

光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金
(原光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金转型)

2020 年年度报告

2020 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年三月三十一日

§ 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 30 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。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

自 2020 年 3 月 9 日起原光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金转型为光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金。原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自 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 3 月 8 日止，光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金本报告期自 2020 年 3 月 9 日至 2020 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	9
2.4 信息披露方式	10
2.5 其他相关资料	10
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	10
3.1 光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金	10
3.1.1 主要会计数据和财务指标	10
3.1.2 基金净值表现	11
3.1.3 过去三年基金的利润分配情况	13
3.2 光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金	13
3.2.1 主要会计数据和财务指标	13
3.2.2 基金净值表现	14
3.2.3 过去三年基金的利润分配情况	18
§4 管理人报告	18
4.1 基金管理人及基金经理情况	18
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	22
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	22
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	23
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	24
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	24
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	25
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	26
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	26
§5 托管人报告	27
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	27
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	27
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	27
§6 审计报告	27
6.1 光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金	27
6.1.1 审计意见	27
6.1.2 形成审计意见的基础	28
6.1.3 管理层和治理层对财务报表的责任	28
6.1.4 注册会计师对财务报表审计的责任	28
6.2 光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金	29
6.2.1 审计意见	29
6.2.2 形成审计意见的基础	30
6.2.3 管理层和治理层对财务报表的责任	30
6.2.4 注册会计师对财务报表审计的责任	30
§7 年度财务报表	31

7.1 光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金	31
7.1.1 资产负债表	31
7.1.2 利润表	33
7.1.3 所有者权益（基金净值）变动表	34
7.1.4 报表附注	35
7.2 光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金	56
7.2.1 资产负债表	56
7.2.2 利润表	57
7.2.3 所有者权益（基金净值）变动表	58
7.2.4 报表附注	60
§8 投资组合报告	84
8.1 光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金	84
8.1.1 期末基金资产组合情况	84
8.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	85
8.1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	85
8.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动	85
8.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	85
8.1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	86
8.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	86
8.1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	86
8.1.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	86
8.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	86
8.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	86
8.1.12 投资组合报告附注	86
8.2 光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金	87
8.2.1 期末基金资产组合情况	87
8.2.2 债券回购融资情况	88
债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明	88
8.2.3 基金投资组合平均剩余期限	88
8.2.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	89
8.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	89
8.2.6 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	90
8.2.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	90
报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25% 情况说明	91
报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5% 情况说明	91
8.2.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细	91
8.2.9 投资组合报告附注	91
§9 基金份额持有人信息	93
9.1 光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金	93
9.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	93
9.1.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	93
9.1.3 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情况	93
9.2 光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金	93
9.2.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	93
9.2.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	94

9.2.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	94
9.2.4 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情况	94
§10 开放式基金份额变动	95
§11 重大事件揭示	96
11.1 基金份额持有人大会决议	96
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	96
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	96
11.4 基金投资策略的改变	96
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	97
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	97
11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	97
11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	97
11.9 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况	100
11.10 其他重大事件	100
§12 影响投资者决策的其他重要信息	102
12.1 光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金	102
12.1.1 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	102
12.2 光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金	102
12.2.1 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	102
§13 备查文件目录	103
13.1 备查文件目录	103
13.2 存放地点	103
13.3 查阅方式	104

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

2.1.1 光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金

基金名称	光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金
基金简称	光大保德信添天盈五年定期开放债券
基金主代码	360019
交易代码	360019
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2020年3月9日
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	7,032,936,078.59份
基金合同存续期	不定期

注：光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金于 2020 年 03 月 09 日变更注册为光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金。

2.1.2 光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金

基金名称	光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金	
基金简称	光大保德信添天盈理财债券	
基金主代码	360019	
交易代码	360019	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年10月25日	
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	7,032,936,078.59份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	光大保德信添天盈理财债券 A 类	光大保德信添天盈理财债券 B 类
下属分级基金的交易代码	360019	360020
报告期末下属分级基金的份 额总额	7,897,022.81 份	7,025,039,055.78 份

注：光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金于 2020 年 03 月 09 日变更注册为光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金。

2.2 基金产品说明

2.2.1 光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金

投资目标	本基金封闭期内采取买入持有到期投资策略，投资于剩余期限（或回售
------	---------------------------------

	<p>期限)不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具,力求基金资产的稳健增值。</p>
<p>投资策略</p>	<p>1、封闭期投资策略</p> <p>(1) 封闭期配置策略</p> <p>本基金以封闭期为周期进行投资运作。为力争基金资产在开放前可完全变现,本基金在封闭期内采用买入并持有到期投资策略,所投金融资产以收取合同现金流量为目的并持有到期,所投资产到期日(或回售日)不得晚于封闭期到期日。本基金投资含回售权的债券时,应在投资该债券前,确定行使回售权或持有至到期的时间;债券到期日晚于封闭期到期日的,基金管理人应当行使回售权而不得持有至到期日。</p> <p>基金管理人可以基于持有人利益优先原则,在不违反《企业会计准则》的前提下,对尚未到期的固定收益类品种进行处置。</p> <p>(2) 信用债投资策略</p> <p>信用类债券是本基金的重要投资对象,因此信用策略是本基金债券投资策略的重要部分。由于影响信用债券利差水平的因素包括市场整体的信用利差水平和信用债自身的信用情况变化,因此本基金的信用债投资策略可以具体分为市场整体信用利差曲线策略和单个信用债信用分析策略。</p> <p>(3) 资产支持证券投资策略</p> <p>资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上,对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析,采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略,投资于资产支持证券。</p> <p>(4) 证券公司短期公司债券投资策略</p> <p>本基金将通过证券行业分析、证券公司资产负债分析、公司现金流分析等调查研究,分析证券公司短期公司债券的违约风险及合理的利差水平,对证券公司短期公司债券进行独立、客观的价值评估。</p> <p>基金投资证券公司短期公司债券,基金管理人将根据审慎原则,制定严格的投资决策流程、风险控制制度,并经董事会批准,以防范信用风险、流动性风险等各种风险。</p> <p>(5) 杠杆投资策略</p> <p>本基金将在封闭期内进行杠杆投资,杠杆放大部分仍投资于剩余期限(或回售期限)不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具,并采取买入持有到期投资策略。同时采取滚动回购的方式来维持杠杆,因此负债的资金成本存在一定的波动性。</p> <p>(6) 封闭期现金管理策略</p> <p>在每个封闭期内完成组合的构建之前,本基金将根据届时的市场环境对组合的现金头寸进行管理,选择到期日(或回售日)在建仓期之内的债</p>

	<p>券、回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等进行投资，并采用买入持有到期投资策略。</p> <p>由于在建仓期本基金的投资难以做到与封闭期剩余期限完美匹配，因此可能存在持有的部分投资品种在封闭期结束前到期兑付本息的情形。另一方面，本基金持有的部分投资品种的付息也将增加基金的现金头寸。对于现金头寸，本基金将根据届时的市场环境和封闭期剩余期限，选择到期日（或回售日）在封闭期结束之前的债券、回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等进行投资或进行基金现金分红。</p> <p>2、开放期投资策略</p> <p>开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。</p> <p>今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。</p>
业绩比较基准	<p>在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日公布的三年期定期存款利率（税后）+2%。</p>
风险收益特征	<p>本基金为债券型基金，其长期预期收益和风险高于货币市场基金，但低于股票型基金和混合型基金。</p>

2.2.2 光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金

投资目标	<p>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。</p>
投资策略	<p>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。</p> <p>（1）整体资产配置策略</p> <p>本基金通过对 CPI 指标、GDP 增长率、货币供应量、国际利率水平、汇率等因素的分析，形成对实体经济基本面的宏观研判。同时，结合央行公开市场操作、货币市场与资本市场资金互动等变动情况，合理预期货币市场利率曲线动态变化，并据此决定整体资产配置策略。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%。</p> <p>（2）类属资产配置策略</p> <p>类属配置指组合在各类短期金融工具如央行票据、国债、金融债、企业短期融资券以及现金等投资品种之间的配置比例。本基金将通过分析各类属的相对收益、利差变化、流动性风险、信用风险等因素来确定类属配置比例，寻找具有投资价值的投资品种，力争取得较高的回报。</p>

	<p>(3) 银行存款投资策略</p> <p>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。本基金资产可以投资于上市商业银行、大型商业银行、国有商业银行、股份制商业银行、城市商业银行、邮政储蓄银行、农村商业银行、外资银行中具有证券投资基金托管人资格、证券投资基金代销业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的商业银行的协议存款。若本基金投资的协议存款中未约定可提前支取并无利息损失的，则该笔存款的到期日不得晚于该运作周期的第一个开放日。本基金在投资银行存款时将针对不同银行的银行存款收益率做深入的分析，同时结合各银行的信用等级、存款期限等因素的研究，综合考量整体利率市场环境及其变动趋势，在严格控制风险的前提下决定各银行存款的投资比例。</p> <p>(4) 个券选择策略</p> <p>在个券选择层面，将首先考虑安全性因素，优先选择央票、短期国债等高信用等级的债券品种以规避违约风险。在具体的券种选择上，基金管理人将在正确拟合收益率曲线的基础上，找出收益率出现明显偏高的券种，并客观分析收益率出现偏离的原因。若出现因市场原因所导致的收益率高于公允水平，则该券种价格出现低估，本基金将对此类低估品种进行重点关注。此外，鉴于收益率曲线可以判断出定价偏高或偏低的期限段，从而指导相对价值投资，这也可以帮助基金管理人选择投资于定价低估的短期债券品种。</p> <p>(5) 回购策略</p> <p>基金管理人将密切关注由于新股申购等原因导致短期资金需求激增的机会，通过逆回购的方式融出资金以分享短期资金利率陡升的投资机会。</p>
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	王许利	李申
	联系电话	(021) 80262888	021-60637102
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4008-202-888	021-60637111
传真		(021) 80262468	021-60635778
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	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海市黄浦区中山东二路558号外	北京市西城区闹市口大街1号院1

	滩金融中心1幢（北区3号楼），6-7层、10层	号楼
邮政编码	200010	100033
法定代表人	刘翔	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金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、中国建设银行股份有限公司的办公场所。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11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），6-7层、10层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金

3.1.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年3月9日（基金合同生效日）至2020年12月31日)
本期已实现收益	167,756,102.76
本期利润	167,756,102.76
加权平均基金份额本期利润	0.0239
本期加权平均净值利润率	2.36%
本期基金份额净值增长率	2.39%

3.1.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年12月31日)
期末可供分配利润	167,756,102.76
期末可供分配基金份额利润	0.0239
期末基金资产净值	7,200,692,181.35
期末基金份额净值	1.0239
3.1.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年12月31日)
基金份额累计净值增长率	2.39%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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。

3、自2020年3月9日起原光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金转型为光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金，光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.1.2 基金净值表现

