

信息披露 disclosure

光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金

2014年度报告摘要

基金管理人:光大保德信基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年三月三十日
1 重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构均承诺不存在虚假记载、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”)于2015年4月23日发布了本基金的财务报告,净值表现、利润分配情况、财务会计报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

7.4.3.1关于关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
本基金本报告期和上年度比较期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。
7.4.3.1.4关于关联方投资本基金的情况
7.4.3.1.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
本基金基金管理人、本报告期和上年度比较期间均未运用固有资金投资本基金。

Table with 2 columns: 2.1 基金基本情况, 2.2 基金业绩说明. Includes fund name, manager, and performance metrics.

Table with 2 columns: 7.1 资产负债表, 7.2 利润分配. Shows balance sheet and dividend distribution details.

Table with 2 columns: 7.4.3.2 交易所市场债券正回购, 7.4.3.2.1 期末未交付款项的股票投资组合. Details on repo and stock portfolio.

2.3 基金管理人及基金托管人
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

Table with 2 columns: 7.3 主要会计数据和财务指标, 7.3.1 主要会计数据和财务指标. Financial performance indicators.

Table with 2 columns: 7.4.3.2.2 期末未交付款项的债券投资组合, 7.4.3.2.3 期末未交付款项的资产支持证券投资组合. Details on bond and asset-backed securities portfolios.

2.4 信息披露方式
基金年度报告全文披露网站: www.ebdfund.com
基金年度报告全文披露日期: 2015年4月23日

Table with 2 columns: 7.4.3.2.4 期末未交付款项的资产支持证券投资组合. Details on asset-backed securities portfolio.

Table with 2 columns: 8.1 期末未交付款项的股票投资组合, 8.1.1 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 期间数据和指标
3.1.2 期末总资产和净资产

Table with 2 columns: 7.4.3.2.5 期末未交付款项的资产支持证券投资组合. Details on asset-backed securities portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.2 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

注: (1) 本期实现投资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。
(2) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的款项和费用,计入认购后实际收益率水平要低于所列数字。

Table with 2 columns: 7.4.3.2.6 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.3 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

3.2 基金业绩比较
3.2.1 基金业绩比较基准及其与同期业绩比较基准收益率的比较
3.2.2 基金业绩比较基准及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 2 columns: 7.4.3.2.7 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.4 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

注:为了更好地反映债券市场整体运行情况和本基金管理人旗下相关基金投资组合的运作情况,将与与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致,自2014年1月1日起,将本基金的业绩比较基准原“75%×沪深300指数收益率+45%×中债新综合指数收益率”变更为“75%×沪深300指数收益率+45%×中证全债指数收益率”,业绩比较基准在每个交易日实时更新调整。

Table with 2 columns: 7.4.3.2.8 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.5 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

3.2.2.1 基金业绩比较基准及其与同期业绩比较基准收益率的比较
3.2.2.2 基金业绩比较基准及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 2 columns: 7.4.3.2.9 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.6 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

注:根据基金合同的约定,本基金建仓期为2009年10月29日至2010年4月28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限制。

Table with 2 columns: 7.4.3.2.10 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.7 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

3.2.3 过去五年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

Table with 2 columns: 7.4.3.2.11 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.8 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

注:本基金基金合同于2009年10月29日生效,合同生效当年净值收益率按实际存续期间计算,未按整个自然年度折算。

Table with 2 columns: 7.4.3.2.12 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.9 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

3.3 过去三年基金的利润分配情况
单位:人民币元

Table with 2 columns: 7.4.3.2.13 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.10 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

4.1 基金管理人及基金投资管理
4.1.1 基金管理人及其投资管理者的经验
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证证券(控股)有限公司和光大保德信金融控股(集团)有限公司共同创建,公司总部在上海,注册资本人民币1.6亿元,股权结构为:光大集团持股51%,光大证券持股49%。

Table with 2 columns: 7.4.3.2.14 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.11 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

4.1.2 基金管理人及其投资管理者的经验
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证证券(控股)有限公司和光大保德信金融控股(集团)有限公司共同创建,公司总部在上海,注册资本人民币1.6亿元,股权结构为:光大集团持股51%,光大证券持股49%。

Table with 2 columns: 7.4.3.2.15 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.12 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

4.1.3 基金管理人及其投资管理者的经验
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证证券(控股)有限公司和光大保德信金融控股(集团)有限公司共同创建,公司总部在上海,注册资本人民币1.6亿元,股权结构为:光大集团持股51%,光大证券持股49%。

Table with 2 columns: 7.4.3.2.16 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.13 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

