

光大保德信现金宝货币市场基金
2018 年半年度报告
2018 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年八月二十五日

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 24 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 2018 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	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.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	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.....	13
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）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 债券回购融资情况.....	38
7.3 基金投资组合平均剩余期限	38
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.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	39
7.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	40
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.....	40
7.9 投资组合报告附注.....	40
8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
8.4 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.....	42

9 开放式基金份额变动	42
10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
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.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....	43
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	43
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.9 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	45
10.10 其他重大事件.....	45
11 影响投资者决策的其他重要信息	46
12 备查文件目录	47
12.1 备查文件目录.....	47
12.2 存放地点.....	47
12.3 查阅方式.....	47

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	
交易代码	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	15,238,399,128.26 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	102,038,422.77 份	15,136,360,705.49 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	贺倩
	联系电话	(021) 80262888	010-66060069
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008-202-888	95599
传真		(021) 80262468	010-68121816

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	200010	100031
法定代表人	林昌	周慕冰

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、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
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（2018年1月1日-2018年6月30日）	
	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	1,700,936.17	347,935,992.23
本期利润	1,700,936.17	347,935,992.23
本期净值收益率	1.9089%	2.0304%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
	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	102,038,422.77	15,136,360,705.49
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(2018年6月30日)	
	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	18.2647%	19.6388%

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	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	0.3228%	0.0025%	0.0292%	0.0000%	0.2936%	0.0025%
过去三个月	0.9182%	0.0024%	0.0885%	0.0000%	0.8297%	0.0024%
过去六个月	1.9089%	0.0021%	0.1760%	0.0000%	1.7329%	0.0021%
过去一年	3.8269%	0.0016%	0.3549%	0.0000%	3.4720%	0.0016%
过去三年	9.7000%	0.0023%	1.0656%	0.0000%	8.6344%	0.0023%
自基金合同生效起至今	18.2647%	0.0029%	1.7111%	0.0000%	16.5536%	0.0029%

2. 光大保德信现金宝货币 B:

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	0.3424%	0.0025%	0.0292%	0.0000%	0.3132%	0.0025%
过去三个月	0.9786%	0.0024%	0.0885%	0.0000%	0.8901%	0.0024%
过去六个月	2.0304%	0.0021%	0.1760%	0.0000%	1.8544%	0.0021%
过去一年	4.0786%	0.0016%	0.3549%	0.0000%	3.7237%	0.0016%
过去三年	10.4955%	0.0023%	1.0656%	0.0000%	9.4299%	0.0023%
自基金合同生效起至今	19.6388%	0.0029%	1.7111%	0.0000%	17.9277%	0.0029%

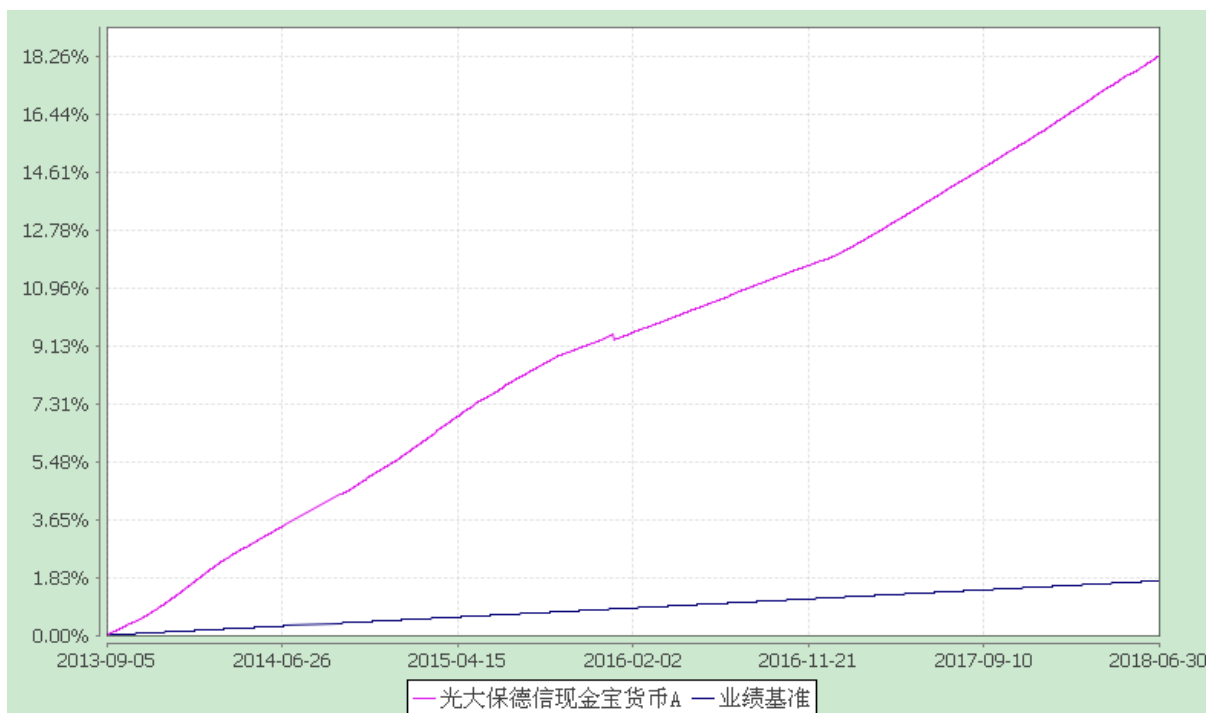
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

