

2016年3月28日 星期一 | **B005**

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 （%）
A	农林、牧、渔业	13,279,887.00	0.63
B	制造业	2,709,946.26	0.13
C	建筑业	146,516,270.00	7.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	医药业	33,146,686.71	0.76
F	信息技术业	33,387,800.00	0.62
G	交通运输、仓储和邮政业	15,563,252.00	0.75

[illegible]

2	000034	深赛格环保	1,440,000.00	78,284,562.00	0.46
3	000002	万科A	500,000.00	12,216,000.00	0.28
4	000086	用友网络	360,000.00	11,153,000.00	0.25
5	002682	博彦科技	150,000.00	10,120,366.00	0.23
6	000051	招商局	300,000.00	10,038,000.00	0.22
7	000033	荣信股份	500,000.00	9,900,000.00	0.22
8	000030	中信银行	490,970.00	9,489,857.04	0.21
9	000439	维创光电	350,000.00	9,279,500.00	0.21
10	000092	世纪证券	1,000,000.00	9,110,000.00	0.21

注：投资者持有本基金报告期末本基金持有的所有股票期间，应将其持仓数据于本基金管理人网站进行年度报告正文。

8.4 截至报告期末本基金投资组合的行业分布情况

8.4.1 按行业分类本期期末基金资产净值占或前20位的行业数据

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期资产占基金资产	占本基金资产净值比例 (%)
1	000116	华能水电	79,216,700.00	1.64
2	000009	深宝安	69,268,000.00	1.47
3	000048	招商局A	27,496,400.00	0.58

序号	股票代码	股票名称	本期资产占比金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000002	万科A	29,562,374.71	0.72
2	000003	比亚迪	29,138,017.44	0.71
3	000004	华鲁能源	28,224,929.12	0.69
4	000006	顺鑫农业	27,486,420.10	0.67
5	000024	大众交通	27,386,090.30	0.67
6	000048	天目药业	26,637,582.00	0.65
7	000056	陕国投A	26,356,184.07	0.64
8	000071	北京银行	26,290,380.00	0.64
9	000083	海通证券	22,770,243.07	0.55
10	000085	同创伟业	22,603,221.85	0.55
11	001089	中信特钢	21,284,900.00	0.51
12	000079	汇金股份	20,791,526.00	0.47
13	000002	平安发展	19,176,075.00	0.43
14	000019	三花股份	18,896,144.86	0.43
15	000001	中国平安	18,709,401.00	0.42

6	000002	万科A	20,767,582.07	0.47
7	002462	惠事登	20,462,380.17	0.46
8	603993	洛凯矿业	20,228,600.00	0.46
9	000048	保利地产		

11	600063	陆家嘴	18,710,381.15	0.42
12	300070	鲁水器	17,822,166.00	0.40
13	600271	航天信息	17,762,460.07	0.40

14	000010	招商銀行	16,952,889.00	0.30
16	300251	光线传媒	15,814,769.00	0.36
17	000733	振华科技	15,705,132.99	0.36

19	600620	隧道股份	15,062,952.36	0.34
20	600482	福能股份	14,094,360.00	0.34

84.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额  
单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,209,071,344.86
卖出股票的收入（成交）总额	837,350,382.63

注：84.1项“买入金额”、84.2项“卖出金额”及84.3项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

序号	债券品种	公允价值	点基金资产净值比例(%)
1	国家债券	167,198,028.20	3.79
2	央行票据	-	-

3	短期融资券	1,032,436,000.00	23.29
	其中：政策性金融债	1,022,430,000.00	23.29
4	企业债券	1,024,611,900.00	23.21
5	企业短期融资券	542,406,000.00	12.29

6	应付利息	283,395,000.00	1.91
7	可转换债	652,000.00	0.01
8	其他	100,196,348.20	2.27
9	合计	3,110,897,276.40	70.48

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	150418	15成发18	5,000,000	511,000,000.00	116.8

2	122409	15龙湖02	2,000,000	201,900,000.00	4.58
3	160212	16湖开12	1,900,000	194,104,000.00	4.40
4	019609	15湖供00	1,000,310	167,198,028.20	3.79
5	112200	16湖供01	1,600,000	161,960,000.00	3.63

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小非名的前十名资产支持证券投资明细  
本基金本报告期末未投资资产支持证券。

8.8 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。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小非名的前五名权证投资明细

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策  
本基金将在风险可控的前提下,以套期保值为目的,根据对现货和期货市场的分析,充分考虑股指期货的风险收益特征,通过多头或

