光大保德信添盛双月理财债券型证券投资基金

2013 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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年三月三十一日

§1重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年3月28日复核了本报告中的财务指标、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更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计,普华永道中天会计师事务所为本基金财务出具了2013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2013年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	光大保德信添盛双月理财债券	
交易代码	360021	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年9月5日	
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	
报告期末基金份额总额	105,900,641.12份	
下属分级基金的基金简称	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
下属分级基金的交易代码	360021	360022
报告期末下属分级基金的份额总额	94,891,822.14份	11,008,818.98份

2.2基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于银行存款等投资标的,力争获得超过人民币3个月银行定期存款利率(税后)的投资回报。
投资策略	本基金将综合考虑各类投资品种的收益和风险特征,在保证基金资产安全性的基础上力争为投资人创造稳定的收益。同时,本基金将关注宏观经济走势、货币政策和财政政策的变化,结合对货币市场利率变动的预期,对投资组合进行管理。银行存款一般具有收益稳定、风险低等基本特征,特别是机构投资者在投资银行存款时,往往能获得比普通投资者更高的收益率。本基金资产可以投资于上市商业银行、大型商业银行、国有商业银行、股份制商业银行、城市商业银行、邮政储蓄银行、农村商业银行、外资银行中具有证券投资基金托管人资格、证券投资基金代销业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的商业银行的协议存款。若本基金投资的协议存款中未约定可提前支取并无利息损失的,则该笔存款的到期日不得晚于该运作周期的第一个开放日。本基金在投资银行存款时将对不同银行的银行存款收益率做深入的分析。同时结合各银行的信用等级、存款期限等因素的研究,综合考量整体利率市场环境及其变动趋势,在严格控制风险的前提下决定各银行存款的投资比例。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为人民币3个月银行定期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的风险较低的品种,其预期收益和预期风险低于普通债券型基金、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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐蓉	裴学敏
	联系电话	021-33074700-3110	95559
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	peixm@bankcomm.com
客户服务电话		400-820-2888,021-53524620	95559
传真		021-63351152	021-62701216

2.4信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.epf.com.cn
基金年度报告备置地点	光大保德信基金管理有限公司、交通银行股份有限公司的办公场所。

§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

金额单位:人民币元

3.1.1期间数据和指标	2013年		2012年9月5日(基金合同生效日)至2012年12月31日	
	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	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
本期已实现收益	2,395,193.13	797,284.14	4,496,534.46	1,156,734.69
本期利润	2,395,193.13	797,284.14	4,496,534.46	1,156,734.69
本期基金份额净值收益率	3.9940%	4.2396%	1.0264%	1.1026%
3.1.2期末数据和指标	2013年末		2012年末	
	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	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
期末基金资产净值	94,891,822.14	11,008,818.98	89,975,582.19	25,260,981.49
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3累计期末指标	2013年末		2012年末	
	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	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
基金份额累计净值收益率	5.0613%	5.3890%	1.0264%	1.1026%

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

(2)本基金利润分配是按日结转份额。

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

1. 光大保德信添盛双月理财债券A类

3.1.1期间数据和指标	份额净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.3617%	0.0017%	0.6644%	0.0000%	0.6973%	0.0017%
过去六个月	2.4287%	0.0028%	1.3289%	0.0000%	1.0998%	0.0028%
过去一年	3.9940%	0.0032%	2.6361%	0.0000%	1.3579%	0.0032%
自基金合同生效起至今	5.0613%	0.0030%	3.4883%	0.0000%	1.5730%	0.0030%

2. 光大保德信添盛双月理财债券B类

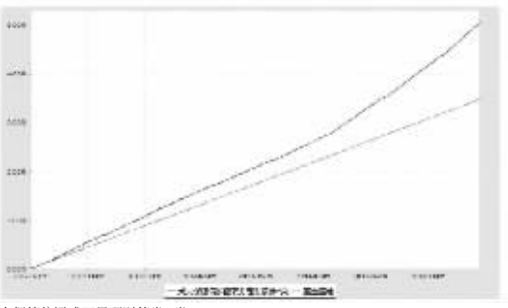
阶段	份额净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.4221%	0.0017%	0.6644%	0.0000%	0.7577%	0.0017%
过去六个月	2.5503%	0.0028%	1.3289%	0.0000%	1.2214%	0.0028%
过去一年	4.2396%	0.0032%	2.6361%	0.0000%	1.6035%	0.0032%
自基金合同生效起至今	5.3890%	0.0030%	3.4883%	0.0000%	1.9007%	0.0030%

注:基金收益的分配是按日结转份额的。

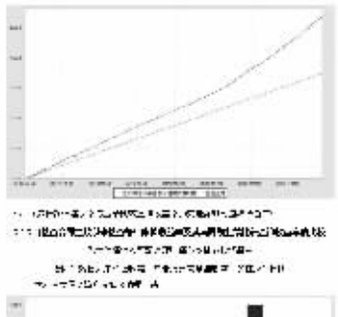
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

光大保德信添盛双月理财债券型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年9月5日至2013年12月31日)

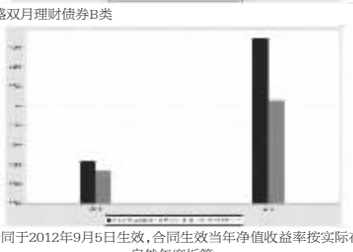
1、光大保德信添盛双月理财债券A类
(2012年9月5日至2013年12月31日)