光大保德信现金宝货币市场基金

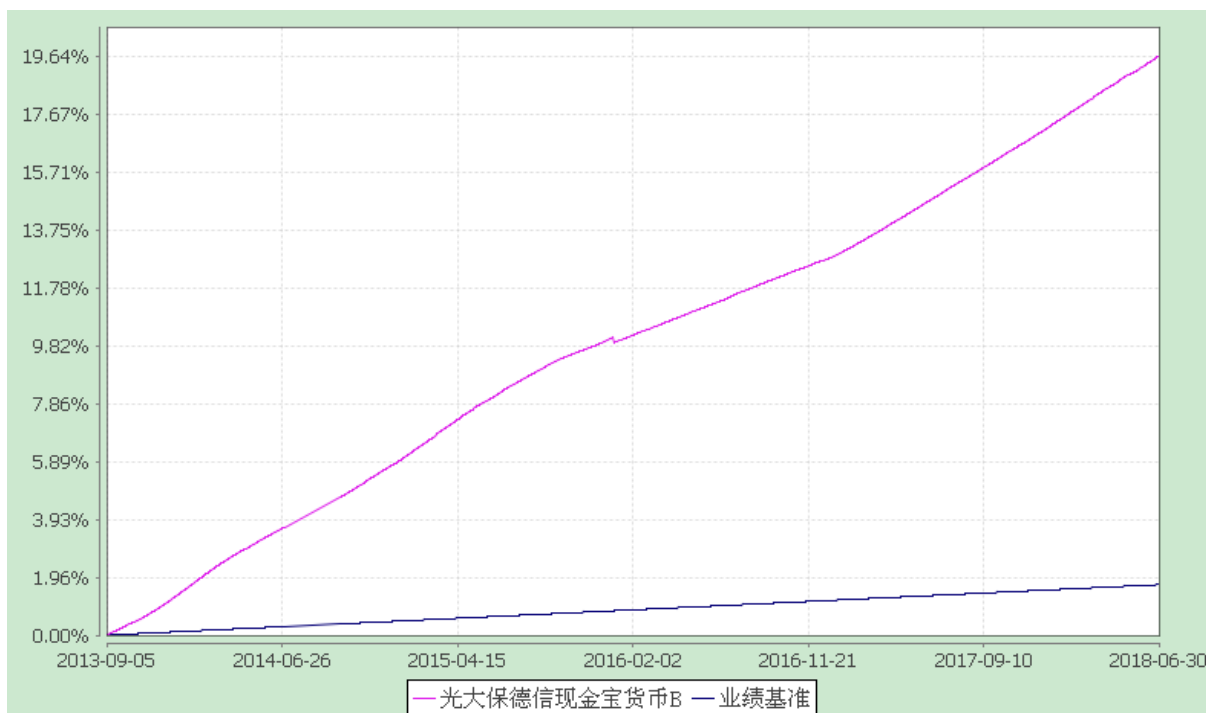
自基金合同生效以来累计份额净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013 年 9 月 5 日至 2018 年 6 月 30 日)