3.1.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

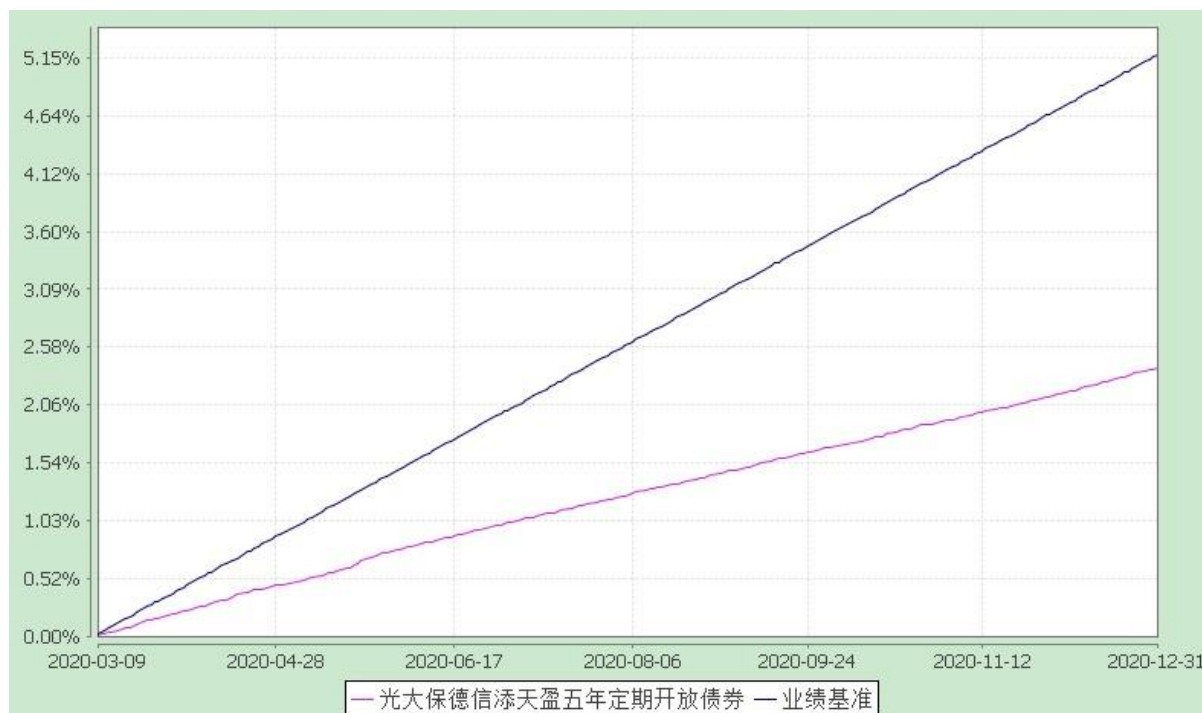
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.70%	0.01%	1.60%	0.02%	-0.90%	-0.01%
过去六个月	1.39%	0.01%	3.19%	0.02%	-1.80%	-0.01%
自基金转型起至今	2.39%	0.01%	5.17%	0.02%	-2.78%	-0.01%

3.1.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金

自基金转型以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年3月9日（基金合同生效日）至2020年12月31日)



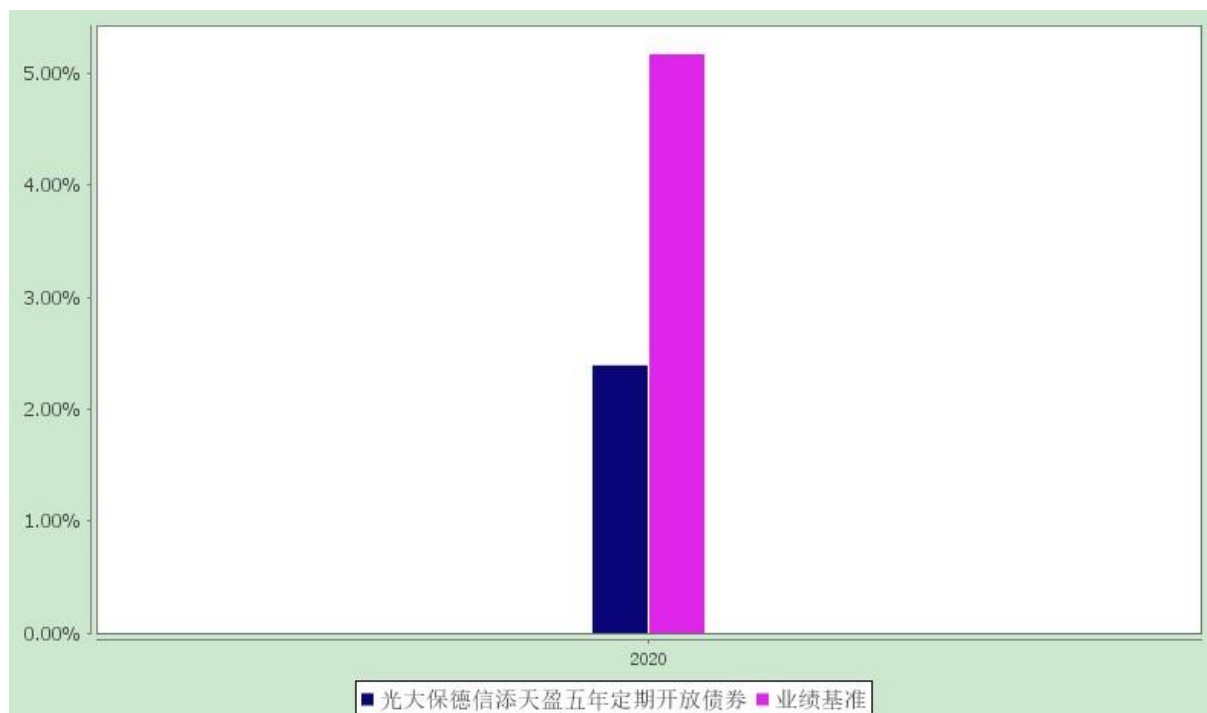
注：1.本基金由原光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金于2020年3月9日转型而来，截至报告期末，本基金合同生效未满一年。

2.按基金合同和招募说明书的约定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。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。

3.1.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金

自基金转型以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



注：本基金由原光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金于2020年3月9日转型而来，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。

光大保德信添天盈五年定期开放债券

3.1.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2020年3月9日）至本报告期末未进行利润分配。

3.2 光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金

3.2.1 主要会计数据和财务指标

3.2.1.1 期间数据和指标	报告期 (2020年1月1日至2020年3月8日)		2019年		2018年	
	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	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	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	314,395.23	62,985,118.20	3,866,390.33	870,391,534.50	11,259,945.49	1,352,942,508.83
本期利润	314,395.23	62,985,118.20	3,866,390.33	870,391,534.50	11,259,945.49	1,352,942,508.83
本期净值收益率	0.4774%	0.5244%	2.6851%	2.9270%	4.0650%	4.3110%
3.2.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年3月8日)		2019年末		2018年末	
	光大保德信添天盈理财债券	光大保德信添天盈理财债券B	光大保德信添天盈理财债券	光大保德信添天盈理财债券B	光大保德信添天盈理财债券	光大保德信添天盈理财债券B

	A 类	类	A 类	类	A 类	类
期末基金资产 净值	7,897,022.81	7,025,039,055 .78	86,312,747.05	17,523,502,25 0.82	219,412,098.4 9	30,518,248,89 1.21
期末基金份额 净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.2.1.3 累计期末 指标	报告期末(2020年3月8日)		2019年末		2018年末	
	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	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	光大保德信 添天盈理财 债券 A 类	光大保德信 添天盈理财 债券 B 类
累计净值收益 率	30.1601%	29.7300%	29.5417%	29.0532%	26.1543%	25.3833%

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。

3.2.2 基金净值表现

3.2.2.1 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

光大保德信添天盈理财债券 A 类

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
2020年1月1日 -2020年3月8 日	0.4774%	0.0029%	0.2550%	0.0000%	0.2224%	0.0029%
2019年7月1日 -2020年3月8 日	1.7366%	0.0031%	0.9450%	0.0000%	0.7916%	0.0031%
2017年7月1日 -2020年3月8 日	9.6596%	0.0029%	3.6825%	0.0000%	5.9771%	0.0029%
2015年7月1日 -2020年3月8 日	16.4850%	0.0030%	6.4238%	0.0000%	10.0612%	0.0030%
2012年10月25 日-2020年3月8 日	30.1601%	0.0035%	11.9943%	0.0014%	18.1658%	0.0021%

光大保德信添天盈理财债券 B 类

阶段	份额净值收 益率①	份额净值收 益率标准差	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标	①-③	②-④
----	--------------	----------------	----------------	----------------	-----	-----

		②		准差④		
2020年1月1日 -2020年3月8日	0.5244%	0.0029%	0.2550%	0.0000%	0.2694%	0.0029%
2019年7月1日 -2020年3月8日	1.9077%	0.0031%	0.9450%	0.0000%	0.9627%	0.0031%
2017年7月1日 -2020年3月8日	10.3641%	0.0029%	3.6825%	0.0000%	6.6816%	0.0029%
2015年7月1日 -2020年3月8日	17.7955%	0.0030%	6.4238%	0.0000%	11.3717%	0.0030%
2012年10月25日 -2020年3月8日	29.7300%	0.0035%	10.6871%	0.0012%	19.0429%	0.0023%

