

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:二〇一三年三月二十六日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员和基金经理等人员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的法律责任。本基金报告已由三分之二以上独立董事签字确认。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年3月26日复核了本报表中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金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及其摘要。

本年度报告摘要自年度报告正文发布之日起，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告中财务资料已经审计，安永华明会计师事务所为本基金财务出具了2012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2012年1月1日起至2012年12月31日止。

## § 2 基金简介

| 基金简称            | 光大保德信增利收益债券     |
|-----------------|-----------------|
| 交易代码            | 360008          |
| 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     | 185,885,093.42份 |
| 基金合同存续期         | 不定期             |
| 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          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 129,736,582.09份 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 56,148,511.33份  |

## 2.1 基金基本情况

| 基金简称            | 光大保德信增利收益债券     |
|-----------------|-----------------|
| 交易代码            | 360008          |
| 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     | 185,885,093.42份 |
| 基金合同存续期         | 不定期             |
| 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          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 129,736,582.09份 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 56,148,511.33份  |

## 2.2 基金产品说明

投资目标 本基金主要投资于债券类投资工具，在获取基金资产稳定增值的基础上，争取获得高于行业基准的绝对收益。

本基金将在规定的投资范围内，积极运用国家政策和财政政策实施情况、市场价格走势变化来预测货币市场整体利率趋勢，同时结合具体品种的供需情况、流动性、信用状况和利率敏感度等因素进行综合分析，在严格控制风险的前提下，构建和调整投资组合，力争在非债券类投资品种上，本基金将充分发挥专业优势，积极配置，提升基金整体投资回报。

投资策略 本基金将综合运用多种分析方法：在宏观经济形势分析、对不同投资组合的相对收益进行分析，对三个季度内，不同的投资组合的收益率差异进行分析。特别的，对同一投资组合经理管理的不同投资组合之间的向同向交易及反向交易进行分析。特别地，若发现异常交易行为，则及时进行核查并在向中国证监会报送的定期报告中披露核查结果和分析报告。对做市商专用账户，将定期与做市商进行沟通，了解其买卖情况，对异常交易行为，及时进行监控和处理。

业绩比较基准 中债指数全价指数

风险收益特征 本基金为债券型基金，属于二级债券投资基金，其预期收益率和风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

## 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 范晋青

信息披露负责人 邱晓 021-33740740-1105 010-67595096

电子邮箱 eepservice@fpfund.com.cn tianjing.l@chcb.com

客户服务电话 400-820-2888, 021-53524620 010-67595096

传真 021-63351152 010-66725853

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网网址: www.fpfund.com

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的公司网站。

## 3.1 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

| 3.1.1期间数据    | 2012年         | 2011年        | 2010年        |
|--------------|---------------|--------------|--------------|
| 光大保德信增利收益债券A | 光大保德信增利收益债券A  | 光大保德信增利收益债券A | 光大保德信增利收益债券C |
| 报告期已实现收益     | 10,457,601.10 | 3,962,125.23 | 7,293,087.93 |
| 2,588,979.98 | 18,745,960.39 | 4,141,814.00 |              |
| 本期利润         | 11,544,703.88 | 4,921,037.55 | 4,720,581.83 |
| 1,609,306.64 | 18,617,834.73 | 3,816,031.91 |              |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0715        | 0.0762       | 0.0291       |
| 期末可供分配利润     | 7.625%        | 7.21%        | 3.57%        |
| 2012年末       | 2011年末        | 2010年末       |              |
| 份额净值         | 1.0298        | 1.0115       | 1.0204       |
| 本期利润         | 2.58%         | 0.11%        | 1.11%        |
| 报告期利润        | 2.60%         | 0.12%        | 4.03%        |
| 期末可供分配利润     | 21.62%        | 0.18%        | 10.13%       |
| 当年净值增长率      | 26.36%        | 0.17%        | 13.24%       |

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(减去必要的费用后的余额)扣除年初至今的费用后的余额。

②所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

③期间可供利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1基金净值增长值率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

光大保德信增利收益债券A:

光大保德信增利收益债券C:

光大保德信增利收益债券:

光大保德信增利收益债券: