光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金

2019 半年度 报告摘要

2019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：二〇一九年八月二十八日

1 重要提示

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2019年8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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1基金基本情况

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	30,919,586,237.32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	131,625,811.71份	30,787,960,425.61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7天通知存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金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	毛宗倩	田青
	联系电话	021-80262888	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

2.4 信息披露方式

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。

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（2019年1月1日-2019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	2,507,914.81	466,867,322.36
本期利润	2,507,914.81	466,867,322.36
本期净值收益率	1.4142%	1.5298%
3.1.2期末数据和指标	报告期末（2019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	131,625,811.71	30,787,960,425.61
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

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	0.2331%	0.0035%	0.1125%	0.0000%	0.1206%	0.0035%
过去三个月	0.6667%	0.0021%	0.3413%	0.0000%	0.3254%	0.0021%
过去六个月	1.4142%	0.0017%	0.6788%	0.0000%	0.7354%	0.0017%
过去一年	3.2247%	0.0018%	1.3687%	0.0000%	1.8560%	0.0018%
过去三年	11.5609%	0.0029%	4.1063%	0.0000%	7.4546%	0.0029%
自基金合同生效起至今	27.9383%	0.0033%	11.0493%	0.0014%	16.8890%	0.0019%

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	0.2515%	0.0035%	0.1125%	0.0000%	0.1390%	0.0035%
过去三个月	0.7233%	0.0021%	0.3413%	0.0000%	0.3820%	0.0021%
过去六个月	1.5298%	0.0017%	0.6788%	0.0000%	0.8510%	0.0017%
过去一年	3.4663%	0.0018%	1.3687%	0.0000%	2.0976%	0.0018%
过去三年	12.3556%	0.0029%	4.1063%	0.0000%	8.2493%	0.0029%
自基金合同生效起至今	27.3014%	0.0034%	9.7421%	0.0013%	17.5593%	0.0021%

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。

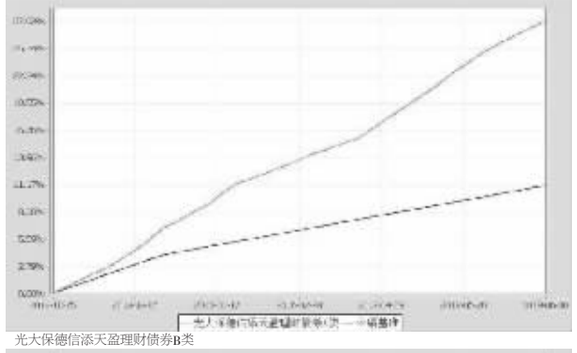
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金

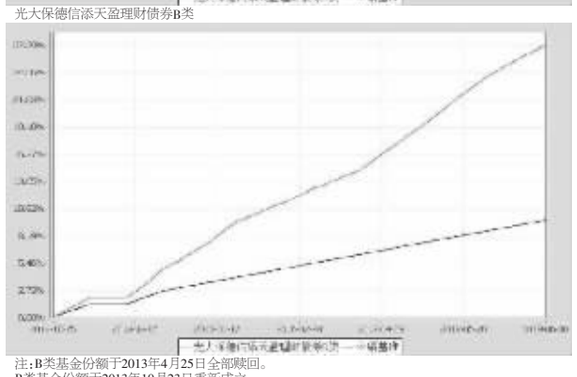
累计份额净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2012年10月25日至2019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2019年6月30日，光大保德信旗下管理着45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、光大保德信晟利债券型证券投资基金、光大保德信安泽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		
沈荣	基金经理	2018-01-16	-	7年	沈荣先生，2007年获得上海交通大学工学学士学位，2011年获得上海财经大学金融学硕士学位。2007年7月至2008年9月在上海电器科学研究所（集团）有限公司任职CAD开发工程师；2011年6月至2012年3月在国金证券股份有限公司任职行业研究员；2012年3月至2014年4月在宏源证券股份有限公司任职行业分析师、固定收益分析师；2014年4月至2017年6月在华安英泰保险股份有限公司任职债券助理研究经理、投资经理；2017年7月加入光大保德信基金管理有限公司，担任固定收益部基金经理。现任光大保德信货币市场基金、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、光大保德信尊盈半年定期开放债券型发起式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、光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、光大保德信中高等级债券型证券投资基金基金经理、光大保德信尊富18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、光大保德信超短债债券型证券投资基金基金经理、光大保德信晟利债券型证券投资基金基金经理、光大保德信安泽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遵规守信情况的说明

