

## 光大保德信信用添益债券型证券投资基金

## [2013] 第二季度报告

基金管理人:光大保德信基金管理有限公司  
基金托管人:中国民生银行股份有限公司  
报告送出日期:二〇一三年七月十八日

§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，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人和基金份额持有人根据基金合同约定，对2013年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、持有人账户信息等数据，核对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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至6月30日止。

## §2 基金产品概况

基金简称:光大保德信信用添益债券

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2011年5月16日

报告期末基金份额总额:495,600,148.73份

投资目标:本基金在充分控制风险和保持资产流动性的基础上，通过严格的信用分析和利率变动趋势分析，在获取当期收益的同时，力争实现基金资产的长期增值。

投资策略:本基金在充分考虑债券市场运行状况和特征的基础上，将投资策略分为两个部分：债券投资策略和利率投资策略。本基金将债券投资策略分为利率策略、信用策略，可转债策略和打新策略。本基金将充分结合宏观经济和证券市场的形势，运用丰富的投资经验，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期增值。

## 业绩比较基准:中债综合指数

风险收益特征:本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的风险较低的品种，其预期收益及风险水平高于货币市场基金，但低于股票型基金和混合型基金。

基金管理人:光大保德信基金管理有限公司

基金托管人:中国民生银行股份有限公司

下属两级基金的基金简称:光大保德信信用添益债券A类

下属两级基金的交易代码:360013

报告期末下属两级基金的份额总额:332,795,195.52份

162,804,953.21份

## §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)

光大保德信信用添益债券A类 光大保德信信用添益债券C类

1.本期已实现收益 4,672,451.39 2,730,035.18

2.本期利润 2,615,425.70 2,235,337.97

3.加权平均基金份额本期利润 0.0063 0.0088

4.期末基金资产净值 343,868,775.01 167,123,698.49

5.期末基金份额净值 1.033 1.027

注: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。上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易产生的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

## 3.2 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

## 3.2.1 本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

## 3.2.2 本基金信用添益债券A类:

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 准收益率④ ①-③ ②-④

过去三个月 1.06% 0.18% -0.10% 0.11% 1.16% 0.07%

## 3.2.3 本基金信用添益债券C类:

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 准收益率④ ①-③ ②-④

过去三个月 1.07% 0.18% -0.10% 0.11% 1.17% 0.07%

3.2.2 基金合同生效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

## 光大保德信信用添益债券型证券投资基金

累计基金份额净值与业绩比较基准收益率的历史走势图(2011年5月16日至2013年6月30日)

1.光大保德信信用添益债券A类:

2.光大保德信信用添益债券C类:

3.光大保德信信用添益债券:

4.光大保德信信用添益债券型证券投资基金

5.光大保德信信用添益债券

注:根据基金合同的规定，本基金建仓期为2011年5月16日至2011年11月15日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

## §4 管理人报告

## 4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名 职务 在任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

陆欣 固定收益基金副总监、基金经理 2011-5-16 - 7年 陆欣先生，复旦大学数量经济学硕士，中国注册会计师，中国精算师，现任中国银行全球金融市场部上海交易室中心债券部经理，光大保德信基金管理有限公司债券研究部研究员、宏观分析师，历任光大保德信债券基金经理，光大保德信信用添益债券基金经理，光大保德信信用添益债券型证券投资基金基金经理，光大保德信信用添益债券型证券投资基金基金经理。

4.2 报告期内本基金运作合规性说明

本基金的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、证监会规定及基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。

本基金在运作过程中不存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金的基金管理人旗下所有基金在获得投研团队、交易团队支持等各方面得

到公平对待，基金经理人从投研设计、工作流程制定、技术系统建设和完善、公平交易执行效果等各方面出发，建设形成有效的公平交易执行体系。本报告期内，基金管理人各项公平交易制度执行情况良好，未发现存在违反公平交易原则的现象。

## 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金的基金管理人严格执行《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》。

2013年第二季度股市出现下跌走势，未来股票市场仍呈现震荡的走势，我们将持续控制权益类资产的配置比例，以获取基金资产的长期增长。

4.4 报告期内基金管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

本基金的基金管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

本基金的基金管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望