90
应收买入返售证券利息	603,891.85	7,635,411.08
应收申购款利息	-	-
其他	-	-
合计	44,829,060.51	91,347,078.74

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	70,483.16	155,474.67
合计	70,483.16	155,474.67

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
其他	9,000.00	13,500.00
应付银行划款手续费	-	-
应付转出费	-	-
预提信息披露费	150,000.00	90,000.00
预提审计费用	70,000.00	60,000.00
合计	229,000.00	163,500.00

#### 7.4.7.9 实收基金

光大保德信现金宝货币 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	95,822,864.11	95,822,864.11
本期申购	1,331,359,283.37	1,331,359,283.37

本期赎回（以“-”号填列）	-1,342,945,914.70	-1,342,945,914.70
本期末	84,236,232.78	84,236,232.78

光大保德信现金宝货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	21,757,932,061.59	21,757,932,061.59
本期申购	41,304,953,600.66	41,304,953,600.66
本期赎回（以“-”号填列）	-54,753,454,777.82	-54,753,454,777.82
本期末	8,309,430,884.43	8,309,430,884.43

注：申购含红利再投、转换入份额和 A 类基金份额与 B 类基金份额之间自动升降级而增加的基金份额，赎回含转换出份额及 A 类基金份额与 B 类基金份额之间自动升降级而减少的基金份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

光大保德信现金宝货币 A

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	2,133,641.78	-	2,133,641.78
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-2,133,641.78	-	-2,133,641.78
本期末	-	-	-

光大保德信现金宝货币 B

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	256,582,112.87	-	256,582,112.87
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	-256,582,112.87	-	-256,582,112.87
本期末	-	-	-

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	33,422.78	114,702.38
定期存款利息收入	145,212,754.50	84,164,832.87
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	0.00	6.00
其他	2,881.90	5,841.11
合计	145,249,059.18	84,285,382.36

#### 7.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

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12月31日	2015年1月1日至2015年12月31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	-10,560,540.60	3,793,469.40
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	-10,560,540.60	3,793,469.40

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	15,259,869,769.97	6,538,857,744.03
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	15,084,315,926.63	6,441,926,149.97
减：应收利息总额	186,114,383.94	93,138,124.66
买卖债券差价收入	-10,560,540.60	3,793,469.40

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具投资收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无股利收益。

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无公允价值变动损益。

#### 7.4.7.17 其他收入

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12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
基金赎回费收入	-	-
其他收入	-	27,560.99
合计	-	27,560.99

#### 7.4.7.18 交易费用

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12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	-	-
银行间市场交易费用	-	1,114.63
合计	-	1,114.63

#### 7.4.7.19 其他费用

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12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
审计费用	70,000.00	60,000.00
信息披露费	150,000.00	90,000.00
银行汇划费用	169,295.80	174,924.08
账户维护费	31,500.00	36,000.00
其他费用	4,008.00	22,415.47
合计	424,803.80	383,339.55

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除 7.4.6.1 营业税、增值税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

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

**7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

**7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

**7.4.10.1.1 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。

**7.4.10.1.2 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。

**7.4.10.1.3 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。

**7.4.10.1.4 债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
光大证券	-	-	1,000,000.00	100.00%

**7.4.10.1.5 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。

**7.4.10.2 关联方报酬**

**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	32,675,794.00	17,741,644.89

其中：支付销售机构的客户 维护费	77,078.86	164,540.35
---------------------	-----------	------------

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.33% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令（或双方约定的其他方式），基金托管人复核后于次月前 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、公休假等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.2.2 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12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	9,929,625.60	5,380,185.88

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令（或双方约定的其他方式），基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2016年1月1日至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	光大保德信现金宝	光大保德信现金宝货币 B	合计



	货币 A		
光大保德信基金管理 有限公司	114,555.27	973,072.53	1,087,627.80
光大证券	140.59	-	140.59
农业银行	9,525.69	-	9,525.69
合计	124,221.55	973,072.53	1,097,294.08
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		
	光大保德信现金宝 货币A	光大保德信现金宝货币B	合计
光大保德信基金管理 有限公司	107,735.92	518,602.49	626,338.41
光大证券	205.15	-	205.15
农业银行	24,537.10	216.91	24,754.01
合计	132,478.17	518,819.40	651,297.57

注：本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用 A 类基金份额的费率。B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起享受 B 类基金份额的费率。两类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

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服务费划付指令（或双方约定的其他方式），经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人划付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期
----