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

宏观方面，上半年经济增长先上后下，一季度宽信用见效，经济有所回升，二季度监管有所趋严，经济有所回落。一季度经济好于预期，主要是社融放量，经济加杠杆。之后政治局会议态度有所收敛，重提房住不炒。二季度的金融数据走弱，社融和信贷都略微低于预期，反映出信用派生的过程逐渐减弱。4.5月经济数据也有所下行，主要是工业增加值同比增速下行比较明显。房地产相关数据也有一定下行，首先是房地产销售趋于回落，同时融资政策有所收紧，房企资金来源边际弱化，但在施工的支撑下房地产投资还是保持了上行。另外，基建投资比较稳定，制造业投资继续下滑，总体投资水平略有走弱。消费也呈现出偏下行的特征。受到基数驱动，CPI二季度达到高位，但后期会有所回落。

债券市场方面，由于一季度信用扩张较为明显，政策预期有所收缩，利率债收益率有所反弹，信用债收益率则有所震荡。具体而言，短端1年国债上行4BP，1年国开下行3BP。受到宏观经济暂稳的影响，长端较为平稳，10Y国债和10Y国开分别下行1BP和3BP。信用债表现的略好于利率债，1Y的AAA信用债下行39BP。稍长久期的信用债表现稍弱，3Y的AAA信用债下行13BP。信用利差在较低水平上继续压缩，中等评级的表现更好一些，3Y的AA信用债下行31BP。我们认为，上半年的债券行情主要反映三点特征：一是经济改善政策开始预调微调。二是宏观环境尚未完全企稳，后续长债利率仍有机会。三是信用条件放松，信用利差继续压缩。

按照契约要求，添天盈基金主要投资于银行协议存款、存单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1.4142%，业绩比较基准收益率为0.6788%；光大保德信添天盈理财债券B份额净值增长率为1.5298%，业绩比较基准收益率为0.6788%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年宏观经济，目前从中微观数据来看，目前经济也呈现出略偏走弱的状态，发电耗煤增速不断下行，重卡、挖掘机等工程机械销售增速也有所回落，总体经济下行态势较为明显。从目前各个政策层面的表态来看，目前政策积极放松的概率偏低。房地产监管趋于严格，下半年地产可能成为宏观经济的拖累。出口的压力主要集中在三季度，四季度可能会有所缓和。总体而言，下半年经济可能呈现出下行企稳的特征。展望下半年债券市场，利率债方面，受益于国内外经济回落、海外利率下降的过程；信用债方面，目前信用利差已经回到低位，信用债获取超额收益空间有限；短端债券方面，前期资金面非常宽松，目前短端债券利率已经到达历史底部；可转债方面，估值仍然处于有价值的区域，考虑到三季度积极窗口逐渐打开，有一定的左侧布局价值。

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。

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；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2,507,914.81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466,867,322.36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：2019年6月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资产：	-	-
银行存款	6,500,755,543.73	980,644,103.22
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	28,754,546,054.94	35,674,354,209.87
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	28,754,546,054.94	35,674,354,209.87
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	648,201,492.30	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	47,650,350.84	8,062,317.98
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	35,951,153,441.81	36,663,060,631.07