注：B类基金份额于2013年4月25日全部赎回。

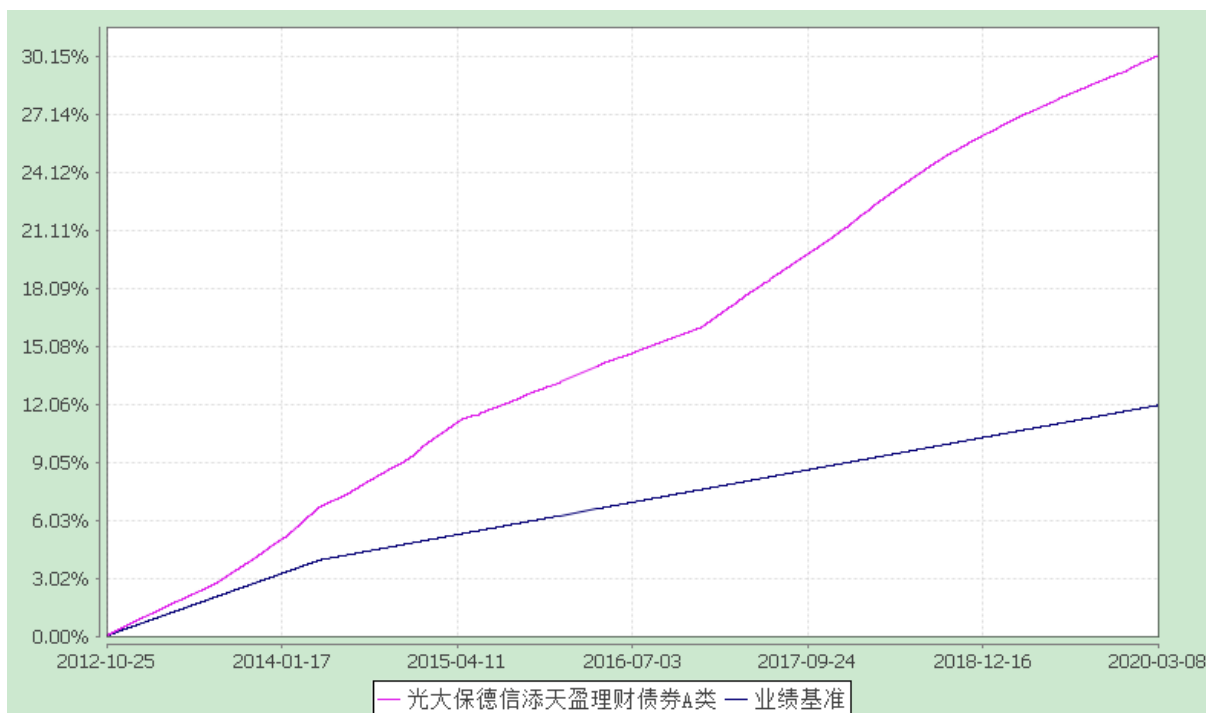
B类基金份额于2013年10月23日重新成立。

基金收益的分配是按日结转份额的。

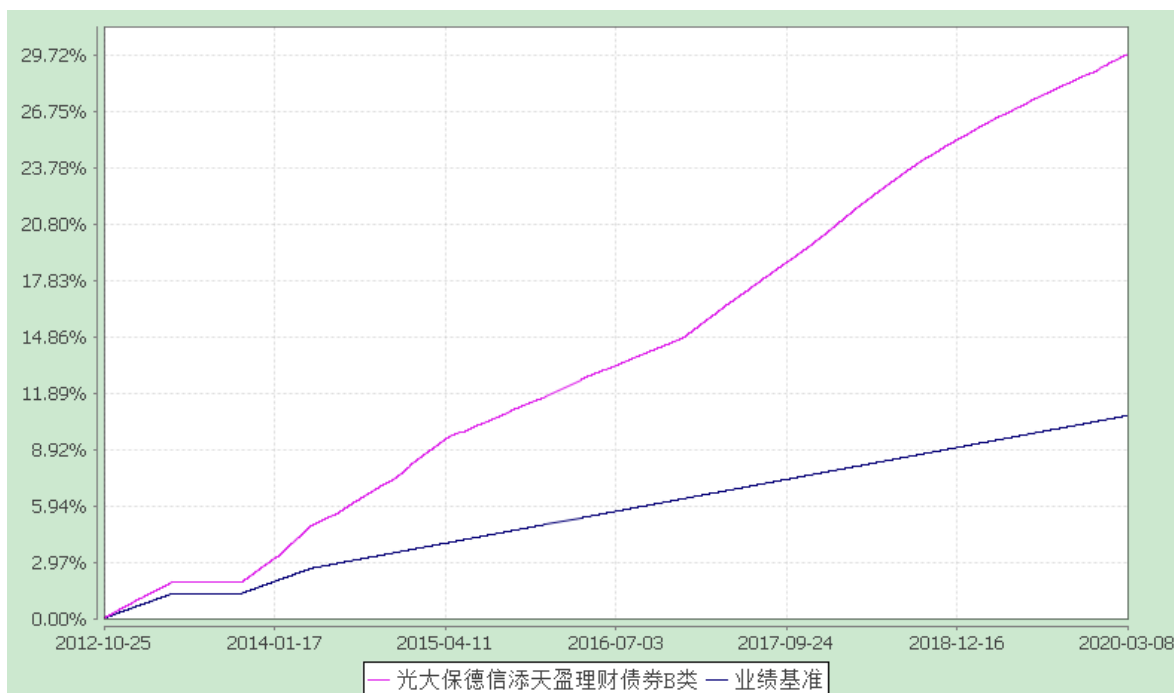
3.2.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年10月25日至2020年3月8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。

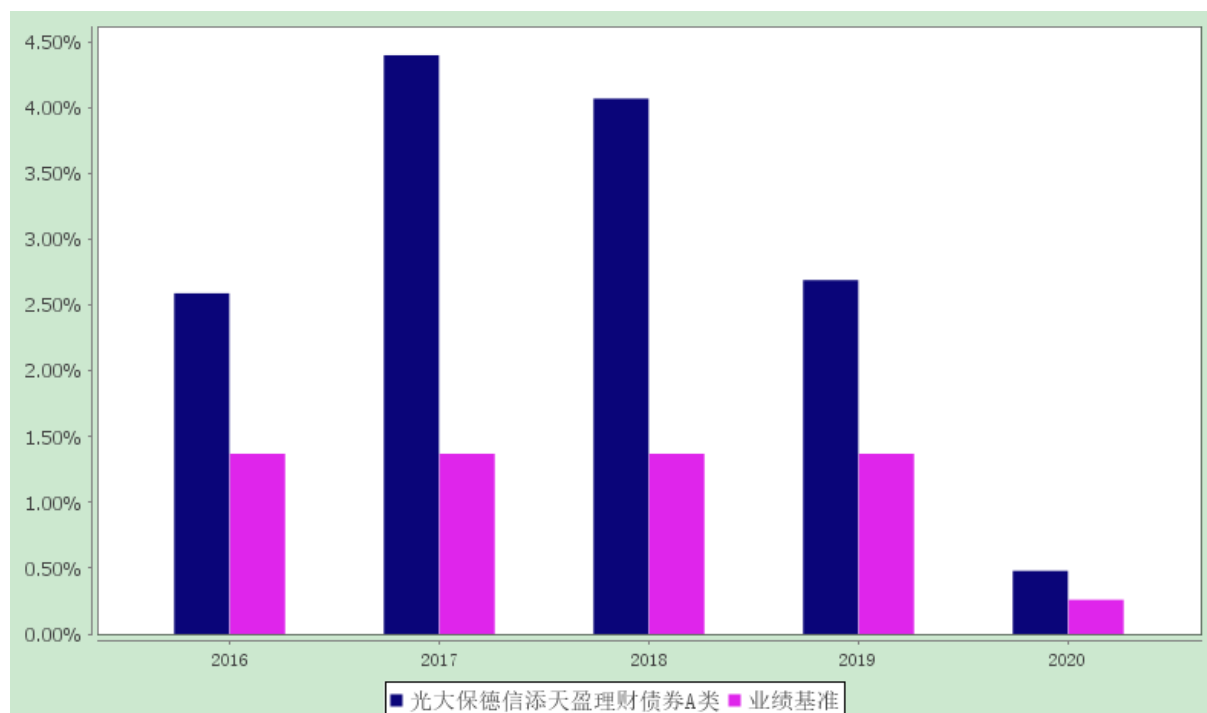
按照基金合同规定，本基金建仓期自基金合同生效日起六个月内。本基金合同生效日为2012年10月25日，本基金已于基金合同规定的期限内完成建仓并达到本基金合同约定的投资比例。

3.2.2.3 过去五年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

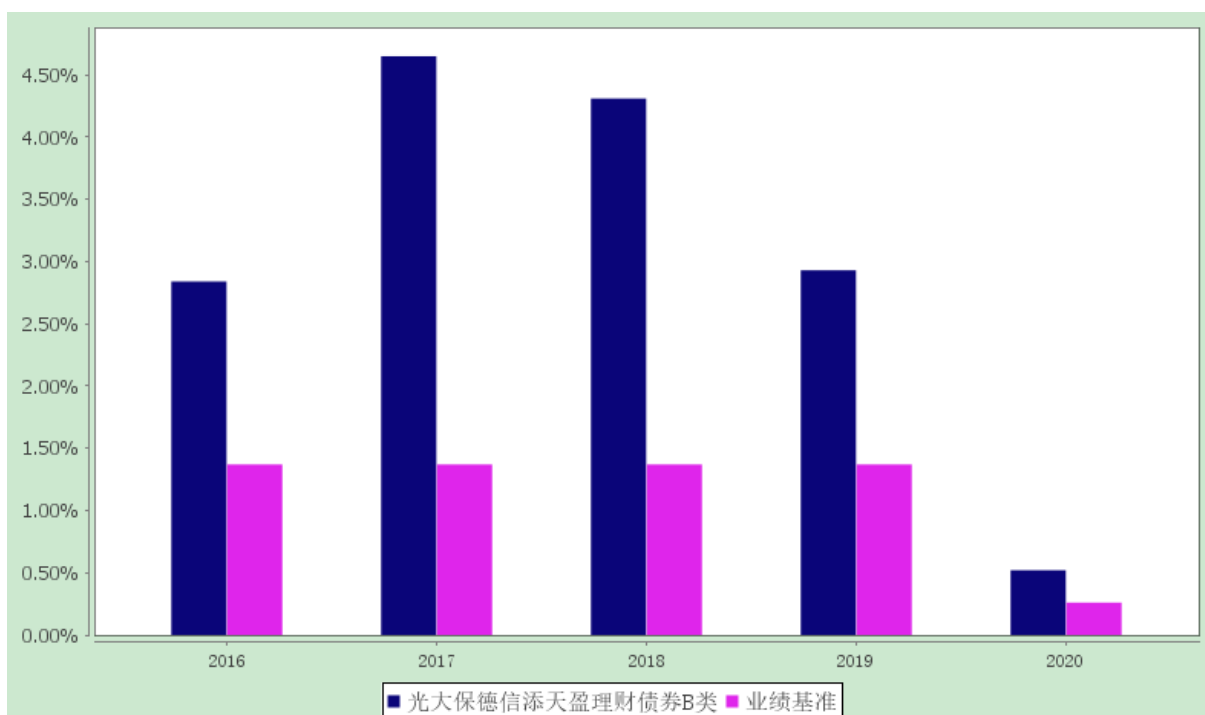
光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金

过去五年基金净值收益率与业绩比较基准历年收益率对比图

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。

本基金基金合同于 2012 年 10 月 25 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。

3.2.3 过去三年基金的利润分配情况

光大保德信添天盈理财债券 A 类

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
2020	314,395.23	-	-	314,395.23	-
2019	3,866,390.33	-	-	3,866,390.33	-
2018	11,259,945.4 9	-	-	11,259,945.49	-
合计	15,440,731.0 5	-	-	15,440,731.05	-

光大保德信添天盈理财债券 B 类

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
2020	62,985,118.2 0	-	-	62,985,118.20	-
2019	870,391,534. 50	-	-	870,391,534.50	-
2018	1,352,942,50 8.83	-	-	1,352,942,508.83	-
合计	2,286,319,16 1.53	-	-	2,286,319,161.53	-

§ 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 2020 年 12 月 31 日，光大保德信旗下管理着 56 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、光大保德信添天盈五年定期开放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、光大保德信安和债券型证券投资基金、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、光大保德信尊丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、光大保德信景气先锋混合型证券投资基金、光大保德信尊泰三年定期开放债券型证券投资基金、光大保德信研究精选混合型证券投资基金、光大保德信消费主题股票型证券投资基金、光大保德信裕鑫混合型证券投资基金、光大保德信瑞和混合型证券投资基金、光大保德信尊合 87 个月定期开放债券型证券投资基金、光大保德信尊裕纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、光大保德信中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、光大保德信安瑞一年持有期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	固定收益部投资副总监、基金经理	2018-01-16	-	8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月在平安养老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, 现任公司固定收益部投资副总监, 2017年8月至今担任光大保德信货币市场基金的基金经理, 2017年8月至2019年9月担任光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2017年11月至2018年3月担任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)的基金经理, 2018年1月至2020年3月担任光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资

				<p>基金(2020年3月起转型为光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金)的基金经理,2018年2月至今担任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的基金经理,2018年3月至2019年11月担任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的基金经理,2018年5月至2020年2月担任光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2018年5月至今担任光大保德信中高等级债券型证券投资基金、光大保德信尊富18个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理,2018年6月至今担任光大保德信超短债债券型证券投资基金的基金经理,2018年8月至2019年9月担任光大保德信晟利债券型证券投资基金的基金经理,2018年9月至2019年9月担任光大保德信安泽债券型证券投资基金的基金经理,2019年8月至今担任光大保德信尊丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2020年3月至今担任光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金的基金经理,2020年8月至今担任光大保德信尊合87个月</p>
--	--	--	--	---

					定期开放债券型证券投资基金的基金经理，2020年12月至今担任光大保德信安瑞一年持有期债券型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：对基金的非首任基金经理，其任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无

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。本基金主要投资标的为银行存款，与其他投资组合未发生交易所和银行间市场债券同向交易，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

一季度受到新冠疫情大幅冲击，全球经济衰退已成定局，国内经济同比增长为负。在良好的疫情防控的基础上，我国经济展现出巨大韧性。货币政策大幅宽松，强化逆周期调节，收益率快速下行。

