

基金管理人:光大保德信基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年三月三十日

光大保德信添盛双月理财债券型证券投资基金

2014年度报告摘要

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。

重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构及其从业人员不得从事损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期:2014年1月1日至2014年11月20日
单位:人民币元

资产负债表
项目 2014年11月20日 2014年12月31日 2013年12月31日

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
7.3.1 本报告期基金份额变动表
7.3.2 所有者权益(基金净值)变动表
本报告期:2014年1月1日至2014年11月20日
单位:人民币元

2.1 基金基本情况
2.2 基金产品说明
2.3 基金管理人及基金托管人

基金基本情况表
基金管理人:光大保德信基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司

2.4 信息披露方式
3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况
3.1 主要会计数据和财务指标

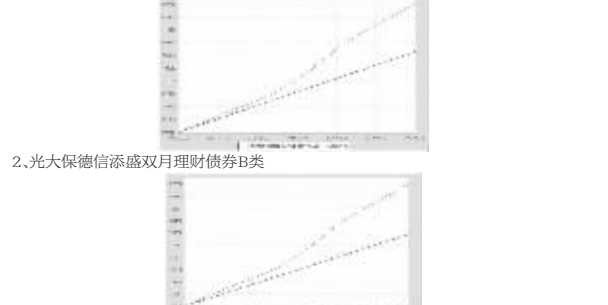
主要会计数据和财务指标表
3.1.1 本期主要财务指标
3.1.2 本报告期基金份额净值和基金份额累计净值

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。

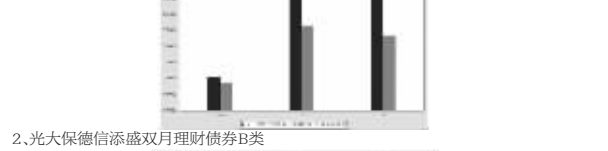
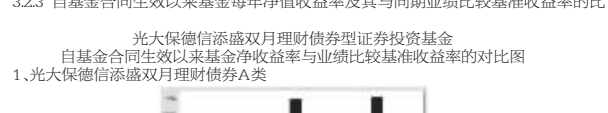
注:2)本基金利润分配是按月份结转的。
3.2 基金净值表现
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
光大保德信添盛双月理财债券A类



光大保德信添盛双月理财债券B类
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9月6日至2014年11月20日)



注: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9月6日,本基金已于基金合同规定的期限内完成建仓并达到基金合同约定的投资比例。



注:本基金基金合同于2012年9月6日生效,合同生效当年净值收益率按实际存续期计算,未按一个自然年度折算。

光大保德信添盛双月理财债券A类
单位:人民币元

光大保德信添盛双月理财债券B类
单位:人民币元

注:本基金在报告年度内累计实现收益3,097,330.34元,以红利再投资方式结转入实收基金3,113,778.46元,计入应付收益科目-16,448.12元。

4.1 基金管理人及基金治理结构
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保德信投资管理

4.3 管理人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。

事后分析:对公平交易的事后分析主要集中在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)的收益差异进行分析,对连续四个季度期间内,不同时间窗(如日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合之间的同向交易的交易价差进行分析。

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
报告期内,本基金的异常交易行为符合基金合同及相关法律法规的要求,未发现异常交易行为。

4.4 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
2014年债券市场在经济企稳、货币政策适度结构性宽松、房地产周期性下行以及年初相对较高的收益率等因素的共同作用下,走出了一路上扬的市场行情。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现
本报告期内光大保德信添盛双月理财债券A份额净值增长率为4.0370%,业绩比较基准收益率为2.3400%;光大保德信添盛双月理财债券B份额净值增长率为4.2562%,业绩比较基准收益率为2.3400%。

4.4.3 基金管理人从业背景
本基金的基金经理具有多年证券从业经验,具备良好的专业背景和丰富的投资经验。

4.4.4 基金估值方法
本基金的估值方法符合《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》及基金管理人与托管人、光大保德信基金管理有限公司估值委员会工作制度进行。