光大保德信现金宝货币 A



光大保德信现金宝货币 B



注：按照基金合同规定，本基金建仓期自基金合同生效日起六个月内。本基金合同生效日为 2013 年 9 月 5 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 2018 年 6 月 30 日，光大保德信旗下管理着 44 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、光大保德信尊尚一年定期开放债券型证券投资基金（已清盘）、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、光大保德信安祺债券型证券投资基金、光大保德信安和债券型证券投资基金、光大保德信事件驱动灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信永利纯债债券型证券投资基金、光大保德信安诚债券型证券投资基金、光大保德信多策略智选 18 个月定期开放混合型证券投资基金、光大保德信尊盈半年定期开放债券型发起式证券投资基金、光大保德信中高等级债券型证券投资基金、光大保德信先进服务业灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信尊富 18 个月定期开放债券型证券投资基金、光大保德信多策略优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信创业板量化优选股票型证券投资基金、光大保德信多策略精选 18 个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信超短债债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

		任职日期	离任日期		
魏丽	基金经理	2018-03-01	-	7 年	魏丽女士，硕士，2007 年获得南京财经大学应用数学系学士学位，2010 年获得复旦大学统计学硕士学位。2010 年 9 月至 2013 年 7 月在融通基金管理有限公司任职交易员、研究员；2013 年 7 月至 2017 年 10 月在农银汇理基金管理有限公司任职研究员、基金经理助理、基金经理，2015 年 12 月至 2017 年 10 月担任农银汇理天天利货币市场基金的基金经理；2017 年 10 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、光大保德信耀钱包货币市场基金基金经理、光大保德信恒利纯债债券型证券投资基金基金经理、光大保德信欣鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
蔡乐	基金经理	2014-09-11	2018-03-24	14 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，历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、光大保德信安祺债券型证券投资基金基金经理、光大保德信多策略智选 18 个月定期开放混合型证券投资基金基金经理、光大保德信尊盈半年定期开放债券型

					发起式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。

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

报告期内，光大现金宝稳健操作，在保持基金流动性的同时也严控信用风险。操作上抓住资金紧张时点和跨季资产价格高点集中配置，拉长了剩余期限。品种上进一步增加存单和存款比例，降低了基金收益的波动率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内光大保德信现金宝货币 A 份额净值增长率为 1.9089%，业绩比较基准收益率为 0.1760%；光大保德信现金宝货币 B 份额净值增长率为 2.0304%，业绩比较基准收益率为 0.1760%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 上半年的高频数据在春节后的复工影响下有小幅反弹，但这并不改变基本面整体向下的趋

势。下半年随着库存周期的结束，全球经济的下行，企业盈利、出口都将受到影响，进而影响到投资。下半年基本面压力有可能超出预期。同时也可以看到财政政策出台进行托底。

上半年降准两次，货币政策边际有所放松。4月17日，中国人民银行决定，从2018年4月25日起，下调主要商业银行人民币存款准备金率1个百分点；同日，上述银行将各自按照“先借先还”的顺序，使用降准释放的资金偿还其所借央行的中期借贷便利（MLF）。6月24日，中国人民银行决定，从2018年7月5日起，下调国有大型商业银行、股份制商业银行、邮政储蓄银行、城市商业银行、非县域农村商业银行、外资银行人民币存款准备金率0.5个百分点，支持市场化法制化“债转股”和小微企业融资。随着外汇贬值，国内货币政策操作空间也被打开，预计资金面在下半年将比上半年宽松许多。

展望后市，债券市场在基本面与资金面的共振下将有良好的表现，预计收益率在当前水平上还有进一步的下行空间。

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（包括权益、固定收益业务板块）、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特别估值方案，同时审慎平衡托管行、审计师意见和基金同业的惯常做法，与托管行沟通后形成建议，经公司管理层批准后由运营部具体执行。估值委员会提交建议一般需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。

委员会对各相关部门和代表人员的分工如下：投资研究部和运营部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调

整的投资品种；运营部根据估值的专业知识对需要进行估值政策调整的品种提出初步意见提交估值委员会讨论，负责执行基金估值政策进行日常估值业务，负责与托管行、审计师、基金同业、监管机关沟通估值调整事项；监察稽核部就估值程序的合法合规发表意见；投资研究部负责估值政策调整对投资业绩影响的评估；金融工程负责估值政策调整对投资绩效的评估；IT 部就估值政策调整的技术实现进行评估。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据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。