二季度在常态化疫情防控中经济社会运行基本趋于正常，经济加快恢复增长。收益率沿着经济复苏、利率债供给增大，收益率曲线一路向上，曲线从牛陡转为熊平。

三季度，经济持续修复，出口、地产拉动使增速略超预期，三产修复快于二产，风险资产未体现疫情影响。监管层重申政策维稳，强调流动性调控重心为“稳杠杆”。

四季度，永煤事件发生后，市场情绪受到极大影响，收益率先上后下。但监管层强调“保持宏观杠杆率基本稳定”的调控目标，交易情绪回暖。货币政策更加灵活适度、精准导向。引导市场利率围绕公开市场操作利率和中期借贷便利利率平稳运行。

总体来看，20年黑天鹅频飞，全球经济陷入衰退，而随着全球各大央行提供的源源不断地流动性，无风险利率创新低，风险资产与基本面出现背离，并被不断推高。受益于较快的控制疫情，经济的强劲恢复，我国央行坚持灵活适度、精准导向的货币政策，呵护市场的同时也给实体经济提供了良好支持。

本基金根据契约要求，配置到期日不超过基金下次开放日的政策性金融债等高安全性债券品种，赚取较为稳定的票息收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内(2020年3月9日——2020年12月31日)光大添天盈五年定期开放债券型证券投资基金份额净值增长率为2.39%，业绩比较基准收益率为5.17%。

本报告期内(2020年1月1日——2020年3月8日)原光大保德信添天盈理财债券A类份额净值收益率为0.4774%，业绩比较基准收益率0.2550%；原光大保德信添天盈理财债券B类份额净值收益率为0.5244%，业绩比较基准收益率为0.2550%。

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2021年，随着经济持续修复以及海内外疫情的缓和，流动性的边际收紧会是市场的主要关注点。“稳杠杆”意味着不会出现类似2018年的社融增速大幅下滑；“不急转弯”背景下，央行“结构重于总量”的政策操作思路有望延续。但同时也应留意海内外疫情的反复以及全球疫苗接种进度以及后续效果带来的不确定性。

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、风险管理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、风险管理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，对相关人员进行了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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

光大保德信添天盈五年定期开放债券：

根据相关法律法规和基金合同以及基金实际运作情况，本基金本报告期内未进行利润分配。

光大保德信添天盈理财债券：

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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内(2020年3月9日——2020年12月31日),光大添天盈五年定期开放债券型基金未实施收益分配。

报告期内(2020年1月1日——2020年3月8日),原光大保德信添天盈理财债券 A 实施利润分配的金额为 314,395.23 元。

报告期内(2020年1月1日——2020年3月8日),原光大保德信添天盈理财债券 B 实施利润分配的金额为 62,985,118.20 元。

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 审计报告

6.1 光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金

普华永道中天审字(2021)第 21271 号

光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金(原光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金)全体基金份额持有人:

6.1.1 审计意见

(一) 我们审计的内容

我们审计了光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金(原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“光大保德信添天盈五年定期开放债券基金”)的财务报表,包括

2020年12月31日的资产负债表,2020年3月9日(基金合同生效日)至2020年12月31日止期间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。

(二) 我们的意见

我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了光大保德信添天盈五年定期开放债券基金2020年12月31日的财务状况以及2020年3月9日(基金合同生效日)至2020年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.1.2 形成审计意见的基础

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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。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。

按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于光大保德信添天盈五年定期开放债券基金,并履行了职业道德方面的其他责任。

6.1.3 管理层和治理层对财务报表的责任

光大保德信添天盈五年定期开放债券基金的基金管理人光大保德信基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、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导致的重大错报。

在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估光大保德信添天盈五年定期开放债券基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算光大保德信添天盈五年定期开放债券基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督光大保德信添天盈五年定期开放债券基金的财务报告过程。

6.1.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也

执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，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。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对光大保德信添天盈五年定期开放债券基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致光大保德信添天盈五年定期开放债券基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

陈熹 陈邗迺

上海市湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼

2021 年 3 月 26 日

6.2 光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金

普华永道中天审字(2021)第 21272 号

光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.2.1 审计意见

(一) 我们审计的内容

我们审计了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“光大保德信添天盈理财债券基金”)的财务报表,包括2020年3月8日(基金转型前日)的资产负债表,2020年1月1日至2020年3月8日(基金转型前日)止期间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。

(二) 我们的意见

我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了光大保德信添天盈理财债券基金2020年3月8日(基金转型前日)的财务状况以及2020年1月1日至2020年3月8日(基金转型前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.2.2 形成审计意见的基础

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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。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。

按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于光大保德信添天盈理财债券基金,并履行了职业道德方面的其他责任。

6.2.3 管理层和治理层对财务报表的责任

光大保德信添天盈理财债券基金的基金管理人光大保德信基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、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导致的重大错报。

在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估光大保德信添天盈理财债券基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算光大保德信添天盈理财债券基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督光大保德信添天盈理财债券基金的财务报告过程。

6.2.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，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。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对光大保德信添天盈理财债券基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致光大保德信添天盈理财债券基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

陈熹 陈邗迤

上海市湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼

2021 年 3 月 26 日

§7 年度财务报表

7.1 光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金

7.1.1 资产负债表

会计主体：光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年12月31日
资产:		
银行存款	7.1.4.7.1	908,101.97
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.1.4.7.2	-
其中: 股票投资		-
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.1.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.1.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.1.4.7.5	295,432,606.35
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.1.4.7.6	9,750,959,638.50
资产总计		10,047,300,346.82
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年12月31日
负债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.1.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		2,844,430,293.33
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		913,653.56
应付托管费		304,551.20
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.1.4.7.7	134,781.30
应交税费		-
应付利息		495,886.08
应付利润		-
递延所得税负债		-

其他负债	7.1.4.7.8	329,000.00
负债合计		2,846,608,165.47
所有者权益：		
实收基金	7.1.4.7.9	7,032,936,078.59
未分配利润	7.1.4.7.10	167,756,102.76
所有者权益合计		7,200,692,181.35
负债和所有者权益总计		10,047,300,346.82

注：1.报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0239 元，基金份额总额 7,032,936,078.59 份。

2.本财务报表的实际编制期间为 2020 年 3 月 9 日(基金转型生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间。

3.资产负债表中其他资产为分类为持有至到期投资的债券投资。

7.1.2 利润表

会计主体：光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2020 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		223,099,741.55
1.利息收入		214,024,876.05
其中：存款利息收入	7.1.4.7.11	336,200.12
债券利息收入		212,910,514.92
资产支持证券利息收入		6,213.62
买入返售金融资产收入		771,947.39
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		9,074,865.50
其中：股票投资收益	7.1.4.7.12	-
基金投资收益	7.1.4.7.13	-
债券投资收益	7.1.4.7.14	9,074,865.50
资产支持证券投资收益	7.1.4.7.14	-
贵金属投资收益	7.1.4.7.15	-
衍生工具收益	7.1.4.7.16	-
股利收益	7.1.4.7.17	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号	7.1.4.7.18	-

填列)		
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.1.4.7.19	-
减: 二、费用		55,343,638.79
1. 管理人报酬	7.1.4.10.2	11,887,641.06
2. 托管费	7.1.4.10.2	3,856,112.07
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.1.4.7.20	-
5. 利息支出		39,289,271.49
其中: 卖出回购金融资产支出		39,289,271.49
6. 税金及附加		22.37
7. 其他费用	7.1.4.7.21	310,591.80
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		167,756,102.76
减: 所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		167,756,102.76

7.1.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金

本报告期: 2020年3月9日(基金合同生效日)至2020年12月31日

单位: 人民币元

项目	本期		
	2020年3月9日(基金合同生效日)至2020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)	7,032,936,078.59	-	7,032,936,078.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	167,756,102.76	167,756,102.76
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)	-	-	0.00
其中: 1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)			
五、期末所有者权益(基金净值)	7,032,936,078.59	167,756,102.76	7,200,692,181.35

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1.1 至 7.1.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘翔，主管会计工作负责人：贺敬哲，会计机构负责人：王永万

7.1.4 报表附注

7.1.4.1 基金基本情况

光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金是根据原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“光大保德信添天盈理财债券基金”)基金份额持有人大会于 2020 年 2 月 4 日决议通过的《关于光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金转型的议案》，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[2019]第 2420 号《关于准予光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金变更注册的批复》核准，由原光大保德信添天盈理财债券基金转型而来，原光大保德信添天盈理财债券基金存续期限至 2020 年 3 月 8 日止。自 2020 年 3 月 9 日起，原光大保德信添天盈理财债券基金正式转型为光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)，《光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金基金合同》生效，《光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金基金合同》于同一日失效。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。

本基金以定期开放方式运作，即本基金在一定期间内封闭运作，不接受基金的申购、赎回；在封闭期结束和下一封闭期开始之间设置开放期，受理本基金的申购、赎回等申请。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《光大保德信添天盈五年定期开放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具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债、地方政府债、证券公司短期公司债券、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款等)、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金不投资股票、可转换债券、可交换债券。本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%，在每次开放期开始前一个月、开放期及开放期结束后一个月的期间内，基金投资不受上述比例限制。开放期内，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到

期日在一年以内的政府债券，封闭期内不受上述 5% 的限制，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：该封闭期起始日公布的五年期定期存款利率(税后)+1.5%。根据《光大保德信基金管理有限公司关于调整光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金管理费及托管费并更改业绩比较基准的公告》，本基金的业绩比较基准自 2020 年 8 月 21 日起，修改为在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日公布的三年期定期存款利率(税后)+ 2%。

本财务报表由本基金的基金管理人光大保德信基金管理有限公司于 2021 年 3 月 26 日批准报出。

7.1.4.2 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.1.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.1.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 3 月 9 日(基金转型生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 3 月 9 日(基金转型生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.1.4.4 重要会计政策和会计估计

7.1.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2020 年 3 月 9 日(基金转型生效日)至 2020 年 12 月 31 日。

7.1.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.1.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及可供出售金融资产。

本基金采用买入持有至到期投资策略投资的债券投资和资产支持证券投资分类为持有至到期投资。持有至到期投资是指到期日固定、回收金额固定或可确定，且本基金有明确意图和能力持有至到期的非衍生金融资产。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.1.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。应收款项、持有至到期投资和其他金融负债，取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。

对于应收款项、持有至到期投资和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金于资产负债表日对金融资产的账面价值进行检查，如果有客观证据表明某项金融资产发生减值的，计提减值准备。

以摊余成本计量的金融资产发生减值时，按预计未来现金流量(不包括尚未发生的未来信用损失)现值低于账面价值的差额，计提减值准备。相应的资产减值损失在利润表中列示在其他费用科目下。

如果有客观证据表明该金融资产价值已恢复，且客观上与确认该损失后发生的事项有关，原确认的减值损失予以转回，计入当期损益。但是，该转回后的账面价值不应当超过假定不计提减值准备情况下该金融资产在转回日的摊余成本。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.1.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

不适用。

7.1.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.1.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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。

7.1.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.1.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

于持有至到期投资处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.1.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.1.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.1.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.1.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

持有至到期投资是否减值在很大程度上依赖于基金管理人的判断。本基金的基金管理人定期审阅持有至到期投资以评估其是否出现减值情况，并在出现减值情况时评估减值损失的具体金额。发生减值的客观证据包括评估日该金融工具可观察的市场价值出现严重下跌，发行方发生严重财务困难使该金融资产无法在活跃市场继续交易、无法履行合同条款(例如，无法按期偿付利息或本金)等。在进行判断的过程中，本基金的基金管理人需评估发生减值的客观证据对该项投资预计未来现金流的影响。