负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018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	5,020,791,755.81	5,907,424,458.85
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	6,409,844.51	7,683,768.51
应付托管费	2,051,150.23	2,458,805.91
应付销售服务费	283,335.65	360,220.88
应付交易费用	227,722.88	250,387.67
应交税费	-	10,671.23
应付利息	1,662,227.86	7,002,328.32
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	141,167.55	209,000.00
负债合计	5,031,567,204.49	5,925,399,641.37
所有者权益：	-	-
实收基金	30,919,586,237.32	30,737,660,989.70
未分配利润	-	-
所有者权益合计	30,919,586,237.32	30,737,660,989.70
负债和所有者权益总计	35,951,153,441.81	36,663,060,631.07

注：报告截止日2019年6月30日，基金份额净值1.00元，基金份额总额30,919,586,237.32份；其中，A类基金份额总额为131,625,811.71份，B类基金份额的份额总额为30,787,960,425.61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：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	574,544,017.28	758,354,258.77
1.利息收入	560,800,906.90	751,222,276.07
其中：存款利息收入	64,544,585.44	374,407,323.91
债券利息收入	488,043,323.10	364,952,739.55
资产支持证券利息收入	266,333.20	-
买入返售金融资产收入	7,946,665.16	11,862,212.61
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	13,734,750.22	7,123,116.80
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	13,666,969.40	7,123,116.80
资产支持证券投资收益	67,780.82	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	8,360.16	8,865.90
减：二、费用	105,168,780.11	117,343,583.94
1.管理人报酬	38,370,034.61	34,552,820.42
2.托管费	12,278,411.01	11,056,902.52
3.销售服务费	1,745,832.91	1,696,501.63
4.交易费用	-	-
5.利息支出	52,595,166.71	69,901,043.01
其中：卖出回购金融资产支出	52,595,166.71	69,901,043.01
6.税金及附加	1,014.54	-
7.其他费用	178,320.33	136,316.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	469,375,237.17	641,010,674.83
减：所得税费用	-	-
四、净利润（亏损以“-”号填列）	469,375,237.17	641,010,674.83

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：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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）	30,737,660,989.70	-	30,737,660,989.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	469,375,237.17	469,375,237.17
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	181,925,247.62	-	181,925,247.62
其中：1.基金申购款	5,090,681,913.36	-	5,090,681,913.36
2.基金赎回款	-4,908,756,665.74	-	-4,908,756,665.74
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）	-	-469,375,237.17	-469,375,237.17
五、期末所有者权益（基金净值）	30,919,586,237.32	-	30,919,586,237.32

项目	上年度可比期间 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）	12,887,223,933.79	-	12,887,223,933.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	641,010,674.83	641,010,674.83
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）	26,167,885,564.88	-	26,167,885,564.88
其中：1.基金申购款	31,690,673,396.86	-	31,690,673,396.86
2.基金赎回款	-5,522,787,831.98	-	-5,522,787,831.98
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）	-	-641,010,674.83	-641,010,674.83
五、期末所有者权益（基金净值）	39,055,109,498.67	-	39,055,109,498.67

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

光大保德信添天盈月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〕第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人民币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，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2014年4月16号公布的《光大保德信添天盈季度理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告》，本基金变更为光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金并修改合同内容。

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%。前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日至2019年6月30日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会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3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。

6.4.6税项

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2016〕36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税〔2016〕46号《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》、财税〔2016〕70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税〔2016〕140号《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》、财税〔2017〕2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）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。资管产品管理人运营资管产品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。对资管产品在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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

（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，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

（4）本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7关联方关系

6.4.7.1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。

6.4.7.2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“光大保德信基金公司”）	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“中国建设银行”）	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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1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。

6.4.8.1.2权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3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。

6.4.8.1.4债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.8.1.5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。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	38,370,034.61	34,552,820.42
其中：支付销售机构的客户维护费	74,574.91	270,339.52

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。

6.4.8.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	12,278,411.01	11,056,902.52

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。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019年1月1日至2019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
中国建设银行	6,268.43	-	6,268.43
光大证券	201.40	-	201.40
光大保德信	15,313.60	1,534,220.52	1,549,534.12
合计	21,783.43	1,534,220.52	1,556,003.95

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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	14,530.