2016年1月1日至2016年12月31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
农业银行	-	20,080,181.64	-	-	-	-
上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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
-	-	-	-	-	-	-

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年12月31日		2015年1月1日至2015年12月31日	
	光大保德信现金宝 货币A	光大保德信现金宝 货币B	光大保德信现金宝 货币A	光大保德信现金宝 货币B
期初持有的基金份额	-	72,422,685.34	-	218,653,323.02
期间申购/买入总份额	933,586.64	229,209,490.77	-	224,920,720.02
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	301,632,176.11	-	371,151,357.70
期末持有的基金份额	933,586.64	0.00	-	72,422,685.34
期末持有的基金份额	1.11%	0.00%	-	0.33%

额占基金总份额比例				
-----------	--	--	--	--

注：“期间申购/买入总份额”中为申购、基金转换入、红利再投份额之和，本期红利再投份额为 1,700,376.43。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

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

光大保德信现金宝货币 A

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。

光大保德信现金宝货币 B

份额单位：份

关联方名称	光大保德信现金宝货币B本期末 2016年12月31日		光大保德信现金宝货币B上年度末 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	900,647,640.59	10.73%	500,167,261.28	2.29%
光大保德信资产管理有限公司	40,041,755.06	0.48%	0.00	0.00%

注：本报告期内，光大证券股份有限公司申购本基金 1,950,000,000.00 元，申购费 0 元，赎回本基金 1,551,811,211.71 元，赎回费 0 元；光大保德信资产管理有限公司申购本基金 40,000,000.00 元，申购费 0 元；按照招募说明书公示费率收费。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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
农业银行	230,638.02	33,422.78	49,691,263.63	120,543.49

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本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。

### 7.4.11 利润分配情况

#### 1、光大保德信现金宝货币 A

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分 配合计	备注
2,133,641.78	-	-	2,133,641.78	-

#### 2、光大保德信现金宝货币 B

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
256,582,112.87	-	-	256,582,112. 87	-

### 7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 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金融资产款余额。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，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。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，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；本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。

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。

#### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 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。

###### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016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	1,175,230,638.02	1,972,000,000.00	-	-	-	-	3,147,230,638.02
交易性金融资产	309,969,928.91	1,487,171,284.53	1,635,978,070.86	-	-	-	3,433,119,284.30
买入返售金融资产	1,441,613,522.42	329,917,934.88	-	-	-	-	1,771,531,457.30
应收利息	-	-	-	-	-	44,829,060.	44,829,060.

						51	51
应收申购款	-	-	-	-	-	300.00	300.00
资产总计	2,926,814.0 89.35	3,789,089.2 19.41	1,635,978.0 70.86	0.00	0.00	44,829,360. 51	8,396,710.7 40.13
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,021,936.6 3	2,021,936.6 3
应付托管费	-	-	-	-	-	640,577.89	640,577.89
应付销售服务费	-	-	-	-	-	81,625.24	81,625.24
应付交易费用	-	-	-	-	-	70,483.16	70,483.16
其他负债	-	-	-	-	-	229,000.00	229,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	3,043,622.9 2	3,043,622.9 2
利率敏感度缺口	2,926,814.0 89.35	3,789,089.2 19.41	1,635,978.0 70.86	0.00	0.00	41,785,737. 59	8,393,667.1 17.21
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	8,225,691.2 63.63	1,737,000.0 00.00	350,000.00 0.00	-	-	-	10,312,691, 263.63
交易性金融资产	359,987.13 6.46	895,528.92 6.23	3,621,912.8 57.99	-	-	-	4,877,428.9 20.68
买入返售金融资产	6,575,973.2 23.94	-	-	-	-	-	6,575,973.2 23.94
应收利息	-	-	-	-	-	91,347,078. 74	91,347,078. 74
应收申购款	-	-	-	-	-	77,412.02	77,412.02
资产总计	15,161,651, 624.03	2,632,528.9 26.23	3,971,912.8 57.99	-	-	91,424,490. 76	21,857,517, 899.01
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,567,999.7 1	2,567,999.7 1

应付托管费	-	-	-	-	-	778,181.73	778,181.73
应付销售服务费	-	-	-	-	-	97,817.20	97,817.20
应付交易费用	-	-	-	-	-	155,474.67	155,474.67
其他负债	-	-	-	-	-	163,500.00	163,500.00
负债总计	-	-	-	-	-	3,762,973.3 1	3,762,973.3 1
利率敏感度缺口	15,161,651, 624.03	2,632,528,9 26.23	3,971,912,8 57.99	-	-	87,661,517. 45	21,853,754, 925.70