5.2 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本基金的投资运作、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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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本基金半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，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

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：光大保德信现金宝货币市场基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	5,225,766,624.55	6,760,768,967.81
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	8,280,439,174.00	8,637,132,911.28
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		8,280,439,174.00	8,637,132,911.28
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	3,192,515,228.83	408,585,251.38
应收证券清算款		358,185,706.84	-
应收利息	6.4.7.5	94,788,916.40	132,023,700.49
应收股利		-	-
应收申购款		1,885,025.75	2,050.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		17,153,580,676.37	15,938,512,880.96
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,907,782,898.48	640,292,719.56
应付证券清算款		-	1,000,000.00
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		4,688,884.52	4,547,680.79

应付托管费		1,420,874.08	1,378,085.08
应付销售服务费		161,615.03	156,979.50
应付交易费用	6.4.7.7	295,170.84	82,601.01
应交税费		143,344.04	-
应付利息		555,786.98	429,484.78
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	132,974.14	119,000.00
负债合计		1,915,181,548.11	648,006,550.72
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	15,238,399,128.26	15,290,506,330.24
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		15,238,399,128.26	15,290,506,330.24
负债和所有者权益总计		17,153,580,676.37	15,938,512,880.96

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 15,238,399,128.26 份（A 类 102,038,422.77 份；B 类 15,136,360,705.49 份）

6.2 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		401,831,425.48	284,859,669.42
1.利息收入		394,472,368.14	287,782,389.52
其中：存款利息收入	6.4.7.11	179,848,620.53	153,460,469.90
债券利息收入		173,322,534.74	69,430,594.63
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		41,301,212.87	64,891,324.99
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,289,080.25	-3,021,977.14
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	7,289,080.25	-3,021,977.14
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	69,977.09	99,257.04
减：二、费用		52,194,497.08	32,709,562.08
1. 管理人报酬	6.4.10.2	28,667,272.15	21,669,624.36
2. 托管费	6.4.10.2	8,687,052.13	6,566,552.90
3. 销售服务费	6.4.10.2	975,988.90	753,826.20
4. 交易费用	6.4.7.19	-	-
5. 利息支出		13,516,658.11	3,489,180.68
其中：卖出回购金融资产支出		13,516,658.11	3,489,180.68
6.税金及附加		95,001.97	-
7. 其他费用	6.4.7.20	252,523.82	230,377.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		349,636,928.40	252,150,107.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		349,636,928.40	252,150,107.34

6.3 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	15,290,506,330.24	-	15,290,506,330.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	349,636,928.40	349,636,928.40
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）	-52,107,201.98	-	-52,107,201.98
其中：1.基金申购款	42,544,263,047.96	-	42,544,263,047.96
2.基金赎回款	-42,596,370,249.94	-	-42,596,370,249.94
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）	-	-349,636,928.40	-349,636,928.40
五、期末所有者权益（基金净值）	15,238,399,128.26	-	15,238,399,128.26
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	8,393,667,117.21	-	8,393,667,117.21
二、本期经营活动产生的基	-	252,150,107.34	252,150,107.34

金净值变动数（本期利润）			
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）	9,012,782,672.96	-	9,012,782,672.96
其中：1.基金申购款	41,633,414,225.60	-	41,633,414,225.60
2.基金赎回款	-32,620,631,552.64	-	-32,620,631,552.64
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）	-	-252,150,107.34	-252,150,107.34
五、期末所有者权益（基金净值）	17,406,449,790.17	-	17,406,449,790.17

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：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

6.4 报表附注

6.4.1 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管理人于 2013 年 8 月 21 日到 2013 年 9 月 3 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2013）验字第 60467078_B03 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2013 年 9 月 5 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 1,972,148,407.45 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 249,743.44 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,972,398,150.89 元，折合 1,972,398,150.89 份基金份额，其中 A 类 1,089,970,692.78 份，B 类 882,427,458.11 份。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。

本基金的投资范围主要包括现金、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（以下简称“央行票据”）、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）中期票据、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：人民币活期存款利率(税后)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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（以下统称“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并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间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