4.4.5 基金费用
本报告期内,基金管理人按照基金合同的约定,合理收取基金费用。

4.4.6 基金销售
本报告期内,基金管理人积极开展基金销售工作,扩大基金规模。

4.4.7 基金收益分配
本报告期内,基金管理人按照基金合同的约定,进行基金收益分配。

4.4.8 基金风险管理
本报告期内,基金管理人严格按照法律法规的要求,有效管理基金风险。

4.4.9 基金信息披露
本报告期内,基金管理人按照法律法规的要求,及时披露基金信息。

4.4.10 基金其他重要事项
本报告期内,基金管理人无其他重大事项需要披露。

4.4.11 基金其他重要事项
本报告期内,基金管理人无其他重大事项需要披露。

4.4.12 基金其他重要事项
本报告期内,基金管理人无其他重大事项需要披露。

4.4.13 基金其他重要事项
本报告期内,基金管理人无其他重大事项需要披露。

4.4.14 基金其他重要事项
本报告期内,基金管理人无其他重大事项需要披露。

8.1 期末基金资产组合情况
单位:人民币元

期末基金资产组合情况表
项目 金额 占基金资产净值比例

8.2 债券回购融资情况
本报告期内,本基金未发生债券回购融资。

8.3 投资组合平均剩余期限基本情况
本报告期内,基金投资组合平均剩余期限符合基金合同的约定。

8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合
本报告期内,本基金持有的债券品种符合基金合同的约定。

8.5 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
本报告期内,本基金前十名债券投资明细如下。

8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离
本报告期内,基金资产净值的偏离度符合基金合同的约定。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细
本报告期内,本基金资产支持证券投资符合基金合同的约定。

8.8 投资组合报告附注
本报告期内,基金管理人无其他事项需要披露。

8.9 开放式基金份额变动
单位:份

开放式基金份额变动表
项目 单位:份

8.10 重大事件揭示
本报告期内,本基金未发生重大事件。

10.1 基金份额持有人大会决议
本报告期内,本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的重大人事变动
本报告期内,基金管理人、基金托管人、基金销售机构均未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼
本报告期内,本基金未涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变
本报告期内,本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况
本报告期内,本基金未发生会计师事务所变更。

10.6 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,基金管理人、托管人及其高级管理人员均未受稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况
本报告期内,本基金租用证券公司交易单元符合基金合同的约定。

7.4.8.4 关联方投资本基金的情况
7.4.8.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

关联方投资本基金的情况表
项目 2014年1月1日至2014年11月20日 2014年12月31日 2013年12月31日

注:“期间申购/买入总份额”中为基金转入、红利再投资份额之和,本期红利再投资份额214,200,331份。

7.4.8.2 报告期期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况
本基金本期及上年度末无除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.8.5 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

关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入表
项目 2014年1月1日至2014年11月20日 2014年12月31日 2013年12月31日

注:1. 本基金的活期银行存款由基金托管人交通银行保管,按银行同业利率计息。
2. 当期利息收入含存放于基金托管人交通银行的协议存款利息收入。

7.4.9 期末及上年度末本基金持有的流通受限证券
7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

8.1 期末基金资产组合情况
单位:人民币元

期末基金资产组合情况表
项目 金额 占基金资产净值比例

8.2 债券回购融资情况
本报告期内,本基金未发生债券回购融资。

8.3 投资组合平均剩余期限基本情况
本报告期内,基金投资组合平均剩余期限符合基金合同的约定。

8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合
本报告期内,本基金持有的债券品种符合基金合同的约定。

8.5 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
本报告期内,本基金前十名债券投资明细如下。

8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离
本报告期内,基金资产净值的偏离度符合基金合同的约定。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细
本报告期内,本基金资产支持证券投资符合基金合同的约定。

8.8 投资组合报告附注
本报告期内,基金管理人无其他事项需要披露。

8.9 开放式基金份额变动
单位:份

8.10 重大事件揭示
本报告期内,本基金未发生重大事件。

10.1 基金份额持有人大会决议
本报告期内,本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的重大人事变动
本报告期内,基金管理人、基金托管人、基金销售机构均未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼
本报告期内,本基金未涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变
本报告期内,本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况
本报告期内,本基金未发生会计师事务所变更。

10.6 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,基金管理人、托管人及其高级管理人员均未受稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况
本报告期内,本基金租用证券公司交易单元符合基金合同的约定。