4.1.4 基金管理人及其投资管理者的经验
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证证券(控股)有限公司和光大保德信金融控股(集团)有限公司共同创建,公司总部在上海,注册资本人民币1.6亿元,股权结构为:光大集团持股51%,光大证券持股49%。

Table with 2 columns: 7.4.3.2.17 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.14 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

4.1.5 基金管理人及其投资管理者的经验
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证证券(控股)有限公司和光大保德信金融控股(集团)有限公司共同创建,公司总部在上海,注册资本人民币1.6亿元,股权结构为:光大集团持股51%,光大证券持股49%。

Table with 2 columns: 7.4.3.2.18 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.15 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

4.1.6 基金管理人及其投资管理者的经验
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证证券(控股)有限公司和光大保德信金融控股(集团)有限公司共同创建,公司总部在上海,注册资本人民币1.6亿元,股权结构为:光大集团持股51%,光大证券持股49%。

Table with 2 columns: 7.4.3.2.19 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.16 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

4.1.7 基金管理人及其投资管理者的经验
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证证券(控股)有限公司和光大保德信金融控股(集团)有限公司共同创建,公司总部在上海,注册资本人民币1.6亿元,股权结构为:光大集团持股51%,光大证券持股49%。

Table with 2 columns: 7.4.3.2.20 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.17 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

4.1.8 基金管理人及其投资管理者的经验
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证证券(控股)有限公司和光大保德信金融控股(集团)有限公司共同创建,公司总部在上海,注册资本人民币1.6亿元,股权结构为:光大集团持股51%,光大证券持股49%。

Table with 2 columns: 7.4.3.2.21 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.18 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

4.1.9 基金管理人及其投资管理者的经验
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证证券(控股)有限公司和光大保德信金融控股(集团)有限公司共同创建,公司总部在上海,注册资本人民币1.6亿元,股权结构为:光大集团持股51%,光大证券持股49%。

Table with 2 columns: 7.4.3.2.22 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.19 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

4.1.10 基金管理人及其投资管理者的经验
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证证券(控股)有限公司和光大保德信金融控股(集团)有限公司共同创建,公司总部在上海,注册资本人民币1.6亿元,股权结构为:光大集团持股51%,光大证券持股49%。

Table with 2 columns: 7.4.3.2.23 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.20 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

4.1.11 基金管理人及其投资管理者的经验
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证证券(控股)有限公司和光大保德信金融控股(集团)有限公司共同创建,公司总部在上海,注册资本人民币1.6亿元,股权结构为:光大集团持股51%,光大证券持股49%。

Table with 2 columns: 7.4.3.2.24 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.21 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

4.1.12 基金管理人及其投资管理者的经验
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证证券(控股)有限公司和光大保德信金融控股(集团)有限公司共同创建,公司总部在上海,注册资本人民币1.6亿元,股权结构为:光大集团持股51%,光大证券持股49%。

Table with 2 columns: 7.4.3.2.25 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.22 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

4.1.13 基金管理人及其投资管理者的经验
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证证券(控股)有限公司和光大保德信金融控股(集团)有限公司共同创建,公司总部在上海,注册资本人民币1.6亿元,股权结构为:光大集团持股51%,光大证券持股49%。

Table with 2 columns: 7.4.3.2.26 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.23 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

4.1.14 基金管理人及其投资管理者的经验
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证证券(控股)有限公司和光大保德信金融控股(集团)有限公司共同创建,公司总部在上海,注册资本人民币1.6亿元,股权结构为:光大集团持股51%,光大证券持股49%。

Table with 2 columns: 7.4.3.2.27 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.24 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

4.1.15 基金管理人及其投资管理者的经验
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证证券(控股)有限公司和光大保德信金融控股(集团)有限公司共同创建,公司总部在上海,注册资本人民币1.6亿元,股权结构为:光大集团持股51%,光大证券持股49%。

Table with 2 columns: 7.4.3.2.28 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.25 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

4.1.16 基金管理人及其投资管理者的经验
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证证券(控股)有限公司和光大保德信金融控股(集团)有限公司共同创建,公司总部在上海,注册资本人民币1.6亿元,股权结构为:光大集团持股51%,光大证券持股49%。

Table with 2 columns: 7.4.3.2.29 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.26 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.27 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.28 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.29 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.30 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.31 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.32 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.33 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.34 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.35 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.36 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.37 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.38 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.39 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.40 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.41 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.42 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.43 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.44 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.45 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.46 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.47 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.48 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.49 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.50 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.51 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.52 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.53 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.54 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.55 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.

Table with 2 columns: 8.1.56 期末未交付款项的股票投资组合. Details on stock portfolio.