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）

交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

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

6.4.6.2 增值税

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，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对本基金在 2018 年 1 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，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和個人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。本基金的具体缴纳标准如下：

城市维护建设税 – 按实际缴纳的流转税的 7% 计缴。

教育费附加 – 按实际缴纳的流转税的 3% 计缴。

地方教育附加 – 按实际缴纳的流转税的 2% 计缴。

6.4.6.4 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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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

6.4.6.5 个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别

化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

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

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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	115,766,624.55
定期存款	5,110,000,000.00
存款期限 1-3 个月	1,000,000,000.00
存款期限 3 个月以上	4,110,000,000.00
其他存款	-
合计	5,225,766,624.55

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2018 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	8,280,439,174.00	8,293,198,908.11	12,759,734.11	0.0837
	合计	8,280,439,174.00	8,293,198,908.11	12,759,734.11	0.0837
资产支持证券		-	-	-	-
合计		8,280,439,174.00	8,293,198,908.11	12,759,734.11	0.0837

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。

6.4.7.3 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。

6.4.7.4 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 2018 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	3,192,515,228.83	-
合计	3,192,515,228.83	-

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持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 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	7,345.11
应收定期存款利息	17,076,611.10
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	75,844,773.86
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	1,860,186.33
应收申购款利息	-
其他	-
合计	94,788,916.40

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 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	295,170.84

合计	295,170.84
----	------------

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
其他	9,000.00
应付银行划款手续费	-
应付转出费	-
预提审计费	49,588.57
预提信息披露费	74,385.57
合计	132,974.14

6.4.7.9 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 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	109,848,820.73	109,848,820.73
本期申购	513,129,696.02	513,129,696.02
本期赎回（以“-”号填列）	-520,940,093.98	-520,940,093.98
本期末	102,038,422.77	102,038,422.77

光大保德信现金宝货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	15,180,657,509.51	15,180,657,509.51
本期申购	42,031,133,351.94	42,031,133,351.94
本期赎回（以“-”号填列）	-42,075,430,155.96	-42,075,430,155.96
本期末	15,136,360,705.49	15,136,360,705.49

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。

6.4.7.10 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
上年度末	0.00	0.00	-
本期利润	1,700,936.17	-	1,700,936.17
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	-1,700,936.17	-	-1,700,936.17
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
上年度末	0.00	0.00	-
本期利润	347,935,992.23	-	347,935,992.23
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	-347,935,992.23	-	-347,935,992.23
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	153,161.53
定期存款利息收入	179,648,170.29
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	47,288.71
其他	0.00
合计	179,848,620.53

6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

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 2018年1月1日至2018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	7,289,080.25
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	7,289,080.25

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
	2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	42,732,132,690.46
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	42,705,509,172.88
减：应收利息总额	19,334,437.33
买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	7,289,080.25

6.4.7.14 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。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具投资收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

本基金本报告期内无公允价值变动损益。

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	-
其他收入	69,977.09
合计	69,977.09

6.4.7.19 交易费用

本基金本报告期无交易费用。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	74,385.57
银行汇划费用	109,949.68
账户维护费	18,000.00
其他费用	600.00
合计	252,523.82

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	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

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

本基金本报告期末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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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	5,517,400,000.00	100.00%	-	-

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期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 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	28,667,272.15	21,669,624.36
其中：支付销售机构的客户维护费	311,172.54	60,319.22

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
----	----------------------------	---------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	8,687,052.13	6,566,552.90
----------------	--------------	--------------

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。

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 2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	光大保德信现金宝货币 A	光大保德信现金宝货币 B	合计
光大保德信	144,957.03	761,589.71	906,546.74
光大证券	219.29	65.78	285.07
农业银行	7,911.49	311.90	8,223.39
合计	153,087.81	761,967.39	915,055.20
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	光大保德信现金宝货币 A	光大保德信现金宝货币 B	合计
光大保德信	54,953.26	654,530.50	709,483.76
光大证券	230.54	-	230.54
农业银行	5,585.37	-	5,585.37
合计	60,769.17	654,530.50	715,299.67

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。

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

本基金本期末与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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
基金合同生效日 (2013年9月5日) 持有的基金份额	-	-	-	-
期初持有的基金份额	966,426.18	-	933,586.64	0.00
期间申购/买入总份 额	18,532.92	-	16,604.15	-
期间因拆分变动份 额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出 总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份 额	984,959.10	-	950,190.79	-
期末持有的基金份 额占基金总份额比 例	0.97%	-	0.26%	-