8.1.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

8.11.3 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。  
8.12 投资组合报告附注  
8.12.1 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内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情形。

序号	名称	金额
1	存出保证金	569,008.21

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	49,234,431.90
5	应收申购款	3,331.48

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	49,836,771.59

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例	流通受限情况说明
----	------	------	-------------	-----------	----------

1	000002	万科 A	12,216,000.00	0.28	重大事項
---	--------	------	---------------	------	------

**§ 9 基金份額持有人信息**

9.1 期末基金份額持有人戶數及持有人結構  
份額單位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	资产构成			
			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

光大保德信添利A	3,426.67	1,139,785.73	3,000,000.00	90.33%	307,917,389.90	7.97%
光大保德信添利C	27	10,560,653.15	500,000,000.00	90.93%	187,626.15	0.17%
合计	3,255	1,338,961.78	4,060,000,000.00	92.93%	308,285,025.11	7.07%

9.2 期末基金管理人从业员持有本基金的情况

基金名称	基金代码	基金规模(元)	基金管理人从业员持有基金情况
光大保德信添利A	004419	3,426.67	1,139,785.73
光大保德信添利C	004427	27	10,560,653.15

基金管理人所有从业人员持有本基金	光大保德信鑫鑫A	2,020,050.32	0.07%
	光大保德信鑫鑫C	1.00	0.00%
	合计	2,020,050.32	0.06%

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	光大保德信鼎鑫A	>100
	光大保德信鼎鑫C	0
	合计	>100

本基金基金经理持有本开放式基金	光大保德信鼎鑫A	0
	光大保德信鼎鑫C	0
	合计	0

5.10 开放式基金份额变动

项目	光大保德信鑫鼎A	光大保德信鑫鼎C
基金合同生效日(2015年6月11日)基金份额总额	3,497,694,496.03	0.00
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	3,243,929,678.46	600,878,567.64

基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	3,067,420,266.05	500,067,626.15

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  
李常青先生自2015年2月28日起担任本基金管理人督察长；自李常青先生担任督察长职务之日起，陶歆先生不再代行督察长职务。经公司管理层批准及八届十九次董事会审议通过，自2015年11月11日起，张弛因个人原因正式离职。经公司八届二十一次董事会会议审议

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。

报告期内,本基金聘任安永华明会计师事务所为其审计的会计师事务所。报告年度应支付给安永华明会计师事务所的报酬是6万元整,目前该审计机构已提供审计服务的连续年限为1年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况  
本报告期内,本基金的基金管理人及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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付给券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总额的比例	

国金证券	1	568,508,286.15	29.05%	500,900.40	26.44%	-
银河证券	1	1,071,010,503.36	51.10%	997,430.05	51.81%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-

瑞银证券	1	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-

中银国际	1	—	—	—	—
平安证券	1	—	—	—	—
高华证券	1	—	—	—	—
中金公司	1	—	—	—	—

兴业证券	1	--	--	--	--
宏源证券	1	--	--	--	--
海通证券	1	--	--	--	--
广发证券	1	--	--	--	--

中信证券	1	--	--	--	--	--
中信证券	1	--	--	--	--	--

注：(1)报告期内租用证券公司交易单元变更情况  
本报告期内本基金无新增租用证券公司交易单元。

(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  
本基金管理人选择证券经纪商，其选用标准包括：  
①信誉良好，财务状况稳健；  
②资本实力雄厚，具备较强的抗风险能力；  
③具备良好的合规记录；  
④具备良好的客户服务意识；  
⑤具备良好的信息技术系统；  
⑥具备良好的研究能力；  
⑦具备良好的风险控制能力；  
⑧具备良好的流动性管理能力；  
⑨具备良好的风险管理能力；  
⑩具备良好的其他相关服务。

研究服务的原则,对该证券经营机构的经营范围、治理情况、研究实力等进行综合考量。

7.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;

8.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;

9.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

9. 投资研究团队按照(1)中列出的有关经营情况、治理情况的选择标准,对备选的证券经营机构进行初步筛选;

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。  
董事会已做出决议,授权总经理依照公司对各券商的评价结果全权处理并决定公司旗下基金租用专用交易席位的事宜。  
11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
光大证券	667,464,520.64	80.34%	23,494,300,000.00	80.69%	--	--
银河证券	309,480,000.00	39.08%	2,900,300,000.00	50.33%	--	--

光大保德信基金管理有限公司  
二〇一六年三月二十八日