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，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 7.4.13.4.1.2 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：人民币元）	
		本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	利率上升 0.25%	减少约 2,459,263.91	减少约 6,186,637.20
	利率下降 0.25%	增加约 2,459,263.91	增加约 6,186,637.20

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。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

##### 7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具



不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

#### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 0.00 元，属于第二层次的余额为人民币 3,433,119,284.30 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元（于 2015 年 12 月 31 日，第一层次的余额为人民币 0.00 元，属于第二层次的余额为人民币 4,877,428,920.68 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元）。

##### 7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### 7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

#### 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

#### 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 3 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	3,433,119,284.30	40.89
	其中：债券	3,433,119,284.30	40.89
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,771,531,457.30	21.10
	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	3,147,230,638.02	37.48
4	其他各项资产	44,829,360.51	0.53
5	合计	8,396,710,740.13	100.00

### 8.2 债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	5.78	
	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

在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%。

### 8.3 基金投资组合平均剩余期限

### 8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	67
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	107
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	46

### 8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	34.27	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	24.01	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	21.72	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	4.14	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	15.35	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.50	-

注：资产负债表日后有部分定期存款提前支取。

### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内无投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-

3	金融债券	900,099,887.18	10.72
	其中：政策性金融债	900,099,887.18	10.72
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,329,083,993.85	15.83
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,203,935,403.27	14.34
8	其他	-	-
9	合计	3,433,119,284.30	40.90
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

### 8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排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	160209	16 国开 09	6,000,000	599,907,279.76	7.15
2	111609501	16 浦发 CD501	5,000,000	488,693,411.96	5.82
3	160211	16 国开 11	3,000,000	300,192,607.42	3.58
4	111696069	16 威海商行 CD022	3,000,000	298,874,600.29	3.56
5	111695504	16 晋城银行 CD014	2,000,000	197,811,330.75	2.36
6	011698047	16 苏交通 SCP008	1,000,000	99,998,698.08	1.19
7	011699982	16 鲁高速集 SCP005	1,000,000	99,983,517.10	1.19
8	041654057	16 船重 CP001	1,000,000	99,690,072.37	1.19
9	111611381	16 平安 CD381	1,000,000	99,404,518.79	1.18
10	111681855	13 江阴农村商业银行 CD018	1,000,000	99,219,797.61	1.18

### 8.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.2156%
报告期内偏离度的最低值	-0.1810%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1236%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

## 8.8 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投资资产支持证券。

## 8.9 投资组合报告附注

### 8.9.1 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。

**8.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期末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。**

### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	44,829,060.51
4	应收申购款	300.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	44,829,360.51

§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
光大保德信现金宝货币 A	4,051	20,793.94	52,541,412.28	62.37%	31,694,820.50	37.63%
光大保德信现金宝货币 B	36	230,817,524.57	8,309,430,884.43	100.00%	0.00	0.00%
合计	4,087	2,053,747.77	8,361,972,296.71	99.62%	31,694,820.50	0.38%

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	光大保德信现金宝货币 A	29,145.36	0.03%
	光大保德信现金宝货币 B	-	-
	合计	29,145.36	0.00%

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	光大保德信现金宝货币 A	0
	光大保德信现金宝货币 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	光大保德信现金宝货币 A	0~10

	光大保德信现金宝货币 B	0
	合计	0~10

### §10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	光大保德信现金宝货币 A	光大保德信现金宝货币 B
基金合同生效日（2013 年 9 月 5 日）基金份额总额	1,090,019,602.28	882,467,054.67
本报告期期初基金份额总额	95,822,864.11	21,757,932,061.59
本报告期基金总申购份额	1,331,359,283.37	41,304,953,600.66
减：本报告期基金总赎回份额	1,342,945,914.70	54,753,454,777.82
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	84,236,232.78	8,309,430,884.43

### §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

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，由林昌先生代任公司总经理。包爱丽女士自 2016 年 7 月 19 日起担任公司总经理，自包爱丽女士任总经理职务之日起，本基金管理人董事长林昌先生不再代行总经理职务。

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为人民币 7 万元,目前该审计机构已提供审计服务的连续年限为 4 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