7.1.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.1.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.1.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.1.4.5.3 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。

7.1.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.1.4.7 重要财务报表项目的说明

7.1.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
活期存款	908,101.97
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	908,101.97

7.1.4.7.2 交易性金融资产

不适用。

7.1.4.7.3 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。

7.1.4.7.4 买入返售金融资产

7.1.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.1.4.7.4.2 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从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.1.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
应收活期存款利息	92.46
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	295,432,513.89
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	295,432,606.35

7.1.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
其他应收款	-
待摊费用	-
持有至到期投资-债券投资	9,750,959,638.50
合计	9,750,959,638.50

注：于2020年12月31日，本基金持有的持有至到期投资为债券投资，均为银行间市场债券。
该持有至到期投资无需计提减值准备。

7.1.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020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	134,781.30
合计	134,781.30

7.1.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
其他	-
应付银行划款手续费	-
预提审计费	200,000.00
预提信息披露费	120,000.00
账户维护费	9,000.00
合计	329,000.00

7.1.4.7.9 实收基金

光大保德信添天盈五年定期开放债券

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年3月9日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	7,032,936,078.59	7,032,936,078.59
-基金份额折算调整	-	-
-未领取红利份额折算调整（若有）	-	-
-集中申购募集资金本金及利息	-	-
-基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	7,032,936,078.59	7,032,936,078.59

注：1.申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2.根据《关于原光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金转型为光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金的公告》自2020年3月9日起,本基金管理人将根据持有人大会决议执行基金的正式转型,将原光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金结转后的基金份额转型为光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金的基金份额。

3. 本基金本报告期内封闭运作。

7.1.4.7.10 未分配利润

光大保德信添天盈五年定期开放债券

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
基金合同生效日	0.00	-	-
本期利润	167,756,102.76	-	167,756,102.76
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	-	-	-
本期末	167,756,102.76	0.00	167,756,102.76

7.1.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期
	2020年3月9日(基金合同生效日)至2020年12月31日
活期存款利息收入	5,089.30
定期存款利息收入	331,110.82
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	0.00
合计	336,200.12

7.1.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无股票投资收益。

7.1.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

7.1.4.7.14 债券投资收益

7.1.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2020年3月9日（基金合同生效日）至2020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	9,074,865.50
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	9,074,865.50

7.1.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年3月9日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	7,735,542,176.87
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	7,726,467,311.37
减：应收利息总额	-
买卖债券差价收入	9,074,865.50

注：本基金本报告期内产生的买卖债券差价收入均为本基金于基金转型后的建仓期内为符合《光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金基金合同》中的投资限制要求而进行的债券交易。

7.1.4.7.14.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年3月9日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	4,277,653.71
减：卖出资产支持证券成本总额	4,270,000.00
减：应收利息总额	7,653.71
资产支持证券投资收益	-

7.1.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.1.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

7.1.4.7.17 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

7.1.4.7.18 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

7.1.4.7.19 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

7.1.4.7.20 交易费用

本基金本报告期无交易费用。

7.1.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年3月9日（基金合同生效日）至2020年12月31日
审计费用	170,273.12
信息披露费	97,704.84
证券出借违约金	-
银行间汇划费用	11,939.00
帐户维护费	29,274.80
其他费用	1,400.04
合计	310,591.80

7.1.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.1.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.1.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.1.4.9 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（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
光大证券股份有限公司（简称“光大证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
光大保德信资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

7.1.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.1.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.1.4.10.1.1 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。

7.1.4.10.1.2 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。

7.1.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.1.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.1.4.10.1.5 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。

7.1.4.10.2 关联方报酬

7.1.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2020年3月9日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	11,887,641.06
其中：支付销售机构的客户维护费	5,158.90

注：自2020年3月9日至2020年8月20日，支付基金管理人光大保德信基金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×0.25%/当年天数。

根据《光大保德信基金管理有限公司关于调整光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金管理费及托管费并更改业绩比较基准的公告》，自2020年8月21日起，支付基金管理人光大保德信基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.15%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

7.1.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年3月9日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
当期发生的基金应支付的托管费	3,856,112.07	

注：自2020年3月9日至2020年8月20日，支付基金托管人中国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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.08\% / \text{当年天数}。$$

根据《光大保德信基金管理有限公司关于调整光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金管理费及托管费并更改业绩比较基准的公告》，自2020年8月21日起，支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.05%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

7.1.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.1.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.1.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

7.1.4.10.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

7.1.4.10.5 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	
	2020年3月9日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	908,101.97	5,089.30

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.1.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.1.4.10.7 其他关联交易事项的说明

7.1.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.1.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

7.1.4.12 期末（2020年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.1.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限的证券。

7.1.4.12.2 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。

7.1.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.1.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 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 2,844,430,293.33 元，是以如下债券作为抵押：

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
150405	15 农发 05	2021-01-04	104.50	9,039,000.00	944,575,084.79
180401	18 农发 01	2021-01-04	108.54	6,759,000.00	733,628,782.51
150305	15 进出 05	2021-01-06	104.71	3,706,000.00	388,050,362.25
150405	15 农发 05	2021-01-06	104.50	3,158,000.00	330,010,854.93
150205	15 国开 05	2021-01-04	103.80	3,158,000.00	327,802,913.19
150305	15 进出 05	2021-01-04	104.71	2,106,000.00	220,516,476.77
140229	14 国开 29	2021-01-06	106.28	1,053,000.00	111,915,324.94
150405	15 农发 05	2021-01-05	104.50	1,053,000.00	110,038,451.63
合计				30,032,000.00	3,166,538,251.01

7.1.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 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。

7.1.4.13 金融工具风险及管理

7.1.4.13.1 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内部管理制度和流程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。

7.1.4.13.2 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于2020年12月31日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为3.84%。

7.1.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于2020年12月31日，除卖出回购金融资产款余额中有2844430293.33元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.1.4.13.3.1 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》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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发行的证券不得超过该证券的10%。于开放期内，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.1.4.12。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投资的公允价值。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 15%。于 2020 年 12 月 31 日,本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

于开放期内,本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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,本基金在本报告期末流动性情况良好。

7.1.4.13.4 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。

7.1.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于固定利率的交易所及银行间市场交易的固定收益品种,因此资产的账面价值不受市场利率变动的影响存在相应的利率风险。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、债

券投资。

7.1.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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
银行存款	908,101.97	-	-	-	-	-	908,101.97
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	295,432,606.35	295,432,606.35
其他资产	-	-	-	9,750,959,638.50	-	-	9,750,959,638.50
资产总计	908,101.97	-	-	9,750,959,638.50	-	295,432,606.35	10,047,300,346.82
负债							
卖出回购金融资产	2,844,430,293.33	-	-	-	-	-	2,844,430,293.33
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	913,653.56	913,653.56
应付托管费	-	-	-	-	-	304,551.20	304,551.20
应付交易费用	-	-	-	-	-	134,781.30	134,781.30
其他负债	-	-	-	-	-	329,000.00	329,000.00
应付利息	-	-	-	-	-	495,886.08	495,886.08
负债总计	2,844,430,293.33	-	-	-	-	2,177,872.14	2,846,608,165.47
利率敏感度缺口	-2,843,522,191.36	-	-	9,750,959,638.50	-	293,254,734.21	7,200,692,181.35

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

早者予以分类。

7.1.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末生息资产为银行存款、结算备付金及其他资产。其中，银行存款和结算备付金以活期存款利率或相对固定的利率计息，其他资产-持有至到期投资为固定利率持有至到期投资采用摊余成本法核算，利息收益在交易时已确定，不受利率变化影响，资产的账面价值不受市场利率变动的的影响。本基金本期末生息负债仅为卖出回购金融资产款，卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响。因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.1.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.1.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

7.1.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

于2020年12月31日，本基金未持有持续的以公允价值计量的金融工具。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2020年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 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应收款项、持有至到期投资和其他金融负债等。

除持有至到期投资以外，其他不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值差异很小。

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的持有至到期投资账面价值为 9,750,959,638.50 元，公允价值为 9,576,124,000.00 元。

持有至到期投资按如下原则确定公允价值：(i) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。(ii) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。(iii) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》的有关规定，本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值；本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的上述投资的公允价值均属于第二层次。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7.2 光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金

7.2.1 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：2020年3月8日（基金合同失效前日）

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年3月8日（基金合 同失效前日）	上年度末 2019年12月31日
资产：			
银行存款	7.2.4.7.1	500,520,340.93	2,501,154,785.94
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.2.4.7.2	7,695,852,120.06	16,794,870,756.34
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		7,691,582,120.06	16,766,730,756.34
资产支持证券投资		4,270,000.00	28,140,000.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.2.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.2.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.2.4.7.5	10,855,713.16	20,601,842.08
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.2.4.7.6	-	-
资产总计		8,207,228,174.15	19,316,627,384.36
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年3月8日（基金合 同失效前日）	上年度末 2019年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.2.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,173,148,653.42	1,698,096,852.84
应付证券清算款		-	-

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		385,090.00	5,572,229.63
应付托管费		123,228.80	1,783,113.47
应付销售服务费		16,688.02	241,653.21
应付交易费用	7.2.4.7.7	130,026.68	298,377.13
应交税费		68.91	3,051.48
应付利息		149,592.49	528,108.73
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.2.4.7.8	338,747.24	289,000.00
负债合计		1,174,292,095.56	1,706,812,386.49
所有者权益：			
实收基金	7.2.4.7.9	7,032,936,078.59	17,609,814,997.87
未分配利润	7.2.4.7.10	-	-
所有者权益合计		7,032,936,078.59	17,609,814,997.87
负债和所有者权益总计		8,207,228,174.15	19,316,627,384.36

注：1. 报告截止日 2020 年 3 月 8 日(基金转型日前日)，基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 7,032,936,078.59 份，其中 A 类基金份额总额 7,897,022.81 份，B 类基金份额总额 7,025,039,055.78 份。

2.本财务报表的实际编制期间为 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 3 月 8 日(基金转型日前日)止期间。

7.2.2 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 3 月 8 日（基金合同失效前日）

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 3 月 8 日（基 金合同失效前日）	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		74,368,633.54	1,080,784,001.99
1.利息收入		74,435,752.54	1,067,653,296.89
其中：存款利息收入	7.2.4.7.11	7,256,973.06	160,982,343.33
债券利息收入		62,784,177.78	892,407,720.33
资产支持证券利息收入		94,721.71	842,055.98
买入返售金融资产收入		4,299,879.99	13,421,177.25
其他利息收入		-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）		-67,119.00	13,122,337.44
其中：股票投资收益	7.2.4.7.12	-	-
基金投资收益	7.2.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.2.4.7.14	-67,119.00	13,054,556.62
资产支持证券投资收益	7.2.4.7.15	-	67,780.82
贵金属投资收益	7.2.4.7.16	-	-
衍生工具收益	7.2.4.7.17	-	-
股利收益	7.2.4.7.18	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.2.4.7.19	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.2.4.7.20	-	8,367.66
减：二、费用		11,069,120.11	206,526,077.16
1. 管理人报酬	7.2.4.10.2	5,796,443.08	76,456,287.88
2. 托管费	7.2.4.10.2	1,854,861.77	24,466,012.11
3. 销售服务费	7.2.4.10.2	261,813.43	3,402,103.55
4. 交易费用	7.2.4.7.21	-	-
5. 利息支出		3,089,850.12	101,825,992.91
其中：卖出回购金融资产支出		3,089,850.12	101,825,992.91
6. 税金及附加		341.02	3,087.15
7. 其他费用	7.2.4.7.22	65,810.69	372,593.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		63,299,513.43	874,257,924.83
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		63,299,513.43	874,257,924.83