注：1，“期间申购/买入总份额”中为申购、基金转换入、红利再投资份额之和，本期红利再投资份额为 18,532.92 份。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。（上年度可比期间红利再投资份额为 16,604.15 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

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 2018年6月30日		光大保德信现金宝货币B上年度末 2017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	0.00	0.00%	1,200,000,000.00	7.85%
光大保德信资产管理 有限公司	94,932,898.11	0.62%	62,291,675.40	0.41%

注：本报告期内，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；光大保德信资产管理有限公司申购本基金 35,000,000.00 元，申购费 0 元；光大证券股份有限公司赎回本基金 1,700,000,000.00 份，赎回费 0 元；光大保德信资产管理有限公司赎回本基金 4,000,000.00 元，赎回费 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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
农业银行	115,766,624.55	153,161.53	1,434,175.79	25,143.24

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末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

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
1,700,936.17	-	-	1,700,936.17	-

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	直接通过应付	应付利润	本期利润分	备注
----------	--------	------	-------	----

实收基金	赎回款转出金额	本年变动	配合计	
347,935,992.23	-	-	347,935,992.23	-

6.4.12 期末（2018 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 2018 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 1,907,782,898.48 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
170207	17 国开 07	2018-07-03	99.98	2,090,000.00	208,958,200.00
080214	08 国开 14	2018-07-05	100.10	270,000.00	27,027,000.00
120227	12 国开 27	2018-07-05	100.41	500,000.00	50,205,000.00
170207	17 国开 07	2018-07-02	99.98	1,100,000.00	109,978,000.00
170410	17 农发 10	2018-07-02	99.93	3,100,000.00	309,783,000.00
011800647	18 国新控股 SCP004	2018-07-02	100.14	1,545,000.00	154,716,300.00
130421	13 农发 21	2018-07-03	100.37	2,000,000.00	200,740,000.00
1080214	08 国开 14	2018-07-03	100.10	130,000.00	13,013,000.00
130421	13 农发 21	2018-07-02	100.37	2,000,000.00	200,740,000.00
170207	17 国开 07	2018-07-02	99.98	3,660,000.00	365,926,800.00
111714238	17 江苏银行 CD238	2018-07-06	99.32	2,105,000.00	209,068,600.00
170207	17 国开 07	2018-07-02	99.98	1,072,000.00	107,178,560.00
合计				19,572,000.00	1,957,334,460.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，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。

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、单个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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券),并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下,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,平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 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;当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天,平均剩余存续期不得超过 180 天;投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%;当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时,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 60 天,平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天;投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。本报告期末,本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例高于 30%,平均剩余期限未超过 60 天;平均剩余存续期未超过 120 天。

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的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%。本基金与由本基金

的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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 2018 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	115,766,624.55	4,710,000.00	400,000.00	-	-	-	5,225,766,624.55
交易性金融资产	1,608,682,711.27	5,420,982,411.20	1,250,774,051.53	-	-	-	8,280,439,174.00

买入返售金 融资产	3,192,515 ,228.83	-	-	-	-	-	3,192,515 ,228.83
应收证券清 算款	-	-	-	-	-	358,185,7 06.84	358,185,7 06.84
应收利息	-	-	-	-	-	94,788,91 6.40	94,788,91 6.40
应收申购款	-	-	-	-	-	1,885,025 .75	1,885,025 .75
资产总计	4,916,964 ,564.65	10,130,9 82,411.2 0	1,650,774 ,051.53	-	-	454,859,6 48.99	17,153,58 0,676.37
负债							
卖出回购金 融资产	1,907,782 ,898.48	-	-	-	-	-	1,907,782 ,898.48
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	4,688,884 .52	4,688,884 .52
应付托管费	-	-	-	-	-	1,420,874 .08	1,420,874 .08
应付交易费 用	-	-	-	-	-	295,170.8 4	295,170.8 4
应付税费	-	-	-	-	-	143,344.0 4	143,344.0 4
其他负债	-	-	-	-	-	132,974.1 4	132,974.1 4
应付利息	-	-	-	-	-	555,786.9 8	555,786.9 8
应付销售服 务费	-	-	-	-	-	161,615.0 3	161,615.0 3
负债总计	1,907,782 ,898.48	0.00	0.00	-	-	7,398,649 .63	1,915,181 ,548.11
利率敏感度 缺口	3,009,181 ,666.17	10,130,9 82,411.2 0	1,650,774 ,051.53	-	-	447,460,9 99.36	15,238,39 9,128.26
上年度末 2017 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	3,806,768 ,967.81	2,554,00 0,000.00	400,000,0 00.00	-	-	-	6,760,768 ,967.81
交易性金融 资产	4,452,303 ,751.20	2,279,58 5,948.67	1,905,243 ,211.41	-	-	-	8,637,132 ,911.28

