

基金管理人:光大保德信基金管理有限公司  
基金托管人:中国光大银行股份有限公司  
报告送出日期:二〇一二年十月二十五日

§ 1 重要提示  
基金管理人的董事会及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，并对其中内容的  
真实性、准确性、完整性和及时性承担个别及连带责任。  
基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年10月24日复核了本报告中的财务  
指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核结果不存在虚假记载、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。  
本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。

本报告告期内财务资料未经审计。

本报告告期自2012年7月1日起至9月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称 光大保德信添天利理财债券型证券投资基金

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2012年6月14日

报告期末基金份额总额 218,490,620.19份

投资目标 本基金通过投资于银行存款等货币市场工具，力争获得超过税后人民币收益的理财产品。

投资策略 本基金将综合考虑各类投资品种的风险和收益特征，在保证基金资产安全的基础上力争为基金份额稳定的收益。同时本基金将关注宏观经济形势、货币政策和政策变化，结合对货币市  
场利率变动的预测对投资组合进行管理。本基金投资于银行存款的  
比例不低于基金资产的90%，基金资产以投资于上市商业银行、大  
型商业性银行、国有控股银行、股份制商业银行、城市商业银行、邮政储蓄  
银行、国有政策性银行、投资银行等银行的协议存款。若本基金投资  
的协议存款中约定可提取并支付利息损失的，则该笔存款的到  
期日不得晚于下一个开放日。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差进行分析，同时结合各银行的信用等  
级、存款期限等因素的研究，综合评估整体金融市场环境及其变动趋  
势，在严格控制风险的前提下选择各银行存款的投资比例。

业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为同期后一年定期存款收益率。

基金管理人 光大保德信基金管理有限公司

下属两级基金的基金简称 光大保德信添天利理财债券A类 光大保德信添天利理财债券B类

下属两级基金的交易代码 360017 360018

报告期末下属两级基金的份额总额 157,900,809.92份 60,589,810.27份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年7月1日-2012年9月30日)

光大保德信添天利理财债券A类 光大保德信添天利理财债券B类

1.本期已实现收益 4,497,686.14 1,493,078.36

2.本期利润 4,497,686.14 1,493,078.36

3.期末基金资产净值 157,900,809.92 60,589,810.27

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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.光大保德信添天利理财债券A类

阶段 净值收益 收益率标准差 业绩比较基准收益 标准差

率① ② ③ ④

过去三个月 0.7884% 0.0005% 0.0770% 0.0002% 0.0183% 0.0003%

2.光大保德信添天利理财债券B类

阶段 净值收益 收益率标准差 业绩比较基准收益 标准差

率① ② ③ ④

过去三个月 0.8513% 0.0003% 0.0770% 0.0002% 0.0812% 0.0001%

3.2.2 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

光大保德信添天利开放式定期理财债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

2012年6月19日至2012年9月30日

1.光大保德信添天利理财债券A类

2.光大保德信添天利理财债券B类

3.光大保德信添天利开放式定期理财债券型证券投资基金

注:本部分仅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和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。

上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 净值增长 率① 净值增 长率② 业绩比较基 准收益 率③ 业绩比较基 准收益 率④

过去三个月 -4.56% 1.03% -3.17% 1.03% -1.38% 0.00%

3.2.2 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

光大保德信新增长股票型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

2006年9月14日至2012年9月30日

4.1 基金经理 或基金经理小组简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 说明

韩爱丽 基金经理 2012-6-19 -

5.1 报告期末本基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例 (%)

1 固定收益投资 - -

其中:债券 - -

资产支持证券 - -

2 买入返售金融资产 - -

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 218,627,598.77 99.87

4 其他各项资产 292,545.94 0.13

5 合计 218,920,144.71 100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)

A 农、林、牧、渔业 - -

B 采掘业 763,707.00 0.09

C 制造业 312,264,615.67 37.37

C0 食品、饮料 63,849,133.80 7.64

C1 纺织、服装、皮毛 - -

C2 木材、家具 - -

C3 纸造、印刷 8,828,491.84 1.06

C4 石油、化学、塑胶、塑料 30,926,772.76 3.70

C5 电子 58,695,860.98 7.02

C6 金属、非金属 23,975,944.56 2.87

C7 机械、设备、仪表 44,280,016.06 5.30

C8 医药、生物制品 81,708,395.67 9.78

C99 其他制造业 - -

D 动力、煤气及水的生产和供 应业 - -

E 建筑业 11,598,048.09 1.39

F 交通运输、仓储业 - -

G 信息技术业 88,372,104.12 10.58

H 批发、零售贸易 34,940,738.26 4.18

I 金融、保险业 132,935,157.39 15.91

J 房地产业 33,146,295.38 3.97

K 社会服务业 43,974,590.33 5.26

L 传播与文化产业 22,573,206.65 2.70

M 综合类 - -

合计 680,568,462.89 81.45

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)

1 601318 中国平安 721,951 30,278,624.94 3.62

2 601877 正泰电器 1,940,214 29,374,839.96 3.52

3 601601 中国太保 1,416,616 28,658,141.68 3.43

4 600967 亿欧亚 1,052,957 24,407,543.26 2.92

5 600585 海螺水泥 1,500,372 23,975,944.56 2.87

6 000895 双汇发展 392,000 23,716,000.00 2.84

7 600976 武汉健民 1,288,000 23,544,640.00 2.82

8 002415 海康威视 798,000 22,120,560.00 2.65

9 601288 中国人寿 1,087,248 20,548,987.20 2.46

10 601628 益佰制药 973,000 20,374,620.00 2.44

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)

1 存出保证金 9,339,527.98 1.00

2 应收证券清算款 585,815.32 0.06

3 应收利息 137,219.79 0.01

4 应收申购款 - -

5 其他应收款 - -

6 持待购入 - -

7 合计 29,399,210.00 3.52

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)

1 100015 中国平安 9,339,527.98 1.00

2 600377 中国太保 300,000 4,485,000.00 0.72

3 603993 中国银行 212,141 636,423.00 0.10

4 100000 中国建设银行 1,000,000 10,163,000.00 1.22

5 100000 中国工商银行 10,163,000.00 1.22

6 100000 中国农业银行 10,163,000.00 1.22

7 100000 中国民生银行 10,163,000.00 1.22

8 100000 中国银行 10,163,000.00 1.22

9 100000 中国邮储银行 10,163,000.00 1.22

10 100000 中国交行 10,163,000.00 1.22

11 100000 中国工行 10,163,000.00 1.22

12 100000 中国建设银行 10,163,000.00 1.22

13 100000 中国民生银行 10,163,000.00 1.22

14 100000 中国银行 10,163,000.00 1.22

15 100000 中国邮储银行 10,163,000.00 1.22

16 100000 中国交行 10,163,000.00 1.22

17 100000 中国工行 10,163,00