7.2.3 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：2020年1月1日至2020年3月8日（基金合同失效前日）

单位：人民币元

项目	本期		
	2020年1月1日至2020年3月8日（基金合同失效前日）		
	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）	17,609,814,997.87	-	17,609,814,997.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本	-	63,299,513.43	63,299,513.43

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)	-10,576,878,919.28	-	-10,576,878,919.28
其中: 1.基金申购款	7,063,338,968.87	-	7,063,338,968.87
2.基金赎回款	-17,640,217,888.15	-	-17,640,217,888.15
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)	-	-63,299,513.43	-63,299,513.43
五、期末所有者权益(基金净值)	7,032,936,078.59	-	7,032,936,078.59
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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)	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)	-	874,257,924.83	874,257,924.83
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)	-13,127,845,991.83	-	-13,127,845,991.83
其中: 1.基金申购款	8,799,741,857.43	-	8,799,741,857.43
2.基金赎回款	-21,927,587,849.26	-	-21,927,587,849.26
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)	-	-874,257,924.83	-874,257,924.83
五、期末所有者权益(基金净值)	17,609,814,997.87	-	17,609,814,997.87

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.2.1 至 7.2.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘翔，主管会计工作负责人：贺敬哲，会计机构负责人：王永万

7.2.4 报表附注

7.2.4.1 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 类和 B 类两级基金份额,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,但依照约定因认(申)购、赎回等交易及每月收益结转份额而发生基金份额自动升级或者降级的除外。

根据 2014 年 4 月 16 日公布的《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)。

根据本基金的基金管理人于 2020 年 2 月 6 日发布的《光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》，本基金基金份额持有人大会于 2020 年 2 月 4 日表决通过了《关于光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金转型的议案》。经与基金托管人协商一致，基金管理人将《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》修订为《光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金基金合同》。根据本基金的基金管理人于 2020 年 3 月 9 日发布的《关于原光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金转型为光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金的公告》，自 2020 年 3 月 9 日起，《光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金基金合同》生效，《光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金基金合同》于同一日失效，光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金正式转型为光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金。

本财务报表由本基金的基金管理人光大保德信基金管理有限公司于 2021 年 3 月 26 日批准报出。

7.2.4.2 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)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 7.2.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

经中国证监会批准，基金管理人光大保德信基金管理有限公司将本基金于基金合同失效日转型为光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金并相应延长存续期至不定期，因此本基金财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

7.2.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 3 月 8 日(基金转型日前日)止期间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 2020 年 3 月 8 日(基金转型日前日)的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 3 月 8 日(基金转型日前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.2.4.4 重要会计政策和会计估计

7.2.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2020年1月1日至2020年3月8日(基金转型日前日)。

7.2.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.2.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.2.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。对于取得债券投资或资产支持证券投资支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资和资产支持证券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资和资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)

该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.2.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致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或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过 0.25%时，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投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.2.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.2.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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，以及因类别调整而引起的 A、B 类基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

7.2.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

债券投资和资产支持证券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.2.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.2.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额不享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配结转至应付收益科目，每月以红利再投资方式集中支付累计收益。

7.2.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.2.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.2.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.2.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.2.4.5.3 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。

7.2.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.2.4.7 重要财务报表项目的说明

7.2.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年3月8日(基金合同失效前 日)	上年度末 2019年12月31日
活期存款	520,340.93	1,154,785.94
定期存款	500,000,000.00	2,500,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	500,000,000.00	1,000,000,000.00
存款期限 1-3 个月	-	1,500,000,000.00
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	500,520,340.93	2,501,154,785.94

注：定期存款期限指于资产负债表日定期存单剩余到期期限。

7.2.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年3月8日(基金合同失效前日)				
	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	7,691,582,12 0.06	7,701,912,000. 00	10,329,879.94	0.1469
	合计	7,691,582,12 0.06	7,701,912,000. 00	10,329,879.94	0.1469
资产支持证券	4,270,000.00	4,270,000.00	0.00	-	

合计		7,695,852,12 0.06	7,706,182,000. 00	10,329,879.94	0.1469
项目		上年度末 2019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	16,766,730,7 56.34	16,771,426,000 .00	4,695,243.66	0.0267
	合计	16,766,730,7 56.34	16,771,426,000 .00	4,695,243.66	0.0267
资产支持证券		28,140,000.0 0	28,130,000.00	-10,000.00	-0.0001
合计		16,794,870,7 56.34	16,799,556,000 .00	4,685,243.66	0.0266

注：1. 偏离金额=影子定价-摊余成本；

2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

7.2.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.2.4.7.4 买入返售金融资产

7.2.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.2.4.7.4.2 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未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.2.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年3月8日（基金合同失效前 日）	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	8,656.93	851.20
应收定期存款利息	10,843,889.18	20,590,555.18
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	3,167.05	10,435.70

应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	10,855,713.16	20,601,842.08

7.2.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.2.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年3月8日(基金合同失效前 日)	上年度末 2019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	130,026.68	298,377.13
合计	130,026.68	298,377.13

7.2.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年3月8日(基金合同失效前 日)	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
其他	-	-
应付银行划款手续费	-	-
预提审计费	189,726.88	160,000.00
预提信息披露费	142,295.16	120,000.00
账户维护费	6,725.20	9,000.00
合计	338,747.24	289,000.00

7.2.4.7.9 实收基金

光大保德信添天盈理财债券 A 类

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年3月8日(基金合同失效前日)	
	基金份额(份)	账面金额

上年度末	86,312,747.05	86,312,747.05
本期申购	353,850.67	353,850.67
本期赎回（以“-”号填列）	-78,769,574.91	-78,769,574.91
本期末	7,897,022.81	7,897,022.81

光大保德信添天盈理财债券 B 类

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年3月8日（基金合同失效前日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	17,523,502,250.82	17,523,502,250.82
本期申购	7,062,985,118.20	7,062,985,118.20
本期赎回（以“-”号填列）	-17,561,448,313.24	-17,561,448,313.24
本期末	7,025,039,055.78	7,025,039,055.78

注：申购份额含红利再投、转换入和因份额升降级导致的强制调增份额，赎回份额含因份额升降级导致的强制调减份额。

7.2.4.7.10 未分配利润

光大保德信添天盈理财债券 A 类

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	0.00	0.00	0.00
本期利润	314,395.23	-	314,395.23
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	-314,395.23	-	-314,395.23
本期末	0.00	0.00	0.00

光大保德信添天盈理财债券 B 类

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	0.00	0.00	0.00
本期利润	62,985,118.20	-	62,985,118.20
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	-62,985,118.20	-	-62,985,118.20
本期末	0.00	0.00	0.00

7.2.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年3月8日（基金合同失效前日）	2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	7,805.73	32,899.97
定期存款利息收入	7,249,167.33	160,949,443.36
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	-	-
其他	0.00	0.00
合计	7,256,973.06	160,982,343.33

7.2.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无股票投资收益。

7.2.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无基金投资收益。

7.2.4.7.14 债券投资收益

7.2.4.7.14.1 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
	2020年1月1日至2020年3月8日（基金合同失效前日）	2019年1月1日至2019年12月31日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券	-67,119.00	13,054,556.62

到期兑付) 差价收入		
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	-67,119.00	13,054,556.62

7.2.4.7.14.2 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
	2020年1月1日至2020年3月8日（基金合同失效前日）	2019年1月1日至2019年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	21,980,132,488.23	96,325,582,930.51
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	21,980,199,607.23	96,307,032,424.18
减：应收利息总额	-	5,495,949.71
买卖债券差价收入	-67,119.00	13,054,556.62

7.2.4.7.15 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年3月8日（基金合同失效前日）	2019年1月1日至2019年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	23,953,865.72	272,668,151.05
减：卖出资产支持证券成本总额	23,870,000.00	271,860,000.00
减：应收利息总额	83,865.72	740,370.23
资产支持证券投资收益	-	67,780.82

7.2.4.7.16 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.2.4.7.17 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.2.4.7.18 股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间无股利收益。

7.2.4.7.19 公允价值变动收益

本基金本报告期及上年度可比期间无公允价值变动收益。

7.2.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年3月8日（基金合 同失效前日）	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
基金赎回费收入	-	8,367.66
其他	-	-
合计	-	8,367.66

注：本基金对持续持有期少于7日的投资人收取不少于1.5%的赎回费，并将其全额计入基金财产。

7.2.4.7.21 交易费用

本基金本报告期及上年度可比期间无交易费用。

7.2.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年3月8 日（基金合同失效前日）	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	29,726.88	160,000.00
信息披露费	22,295.16	120,000.00
银行间汇划费用	6,763.45	55,217.92
其他费用	300.00	1,375.64
账户维护费	6,725.20	36,000.00
合计	65,810.69	372,593.56

7.2.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.2.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.2.4.8.2 资产负债表日后事项

根据《光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》，光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金自2020年3月9日起转型为光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金。

7.2.4.9 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（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
光大证券股份有限公司（简称“光大证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
光大保德信资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

7.2.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.2.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

7.2.4.10.1.1 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。

7.2.4.10.2 关联方报酬

7.2.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年3月 8日（基金合同失效前日）	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,796,443.08	76,456,287.88
其中：支付销售机构的客户维护费	11,101.60	120,633.74

注：支付基金管理人光大保德信基金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 ×0.25%/ 当年天数。

7.2.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年3月 8日（基金合同失效前日）	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,854,861.77	24,466,012.11

注：支付基金托管人中国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 ×0.08%/ 当年天数。

7.2.4.10.2.3 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 2020年1月1日至2020年3月8日（基金合同失效前日） 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	1,873.32	-
光大保德信	1,383.05	230,609.54	231,992.59
合计	3,256.37	230,609.54	233,865.91
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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
	光大保德信基金管理 有限公司	27,396.93	3,069,004.66
光大证券	201.40	-	201.40
中国建设银行	12,434.00	-	12,434.00
合计	40,032.33	3,069,004.66	3,109,036.99

注：支付基金销售机构的光大保德信添天盈理财基金 A 类和光大保德信添天盈理财基金 B 类的销售服务费分别按前一日该类基金资产净值 0.25% 和 0.01% 的年费率计提。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日A/B类基金资产净值} \times \text{约定年费率} / \text{当年天数}。$$

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

7.2.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.2.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.2.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

7.2.4.10.4.2 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

本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.2.4.10.5 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 2020年1月1日至2020年3月8日（基 金合同失效前日）		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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
中国建设银行	520,340.93	7,805.73	1,154,785.94	32,899.97

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.2.4.10.6 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无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.2.4.10.7 其他关联交易事项的说明

7.2.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.2.4.11 利润分配情况

光大保德信添天盈理财债券 A 类

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分 配合计	备注
314,395.23	-	-	314,395.23	-

光大保德信添天盈理财债券 B 类

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分 配合计	备注
62,985,118.20	-	-	62,985,118.2 0	-

注：本基金在本报告期累计分配收益63,299,513.43元，以红利再投资方式结转入实收基金63,299,513.43元。

7.2.4.12 期末（2020年3月8日）本基金持有的流通受限证券

7.2.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限的证券。

7.2.4.12.2 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的股票。

7.2.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.2.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 3 月 8 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 1,173,148,653.42 元, 是以如下债券作为抵押:

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
111903111	19 农业银行 CD111	2020-03-09	98.97	2,000,000.00	197,937,714.99
111903202	19 农业银行 CD202	2020-03-09	99.24	2,000,000.00	198,486,101.24
112010045	20 兴业银行 CD045	2020-03-09	99.59	440,000.00	43,819,920.32
112011025	20 平安银行 CD025	2020-03-09	99.55	5,560,000.00	553,486,405.88
112018024	20 华夏银行 CD024	2020-03-09	99.54	1,920,000.00	191,123,916.35
112093532	20 徽商银行 CD014	2020-03-09	98.67	1,115,000.00	110,014,428.29
合计				13,035,000.00	1,294,868,487.07

7.2.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 3 月 8 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。

7.2.4.13 金融工具风险及管理

7.2.4.13.1 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内部管理制度和流程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。

7.2.4.13.2 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款不超过基金资产净值的 20%，存放在不具有基金托管资格而具有基金代销业务资格或合格境外机构投资者托管资格的同一商业银行的存款不超过基金资产净值的 5%，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 级以下的债券，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

在现券的选择方面，本基金所投资的央行票据、国债、金融债等投资品种其发行主体分别为央行、财政部和政策性银行，因此不存在重大违约风险。而信用品种的投资，本基金主要对发行主体的资质、发行人长期评级、发行人授信额度等指标进行综合考量，以控制投资品种的违约风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.2.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

7.2.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.2.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年3月8日(基金合同失效 前日)	上年度末 2019年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	7,691,582,120.06	16,766,730,756.34
合计	7,691,582,120.06	16,766,730,756.34

7.2.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

7.2.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年3月8日(基金合同失效 前日)	上年度末 2019年12月31日
AAA	4,270,000.00	28,140,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	4,270,000.00	28,140,000.00

7.2.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.2.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风

险一方面来自于基金份额持有人可于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

于 2020 年 3 月 8 日，除卖出回购金融资产款余额中有 1173148653.42 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.2.4.13.3.1 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》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》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，于 2020 年 3 月 8 日，本基金投资组合的平均剩余期限为 93 天，符合法规及合同要求。

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%。

本基金所持证券在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.2.4.12。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投资的公允价值。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 15%。于 2020 年 3 月 8 日,本基金持有流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规相关要求。

于开放期内,本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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,本基金在本报告期末流动性情况良好。

7.2.4.13.4 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。

7.2.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种,因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控,定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.2.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2020年3月8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
银行存款	500,520,34 0.93	-	-	-	-	-	500,520, 340.93
交易性金融资产	803,221,32 4.79	3,979,723, 856.99	2,912,906, 938.28	-	-	-	7,695,85 2,120.06
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	10,855,7 13.16	10,855,7 13.16
资产总计	1,303,741,6 65.72	3,979,723, 856.99	2,912,906, 938.28	-	-	10,855,7 13.16	8,207,22 8,174.15
负债							
卖出回购金融资产	1,173,148,6 53.42	-	-	-	-	-	1,173,14 8,653.42
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	385,090. 00	385,090. 00
应付托管费	-	-	-	-	-	123,228. 80	123,228. 80
应付交易费用	-	-	-	-	-	130,026. 68	130,026. 68
其他负债	-	-	-	-	-	338,747. 24	338,747. 24
应交税费	-	-	-	-	-	68.91	68.91
应付销售服务费	-	-	-	-	-	16,688.0 2	16,688.0 2
应付利息	-	-	-	-	-	149,592. 49	149,592. 49
负债总计	1,173,148,6 53.42	-	-	-	-	1,143,44 2.14	1,174,29 2,095.56
利率敏感度缺口	130,593,012 .30	3,979,723, 856.99	2,912,906, 938.28	-	-	9,712,27 1.02	7,032,93 6,078.59
上年度末 2019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
银行存款	1,001,154,7 85.94	1,500,000, 000.00	-	-	-	-	2,501,15 4,785.94
交易性金融资产	2,045,891,5 52.56	11,093,52 3,780.78	3,655,455, 423.00	-	-	-	16,794,8 70,756.3 4
应收证券清算	-	-	-	-	-	-	-

款							
应收利息	-	-	-	-	-	20,601,842.08	20,601,842.08
资产总计	3,047,046,338.50	12,593,523,780.78	3,655,455,423.00	-	-	20,601,842.08	19,316,627,384.36
负债							
卖出回购金融资产	1,698,096,852.84	-	-	-	-	-	1,698,096,852.84
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,572,229.63	5,572,229.63
应付托管费	-	-	-	-	-	1,783,113.47	1,783,113.47
应付交易费用	-	-	-	-	-	298,377.13	298,377.13
其他负债	-	-	-	-	-	289,000.00	289,000.00
应交税费	-	-	-	-	-	3,051.48	3,051.48
应付销售服务费	-	-	-	-	-	241,653.21	241,653.21
应付利息	-	-	-	-	-	528,108.73	528,108.73
负债总计	1,698,096,852.84	-	-	-	-	8,715,533.65	1,706,812,386.49
利率敏感度缺口	1,348,949,485.66	12,593,523,780.78	3,655,455,423.00	-	-	11,886,308.43	17,609,814,997.87

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

7.2.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变。		
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 2020年3月8日	上年度末 2019年12月31日
	基准利率上升1%	-20,615,619.73	-37,231,501.47
	基准利率下降1%	20,615,619.73	37,231,501.47

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。

7.2.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.2.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

7.2.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2020年3月8日(基金转型日前日)，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二层次的余额为7,695,852,120.06元，无属于第一或第三层次的余额(2019年12月31日：第二层次16,794,870,756.34元，无第一或第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 3 月 8 日(基金转型日前日), 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31 日: 同)。

(d) 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应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金

(报告期: 2020 年 3 月 9 日(基金合同生效日)-2020 年 12 月 31 日)

8.1.1 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	权益投资	-	-
	其中: 股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,750,959,638.50	97.05
	其中: 债券	9,750,959,638.50	97.05
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-

7	银行存款和结算备付金合计	908,101.97	0.01
8	其他各项资产	295,432,606.35	2.94
9	合计	10,047,300,346.82	100.00

8.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

8.1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

8.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.1.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未投资股票。

8.1.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未投资股票。

8.1.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未投资股票。

8.1.5 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	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,750,959,638.50	135.42
	其中：政策性金融债	9,474,746,818.23	131.58
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,750,959,638.50	135.42

8.1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	200305	20 进出 05	31,700,000	3,194,603,735.59	44.37
2	150205	15 国开 05	22,900,000	2,377,038,224.23	33.01
3	150405	15 农发 05	20,100,000	2,100,449,076.69	29.17
4	180401	18 农发 01	8,300,000	900,890,500.79	12.51
5	150305	15 进出 05	7,400,000	774,844,220.36	10.76

8.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

8.1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.1.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.1.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.1.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于股指期货。

8.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.1.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

8.1.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.1.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.1.12 投资组合报告附注

8.1.12.1 债券20宁波银行小微债02（2020006.IB）、19宁波银行小微债03（1920062.IB）的发行主体

宁波银行股份有限公司于2020年10月16日收到宁波银保监局行政处罚信息公开表（甬银保监罚决字（2020）48号），主要内容为：宁波银行股份有限公司授信业务未履行关系人回避制度、贷后管理不到位。宁波银保监局作出行政处罚决定为罚款人民币30万元，并责令该行对贷后管理不到位直接责任人员给予纪律处分。

基金管理人按照内部研究工作规范对该发行主体进行分析后将其列入基金投资对象备选库并跟踪研究。该行政处罚事件发生后，基金管理人密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。除上述证券外，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。

8.1.12.2 本基金未投资超出基金合同规定的备选股票库。

8.1.12.3 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	应收股利	-
4	应收利息	295,432,606.35
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	295,432,606.35

8.1.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.1.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

8.2 光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金

（报告期：2020年1月1日-2020年3月8日）

8.2.1 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	7,695,852,120.06	93.77
	其中：债券	7,691,582,120.06	93.72
	资产支持证券	4,270,000.00	0.05
2	买入返售金融资产	-	-
	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	500,520,340.93	6.10
4	其他各项资产	10,855,713.16	0.13
5	合计	8,207,228,174.15	100.00

8.2.2 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	8.41	
	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	1,173,148,653.42	16.68
	其中：买断式回购融资	-	-

注：上表中，报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的 20%。

8.2.3 基金投资组合平均剩余期限

8.2.3.1 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	93
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	96

报告期内投资组合平均剩余期限最低值	39
-------------------	----

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

报告期内投资组合平均剩余期限未有违规超过 120 天的情况。

8.2.3.2 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	18.54	16.68
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	36.80	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	19.78	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	41.42	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
	合计	116.54	16.68

8.2.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内未出现投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

8.2.5 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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	7,691,582,120.06	109.37
8	其他	-	-
9	合计	7,691,582,120.06	109.37
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.2.6 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	112011025	20 平安银行 CD025	7,000,000	696,835,403.09	9.91
2	112009025	20 浦发银行 CD025	7,000,000	696,806,065.18	9.91
3	112018024	20 华夏银行 CD024	7,000,000	696,805,945.03	9.91
4	111915364	19 民生银行 CD364	6,000,000	596,683,421.85	8.48
5	112016065	20 上海银行 CD065	4,000,000	395,115,856.44	5.62
6	112093791	20 广州农村商业银行 CD023	4,000,000	395,077,106.70	5.62
7	112093546	20 宁波银行 CD046	4,000,000	394,670,605.40	5.61
8	111989088	19 贵阳银行 CD124	3,000,000	299,572,493.26	4.26
9	112090933	20 北京农商银行 CD020	3,000,000	298,763,373.39	4.25
10	112093844	20 成都银行 CD033	3,000,000	298,274,304.41	4.24

8.2.7 “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	0.1645%
报告期内偏离度的最低值	0.0257%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0777%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

8.2.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例(%)
1	1989319	19 上和 3A1(总价)	1,000,000.00	4,270,000.00	0.06

8.2.9 投资组合报告附注

8.2.9.1 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。

8.2.9.2 报告期末本基金投资的前十名证券中，1、20 广州农村商业银行 CD023，广州农村商业银行股份有限公司于 2019 年 8 月 27 日收到证监会发布《关于对广州农村商业银行股份有限公司采取责令改正措施的决定（2019）61 号》，主要内容为：广州农村商业银行在开展基金销售和托管业务中存在以下问题：基金销售业务部门负责人未取得基金从业资格；未有效执行公司基金销售业务制度；基金销售系统不符合中国证监会对基金销售业务信息管理平台的有关要求；部分从事基金核算业务的人员未取得基金从业资格。上述行为分别违反了《证券投资基金销售管理办法》第十条、第五十五条、第五十六条和《证券投资基金托管业务管理办法》第八条的规定。根据《证券投资基金销售管理办法》第八十七条和《证券投资基金托管业务管理办法》第三十八条的规定，广东证监局决定

对广东农村商业银行采取责令改正的监管措施。

基金管理人按照内部研究工作规范对该发行主体进行分析后将其列入银行信用库并跟踪研究。该监管措施事件发生后，基金管理人密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

2、20 浦发银行 CD025，上海浦东发展银行股份有限公司于 2019 年 10 月 12 日收到银保监会网站发布《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字（2019）7 号）》，主要内容为：（一）对成都分行授信业务及整改情况严重失察；（二）重大审计发现未向监管部门报告；（三）轮岗制度执行不力。被中国银行保险监督管理委员会合计罚款 130 万元。作出行政处罚决定的日期为 2019 年 6 月 24 日。

基金管理人按照内部研究工作规范对该发行主体进行分析后将其列入银行信用库并跟踪研究。该监管措施事件发生后，基金管理人密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