买入返售金 融资产	408,585,251.38	-	-	-	-	-	408,585,251.38
应收利息	-	-	-	-	-	132,023,700.49	132,023,700.49
应收申购款	-	-	-	-	-	2,050.00	2,050.00
资产总计	8,667,657,970.39	4,833,585,948.67	2,305,243,211.41	0.00	0.00	132,025,750.49	15,938,512,880.96
负债							
卖出回购金 融资产款	640,292,719.56	-	-	-	-	-	640,292,719.56
应付证券清 算款	-	-	-	-	-	1,000,000.00	1,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	4,547,680.79	4,547,680.79
应付托管费	-	-	-	-	-	1,378,085.08	1,378,085.08
应付销售服 务费	-	-	-	-	-	156,979.50	156,979.50
应付交易费 用	-	-	-	-	-	82,601.01	82,601.01
应付税费	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应付利息	-	-	-	-	-	429,484.78	429,484.78
应付利润	-	-	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	-	-	119,000.00	119,000.00
负债总计	640,292,719.56	0.00	0.00	0.00	0.00	7,713,831.16	648,006,550.72
利率敏感度 缺口	8,027,365,250.83	4,833,585,948.67	2,305,243,211.41	0.00	0.00	124,311,919.33	15,290,506,330.24

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。

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：人民币元）	
		本期末	上年度末

		2018 年 6 月 30 日	2017 年 12 月 31 日
	利率上升 0.25%	减少约 3,701,896	减少约 3,930,357
	利率下降 0.25%	增加约 3,701,896	增加约 3,930,357

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

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。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7 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	8,280,439,174.00	48.27
	其中：债券	8,280,439,174.00	48.27
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,192,515,228.83	18.61
	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	5,225,766,624.55	30.46
4	其他各项资产	454,859,648.99	2.65
5	合计	17,153,580,676.37	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	5.67	
	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	1,907,782,898.48	12.52
	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%。

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	57
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	60
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	36

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

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	34.29	12.52
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	5.95	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的	-	-

	浮动利率债		
3	60 天（含）—90 天	61.19	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	8.12	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	2.39	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
	合计	111.93	12.52

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

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期无超过 240 天情况说明。

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	1,820,402,883.38	11.95
	其中：政策性金融债	1,820,402,883.38	11.95
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,199,204,526.81	7.87
6	中期票据	-	-
7	同业存单	5,260,831,763.81	34.52
8	其他	-	-
9	合计	8,280,439,174.00	54.34
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	170207	17 国开 07	8,700,000	869,829,996.04	5.71
2	111898916	18 徽商银行 CD087	8,000,000	792,537,794.58	5.20
3	111810263	18 兴业银行 CD263	5,000,000	495,988,750.05	3.25
4	111815262	18 民生银行 CD262	5,000,000	495,849,234.40	3.25
5	111818158	18 华夏银行 CD158	5,000,000	495,801,335.42	3.25
6	111898371	18 宁波银行 CD104	5,000,000	495,712,767.05	3.25
7	130421	13 农发 21	4,000,000	401,460,380.82	2.63
8	111892437	18 厦门国际银行 CD017	4,000,000	397,456,723.10	2.61
9	170410	17 农发 10	3,800,000	379,717,979.19	2.49
10	111898930	18 北京农商银行 CD046	3,000,000	297,363,453.21	1.95

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	0.1324%
报告期内偏离度的最低值	0.0363%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0635%

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%情况说明。

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%情况说明。

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 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。

7.9.3 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	358,185,706.84
3	应收利息	94,788,916.40
4	应收申购款	1,885,025.75
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	454,859,648.99