本报告期基金管理人及其高级管理人员没有受监管部门稽查或处罚的情形；本报告期基金托管人的基金托管业务及其高管人员没有受监管部门稽查或处罚的情形。

### 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	-	-	-	-	-

注：1 本报告期末新增租用上海交易单元。

#### 2 专用交易单元的选择标准和程序

##### (1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

基金管理人选择证券经营机构，并选用其交易单元供本基金买卖证券专用，应本着安全、高效、低成本，能够为本基金提供高质量增值研究服务的原则，对该证券经营机构的经营情况、治理情况、研究实力等进行综合考量。

基本选择标准如下：

- 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- 经营行为规范，近两年未发生重大违规行为而受到证监会处罚；
- 内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求，并能为本基金提供全面的信息服务；
- 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务；
- 对于某一领域的研究实力超群，或是能够提供全方面，高质量的服务。

##### (2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

- 投资研究团队按照（1）中列出的有关经营情况、治理情况的选择标准，对备选的证券经营



机构进行初步筛选；

对通过初选的各证券经营机构，投资研究团队各成员在其分管行业或领域的范围内，对该机构所提供的研究报告和信息资讯进行评分。

根据各成员评分，得出各证券经营机构的综合评分。

投资研究团队根据各机构的得分排名，拟定要选用其专用交易单元的证券经营机构，并报本管理人董事会批准。

经董事会批准后，由本管理人交易部门、运营部门配合完成专用交易单元的具体租用事宜。

### 11.7.2 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	-	-	-	-	-	-

### 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

报告期内偏离度绝对值没有超过 0.5%(含)以上。

### 11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	光大保德信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	光大保德信现金宝货币市场基金 2015 年第 4 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-01-20
5	光大保德信现金宝货币市场基金“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
6	光大保德信现金宝货币市场基金 2015 年年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-03-28
7	光大保德信现金宝货币市场基金 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

8	光大保德信现金宝货币市场基金“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
9	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金产品新增上海利得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》	2016-04-06
10	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
11	光大保德信现金宝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》	2016-04-18
12	光大保德信现金宝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》	2016-04-18
13	光大保德信现金宝货币市场基金 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	光大保德信现金宝货币市场基金“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	有关旗下部分基金参加诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司费用优惠活动及申购金额下限调整的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-05-07
17	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
18	光大保德信现金宝货币市场基金“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
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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-06-14
20	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的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-06-24
21	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
22	光大保德信基金管理有限公司旗下基金 2016 年 6 月 30 日资产净值公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-07-01
23	光大保德信现金宝货币市场基金 2016 年第 2 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-07-20
24	关于旗下部分基金产品新增上海万得投资顾	《中国证券报》、《上海证	2016-08-04

	问有限公司为代销机构并参与其交易费率优惠活动的公告	券报》、《证券时报》	
25	关于旗下部分基金产品新增南京苏宁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》	2016-08-04
26	关于旗下部分基金产品新增北京肯特瑞财富投资管理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》	2016-08-05
27	光大保德信现金宝货币市场基金 2016 年半年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-08-27
28	光大保德信现金宝货币市场基金 2016 年半年度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-08-27
29	光大保德信现金宝货币市场基金“中秋节”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》	2016-09-13
30	光大保德信现金宝货币市场基金“国庆节”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》	2016-09-28
31	光大保德信基金管理有限公司关于旗下代销机构名称变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-10-13
32	光大保德信现金宝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》	2016-10-19
33	光大保德信现金宝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》	2016-10-19
34	光大保德信现金宝货币市场基金 2016 年第 3 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-10-24
35	关于旗下部分基金新增上海基煜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》	2016-10-24
36	光大保德信基金管理有限公司关于光大保德信现金宝货币市场基金修订基金合同部分条款的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-11-19
37	光大保德信基金管理有限公司关于旗下代销机构名称变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-11-25
38	关于旗下开放式基金新增东北证券股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资及基金转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-11-30
39	关于旗下开放式基金新增东兴证券股份有限公司为代销机构并开通基金转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-11-30
40	光大保德信现金宝货币市场基金“元旦”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》	2016-12-28

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

无

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准光大保德信现金宝货币市场基金设立的文件
- 2、光大保德信现金宝货币市场基金基金合同
- 3、光大保德信现金宝货币市场基金招募说明书
- 4、光大保德信现金宝货币市场基金托管协议
- 5、光大保德信现金宝货币市场基金法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件、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现金宝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

### 13.2 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。

### 13.3 查阅方式

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

二〇一七年三月二十八日