3、20 平安银行 CD025，平安银行股份有限公司于 2020 年 2 月 3 日收到银保监会网站发布《中国银保监会深圳监管局行政处罚信息公开表》（深银保监罚决字（2020）7 号），主要内容为：平安银行股份有限公司存在汽车金融事业部将贷款调查的核心事项委托第三方完成、代理保险销售的人员为非商业银行人员、汽车消费贷款风险分类结果不能反映真实风险水平、个人消费贷款风险分类结果不能反映真实风险水平等违法违规事实，被中国银保监会深圳监管局罚款 720 万元。

基金管理人按照内部研究工作规范对该发行主体进行分析后将其列入银行信用库并跟踪研究。该监管措施事件发生后，基金管理人密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

报告期末本基金投资的前十名证券的其他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内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情况。

8.2.9.3 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	10,855,713.16
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-

8	合计	10,855,713.16
---	----	---------------

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金

(报告期: 2020年3月9日(基金合同生效日)-2020年12月31日)

9.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位: 份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,496	4,701,160.48	7,025,039,055.78	99.89%	7,897,022.81	0.11%

9.1.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	3,183.21	0.00%

9.1.3 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情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

9.2 光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金

(报告期: 2020年1月1日-2020年3月8日)

9.2.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位: 份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的 基金份 额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
光大保德信 添天盈理财	1,493	5,289.37	-	-	7,897,022.81	100.00%

债券 A 类						
光大保德信 添天盈理财 债券 B 类	3	2,341,679, 685.26	7,025,039,05 5.78	100.00%	-	-
合计	1,496	4,701,160. 48	7,025,039,05 5.78	99.89%	7,897,022.81	0.11%

9.2.2 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	11,295,635,620.48	64.14%
2	银行类机构	2,122,644,370.59	12.05%
3	银行类机构	1,709,090,202.63	9.71%
4	银行类机构	1,513,303,582.94	8.59%
5	银行类机构	404,961,068.98	2.30%
6	银行类机构	224,824,906.64	1.28%
7	银行类机构	213,854,016.33	1.21%
8	其他机构	9,639,511.58	0.05%
9	保险类机构	3,143,019.90	0.02%
10	其他机构	1,110,681.94	0.01%

9.2.3 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	光大保德信添天盈理财 债券 A 类	3,652.03	0.00%
	光大保德信添天盈理财 债券 B 类	-	-
	合计	3,652.03	0.00%

9.2.4 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情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	光大保德信添天盈理财 债券 A 类	0~10
	光大保德信添天盈理财 债券 B 类	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	光大保德信添天盈理财 债券 A 类	0~10
	光大保德信添天盈理财 债券 B 类	0

	合计	0~10
--	----	------

§ 10 开放式基金份额变动

10.1 光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金

(报告期: 2020年3月9日(基金合同生效日)-2020年12月31日)

单位: 份

基金合同生效日(2020年3月9日)基金份额总额	7,032,936,078.59
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减: 基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	7,032,936,078.59

注: 光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金份额由原光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金份额转型而来。基金合同于2020年3月9日生效, 本报告期的相关数据按实际存续期计算。

10.2 光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金

(报告期: 2020年1月1日-2020年3月8日)

单位: 份

项目	光大保德信添天盈理财债券 A 类	光大保德信添天盈理财债券 B 类
基金合同生效日 (2012年10月25日)基金份额总额	1,727,443,165.54	324,886,789.49
本报告期期初基金份额总额	86,312,747.05	17,523,502,250.82
本报告期基金总申购份额	353,850.67	7,062,985,118.20
减: 本报告期基金总赎回份额	78,769,574.91	17,561,448,313.24
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	7,897,022.81	7,025,039,055.78

注: 自2020年3月9日起原光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金转型为光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金, 本报告期的相关数据按实际存续期计算。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

2019 年年底，本基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，表决期限为 2019 年 12 月 26 日至 2020 年 1 月 23 日 24 时止，会议审议通过了《关于光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金转型的议案》。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》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，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，基金管理人已对本基金基金合同的内容进行修改，《光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金基金合同》自 2020 年 3 月 9 日起生效。该议案涉及光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金转型有关事项的议案，内容包括变更名称、修改基金份额的申购与赎回、基金的投资、基金资产估值及基金合同的自动终止条款，并调整基金运作方式等事项，详细内容可参看 2019 年 12 月 13 日发布于《证券时报》及公司网站（www.epf.com.cn）上的《光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会的公告》。

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

1、本报告期内，经公司十届十次董事会会议审议通过，自 2020 年 11 月 6 日起，林昌先生正式离任公司董事长，公司总经理刘翔先生代任公司董事长，自 2020 年 11 月 23 日起，公司总经理刘翔先生不再代任公司董事长，王翠婷女士正式担任公司董事长。

2、经公司十届四次董事会会议审议通过，自 2020 年 2 月 11 日起，包爱丽女士正式离任公司总经理，由本基金管理人董事长林昌先生代任公司总经理。经公司十届六次董事会会议审议通过，自 2020 年 7 月 24 日起，公司董事长林昌先生不再代任公司总经理，刘翔先生正式担任公司总经理。

3、经公司十届七次董事会会议审议通过，自 2020 年 8 月 1 日起，李常青先生正式离任公司副总经理、光大保德信资产管理有限公司执行董事，公司总经理刘翔先生兼任光大保德信资产管理有限公司执行董事。

4、经公司十届五次董事会会议审议通过，自 2020 年 11 月 12 日起，翟昱磊正式担任公司首席市场总监。

5、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

本报告期内因基金转型，投资策略也相应修改，具体可参见产品的招募说明书。

11.5 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。

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金未有改聘为其审计的会计师事务所的情况。报告年度应支付给聘任普华永道中天会计师事务所的报酬情况是 20 万元，目前该审计机构已提供审计服务的连续年限为 9 年。

11.7 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。

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金

(报告期：2020年3月9日（基金合同生效日）-2020年12月31日)

11.8.1.1 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	
中金公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-

注：本报告期内本基金未通过租用证券公司交易单元进行股票投资。

(1) 报告期内租用证券公司交易单元变更情况

本基金本报告期内新增租用交易单元 1 个：中金公司（350600）。

(2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

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

基本选择标准如下：

实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；

财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

经营行为规范，近两年未发生重大违规行为而受到证监会处罚；

内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求，并能为本基金提供全面的信息服务；

研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务；对于某一领域的研究实力超群，或是能够提供全方面，高质量的服务。

(3) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

投资研究团队按照(2)中列出的有关经营情况、治理情况的选择标准，对备选的证券经营机构进行初步筛选；

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

根据各成员评分，得出各证券经营机构的综合评分。

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

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

11.8.1.2 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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
中金公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

11.8.2 光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金

(报告期：2020年1月1日-2020年3月8日)

11.8.2.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-

注：本报告期内本基金未通过租用证券公司交易单元进行股票投资。

(1) 报告期内租用证券公司交易单元变更情况

报告期内本基金租用的证券公司交易单元无变更。

(2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

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

基本选择标准如下：

实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；

财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

经营行为规范，近两年未发生重大违规行为而受到证监会处罚；

内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求，并能为本基金提供全面的信息服务；

研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务；

对于某一领域的研究实力超群，或是能够提供全方面，高质量的服务。

(3) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

投资研究团队按照（2）中列出的有关经营情况、治理情况的选择标准，对备选的证券经营机构进行初步筛选；

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

根据各成员评分，得出各证券经营机构的综合评分。

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

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

11.8.2.2 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总	成交金额	占当期债券回购成	成交金额	占当期权证成交总

		额的比例		交总额的 比例		额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

11.9 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)以上的情况。

11.10 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 2019 年 12 月 31 日基金份额净值及累计净值公告	基金管理人公司网站、中国证监会基金电子披露网站及本基金选定的信息披露报纸	2020-01-01
2	光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金 2020 年第 1 期运作周期开放日安排的公告	同上	2020-01-10
3	光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	同上	2020-01-17
4	关于光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金实施转型的提示性公告	同上	2020-02-06
5	光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告	同上	2020-02-06
6	光大保德信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	同上	2020-02-12
7	关于原光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金转型为光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金的公告	同上	2020-03-09
8	光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金基金合同	同上	2020-03-09
9	光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金托管协议	同上	2020-03-09
10	光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金招募说明书	同上	2020-03-09
11	光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	同上	2020-04-22
12	光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金 2019 年年度报告	同上	2020-04-30
13	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分公募基金产品风险等级变动的通知	同上	2020-05-14

14	光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金招募说明书(更新)	同上	2020-06-08
15	光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金招募说明书摘要(更新)	同上	2020-06-08
16	光大保德信基金管理有限公司旗下基金2020年6月30日基金份额净值及累计净值公告	同上	2020-07-01
17	光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金2020年第2季度报告	同上	2020-07-21
18	光大保德信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	同上	2020-07-24
19	光大保德信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	同上	2020-08-01
20	光大保德信基金管理有限公司关于调整公司高级管理人员在子公司兼职情况的公告	同上	2020-08-04
21	光大保德信基金管理有限公司关于调整光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金管理费及托管费并更改业绩比较基准的公告	同上	2020-08-19
22	光大保德信基金管理有限公司光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金基金合同	同上	2020-08-19
23	光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金托管协议	同上	2020-08-19
24	光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金招募说明书(更新)	同上	2020-08-20
25	光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金招募说明书摘要(更新)	同上	2020-08-20
26	光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金2020年中期报告	同上	2020-08-31
27	光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金基金产品资料概要	同上	2020-08-31
28	光大保德信基金管理有限公司关于调整网上直销优惠费率的公告	同上	2020-09-16
29	光大保德信基金管理有限公司关于网上直销系统暂停银联支付渠道认申购与定投业务的通知	同上	2020-09-28
30	光大保德信基金管理有限公司关于网上直销平台关闭农行网银直连支付的公告	同上	2020-10-22
31	光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金2020年第3季度报告	同上	2020-10-28
32	光大保德信基金管理有限公司关于终止大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	同上	2020-10-30
33	光大保德信基金管理有限公司高级管理人员	同上	2020-11-07

	变更公告		
34	光大保德信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	同上	2020-11-14
35	关于养老金账户通过直销柜台申购(含转换转入)旗下所有基金产品费率优惠的公告	同上	2020-11-18
36	光大保德信基金管理有限公司关于网络系统改造升级的公告	同上	2020-11-20
37	光大保德信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	同上	2020-11-24
38	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分公募基金产品风险等级变动的通知	同上	2020-12-01

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金

12.1.1 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
机构	2	20200309-202012 31	-	8,028,2 86,274. 56	4,014,143, 137.28	4,014,143,13 7.28	57.08%
	4	20200309-202012 31	-	5,018,1 59,864. 38	2,509,079, 932.19	2,509,079,93 2.19	35.68%
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>							

12.2 光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金

12.2.1 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

		20%的时间区间					
机构	1	20200121,202002 17-20200224	2,122,6 44,370. 59	9,690,7 47.46	2,132,335, 118.05	-	-
	2	20200122-202003 08	-	8,028,2 86,274. 56	4,014,143, 137.28	4,014,143,13 7.28	57.08%
	3	20200101-202002 11	11,295, 635,62 0.48	36,394, 452.05	11,332,03 0,072.53	-	-
	4	20200121,202002 12-20200308	-	5,018,1 59,864. 38	2,509,079, 932.19	2,509,079,93 2.19	35.68%
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>							

§ 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添天盈五年定期开放债券型证券投资基金设立的文件
- 2、光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金基金合同
- 3、光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金招募说明书
- 4、光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金托管协议
- 5、光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金法律意见书
- 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添天盈五年定期开放债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

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），6-7 层、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：4008-202-888，021-80262888。公司网址：www.epf.com.cn。

光大保德信基金管理有限公司

二〇二一年三月三十一日