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
光大保德信现金宝货币 A	4,258	23,963.93	45,844,658.34	44.93%	56,193,764.43	55.07%

光大保德信现 金宝货币 B	47	322,050,227.78	15,114,887,283.64	99.86%	21,473,421.85	0.14%
合计	4,305	3,539,697.82	15,160,731,941.98	99.49%	77,667,186.28	0.51%

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	银行类机构	3,181,904,312.39	20.88%
2	其他机构	2,412,465,170.67	15.83%
3	银行类机构	1,527,291,434.40	10.02%
4	银行类机构	1,525,362,417.11	10.01%
5	基金类机构	1,408,512,629.23	9.24%
6	银行类机构	1,001,884,391.93	6.57%
7	保险类机构	549,442,089.61	3.61%
8	银行类机构	531,065,370.63	3.49%
9	其他机构	503,948,479.12	3.31%
10	保险类机构	338,582,835.34	2.22%

8.3 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	401,832.96	0.39%
	光大保德信现 金宝货币 B	-	-
	合计	401,832.96	0.00%

8.4 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	10~50
	光大保德信现金宝货币 B	0
	合计	10~50
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
	光大保德信现金宝货币 B	0
	合计	0

9 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	109,848,820.73	15,180,657,509.51
本报告期基金总申购份额	513,129,696.02	42,031,133,351.94
减：本报告期基金总赎回份额	520,940,093.98	42,075,430,155.96
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	102,038,422.77	15,136,360,705.49

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

本报告期内本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金报告期内未持有基金。

10.6 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。

10.7 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。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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：本报告期无新增或者退租交易单元。

10.8.2 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	-	-	5,517,400,000.00	100.00%	-	-

注：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。

10.9 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。

10.10 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 2017 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》	2018-01-02
2	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》	2018-01-04
3	光大保德信现金宝货币市场基金 2017 年第 4 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018-01-19
4	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金新增光大期货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》	2018-01-23
5	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金参与大泰金石基金销售有限公司交易费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018-01-31
6	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京展恒基金销售股份有限公司交易费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018-01-31
7	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》	2018-02-12
8	光大保德信现金宝货币市场基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018-03-01
9	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》	2018-03-02
10	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攀赢金融信息服务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》	2018-03-10
11	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》	2018-03-14
12	光大保德信现金宝货币市场基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018-03-15
13	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国金证券股份有限公司开通定	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018-03-15

	定期投资及转换业务的公告		
14	光大保德信现金宝货币市场基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018-03-24
15	光大保德信现金宝货币市场基金 2017 年年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018-03-27
16	光大保德信现金宝货币市场基金 2017 年年度报告（摘要）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018-03-27
17	光大保德信现金宝货币市场基金“清明节”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》	2018-03-31
18	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改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》	2018-03-31
19	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》	2018-04-18
20	光大保德信现金宝货币市场基金招募说明书摘要（更新）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018-04-18
21	光大保德信现金宝货币市场基金 2018 年第 1 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018-04-20
22	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工商银行股份有限公司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》	2018-04-20
23	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京汇成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》	2018-04-21
24	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》	2018-04-24
25	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》	2018-06-11
26	光大保德信基金管理有限公司关于调整旗下货币基金的 T+0 赎回限额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018-06-28

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
	1	20180329-201804	2,130,	1,051,	-	3,181,904,3	20.88%

机构		02, 20180626-201 80630	141, 00 1. 46	763, 31 0. 93		12. 39	
产品特有风险							
<p>本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过20%的情形，可能面临单一投资者集中赎回的情况，从而：</p> <p>(1) 对基金的流动性造成冲击，存在对剩余投资者的赎回办理造成影响的风险。</p> <p>(2) 基金管理人因基金赎回的流动性要求致使部分投资受到限制，或因赎回费归入基金资产等原因，而导致基金资产净值波动的风险，影响基金的投资运作和收益水平。</p> <p>(3) 因基金资产规模过小，而导致部分投资不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略，或导致基金不能满足存续条件的风险。</p> <p>本管理人将审慎评估大额申购对基金持有集中度的影响，在运作中保持合适的流动性水平，保护持有人利益。</p>							

11.2 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

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。

光大保德信基金管理有限公司

二〇一八年八月二十五日