

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：二〇一二年三月二十九日

重要提示

基金管理人的董事会、董事会在报告编制前未将本报告未在虚假记载、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责任。本基金报告已由三分之二以上独立董事签字同意。

基金财产净值是指建设银行股份有限公司根据基金合同规定，于2012年3月28日复核了本报告中的财务状况、表现、资产分布情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告期净值、净值增长率、年度报告正文、投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期财务数据未经审计。安永华明会计师事务所为本基金财务出具了2011年度无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2011年1月1日起至2012年3月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	光大保德信增利收益债券基金
交易代码	360008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年10月29日
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
报告期期末基金份额总额	234,807,649.31份
报告期基金净值	-不适用
下属分级基金的基金简称	光大保德信增利收益债券A
下属分级基金的交易代码	360008
报告期期末下属分级基金的份额总额	173,604,905.47份
61,202,743.84份	

2.2 基金产品说明

本基金主要投资债券类投资工具，在获取基金资产稳定增值的基础上，争取获得高于基金行业平均水平的基本收益。

本基金将在锁定的投资范围内，根据国家的政策和财政政策实施情况，市场收益率曲线变动情况，市场流动性情况来预测债券市场价格走势，平衡利率差价，同时结合各具特色的品种的供需情况，流动性、信用状况和利差情况，通过积极的资产配置，调整债券投资组合，在非债券品种投资方面，本基金将充分发挥机构投资者在股票投资方面的积极作用，积极参股与新股发行、增发新股（新股申购）的申购，申购和配售，在严格控制风险的前提下，提高高基金回报率。

本基金将重点关注债券市场的低风险品种，其预期收益率和风险均低于货币基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	光大保德信基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
姓名	伍文静	尹东
信息披露负责人	联系电话：021-3307-700-3105 电子邮件：epfservice@epf.com.cn	010-67595003 zhonglin.dz@cbank.com
客户服务电话	400-820-2888, 021-53524620	010-67595096
传真	021-63351152	010-66275853

2.4 信息披露方式

www.epf.com.cn
光大保德信基金管理公司、中国建设银行股份有限公司的办公场所。

基金年度报告备置地点

本公司住所地。

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

单位：人民币元

3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 期间数据

光大保德信增利收益A
光大保德信增利收益C
光大保德信增利收益A
光大保德信增利收益C

2010年 2009年

7,293,087.93 2,588,979.98 18,475,900.39 4,143,314.00

5,454,491.10 4,457,287.39

0.0291 0.0263

0.0886 0.0788

0.0027 -0.0300

3.57% 2.87%

9.11% 8.62%

1.86% 1.57%

2011年 2009年

6,720,581.83 1,609,306.64

18,617,834.73 3,816,031.91

588,114.49 -7,830,812.05

3.1.2 期末数

光大保德信增利收益A
光大保德信增利收益C
光大保德信增利收益A
光大保德信增利收益C

2010年末 2009年末

3.57% 2.87%

9.11% 8.62%

1.86% 1.57%

3.1.3 本期数

光大保德信增利收益A
光大保德信增利收益C
光大保德信增利收益A
光大保德信增利收益C

0.0030 0.0023

0.0621 0.0595

0.0304 0.0262

5.1 报告期内本基金托管人遵纪守法情况

5.2 报告期内本基金托管人对基金日常运作是否尽职尽责的说明

5.3 报告期内本基金托管人对基金财务报告、中期报告等临时公告的披露情况

5.4 报告期内本基金托管人对基金年度报告的披露情况

5.5 报告期内本基金托管人对基金利润分配的披露情况

5.6 报告期内本基金托管人对基金费用计提、支付和摊销情况的说明

5.7 报告期内本基金托管人对基金收益分配的披露情况

5.8 报告期内本基金托管人对基金费用税率、费用税扣缴情况的说明

5.9 报告期内本基金托管人对基金估值方法及其变更、核算的频率的说明

5.10 报告期内本基金托管人对基金收益分配政策的说明

5.11 报告期内本基金托管人对基金信息披露事务管理的说明

5.12 报告期内本基金托管人对基金风险监控的说明

5.13 报告期内本基金托管人对基金投资组合的说明

5.14 报告期内本基金托管人对基金业绩表现的说明

5.15 报告期内本基金托管人对基金客户服务的说明

5.16 报告期内本基金托管人对其他重要事项的说明

5.17 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.18 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.19 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.20 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.21 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.22 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.23 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.24 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.25 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.26 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.27 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.28 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.29 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.30 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.31 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.32 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.33 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.34 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.35 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.36 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.37 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.38 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.39 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.40 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.41 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.42 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.43 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.44 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.45 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.46 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.47 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.48 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.49 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.50 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.51 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.52 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.53 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.54 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.55 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.56 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.57 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.58 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.59 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.60 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.61 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.62 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.63 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.64 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.65 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.66 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.67 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.68 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.69 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.70 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.71 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.72 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.73 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.74 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.75 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.76 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.77 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.78 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.79 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.80 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明

5.81 报告期内本基金托管人对基金年度报告的说明