2、光大保德信添盛双月理财债券B类
(2012年9月5日至2013年12月31日)



2、光大保德信添盛双月理财债券B类



注:本基金基金合同于2012年9月5日生效,合同生效当年净值收益率按实际存续期计算,未按整个自然年度折算。

3.3自基金合同生效以来基金的利润分配情况

1、光大保德信添盛双月理财债券A类

单位:人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2013	2,387,569.04	-	7,624.09	2,395,193.13	-
2012	4,488,774.48	-	7,759.98	4,496,534.46	-
合计	6,876,343.52	-	15,384.07	6,891,727.59	-

2、光大保德信添盛双月理财债券B类

单位:人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2013	797,771.28	-	-487.14	797,284.14	-
2012	1,154,390.41	-	2,344.28	1,156,734.69	-
合计	1,952,161.69	-	1,857.14	1,954,018.83	-

注:本基金在本年度累计分配收益3,192,477.27元,以红利再投资方式结转入实收基金3,185,340.32元,计入应付收益科目7,136.95元。

§4管理人报告

4.1基金管理人及基金经理情况

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的保德信投资管理有限公司共同创建,公司总部设在上海,注册资本为人民币1.6亿元人民币,两家股东分别持有55%和45%的股份。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务(涉及行政许可的凭许可证经营),今后,将在法律法规允许的范围内为各类投资者提供更多资产管理服务。

截至2013年12月31日,光大保德信旗下管理着15只开放式基金,即光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信货币市场基金、光大保德信红利股票型证券投资基金、光大保德信新增长股票型证券投资基金、光大保德信优势配置股票型证券投资基金、光大保德信增利收益债券型证券投资基金、光大保德信均衡精选股票型证券投资基金、光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信中小盘股票型证券投资基金、光大保德信信用添益债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金、光大保德信添盛双月理财债券型证券投资基金、光大保德信添天盈季度理财债券型证券投资基金和光大保德信现金宝货币市场基金。

4.1.2基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
韩爱丽	基金经理	2012-09-05	-	6年	韩爱丽女士,复旦大学经济学硕士,CFA。2006年7月至2010年8月在上海浦东发展银行总行资金部从事固定收益交易、研究工作;2010年8月加盟光大保德信基金管理有限公司,任高级债券研究员,现任光大保德信货币市场基金基金经理、光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金基金经理、光大保德信添盛双月理财债券型证券投资基金基金经理、光大保德信添益双月理财债券型证券投资基金基金经理、光大保德信现金宝货币市场基金基金经理。

注:对基金的首任基金经理,其任职日期指基金合同生效日,离任日期指公司做出决定之日;非首任基金经理,其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

4.2管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本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。报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3管理人对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。在投资管理活动中公平的对待公司管理包括开放式基金、特定客户资产管理组合在内的所有组合,范围包括股票、债券等所有投资品种,以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资活动,同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。实行事前控制、事中监控、事后分析的全过程控制,形成有效的公平交易体系。具体的控制方法包括:

事前控制:1、研究人员通过内部晨会、邮件和统一的研究报告平台系统发布投资建议,确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策等方面均享有平等机会;2、各个投资主体有明确的职责和权限划分,投资组合经理在权限范围内自主决策,不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离;3、建立规范的一级市场股票债券询价申购和配售等审批流程、银行间债券价格公允性审批流程;建立和定期维护二级市场投资对象备选库和银行间市场交易对手库。

事中监控:1、主动管理型的基金,严禁同一投资组合或不同投资组合在同一交易日进行股票的反向交易,严禁不同投资组合在同一交易日进行债券的反向交易,确有需要进行日内反向交易的,需要进行严格的审批流程;2、交易环节中所有指令严格按照"时间优先、价格优先"的原则执行指令,交易所指令均需通过恒生系统公平交易模块进行分发和委托下单。

事后分析:对公平交易的事后分析主要集中在对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)的收益率差异进行分析,对连续四个季度期间内、不同时间窗下(如日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。特别的,对同一投资组合经理管理的不同投资组合之间的同向交易和反向交易重点进行分析。若出现异常交易行为,则及时进行核查并在向中国证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

对于公平交易同向交易价差分析,具体的分析方法如下:第一步,在A组合买入或者卖出某只证券的当日(3日、5日)内,统计A组合在此期间的买入或者卖出该股票的均价,同时统计B组合在同期、同方向交易同一只证券的均价,然后比较两者的均价差异,其中买入溢价率 =(B组合交易均价/A组合交易均价-1),卖出溢价率 =(A组合交易均价/B组合交易均价-1);第二步,将发生的所有交易价差汇总进行T检验,置信区间95%,得到交易价差是否超正于0的判断结果,并计算A组合与B组合同向交易中占优次数的比例为占优比例,用溢价率乘以成交量较少方的成交量计算得到B组合对A组合溢价金额大小,将所有同向交易溢价金额求和,除以A组合平均资产净值来计算对A组合净值的影响,称为单位溢价率。判断同向交易价格是否有显著差异有以下四条标准:交易价差不趋向于零、样本数大于30、单位溢价率大于1%、占优比例不在45%-55%之间。

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

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金与其他投资组合未发生交易所公开竞价同日反向交易。

4.4管理人对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

2013年国内经济增长疲弱,出口放缓,投资回落。2014年1月,中国制造业采购经理指数(PMI)为50.5%,虽在临界点以上的扩张区间,但比上月回落0.5个百分点,而汇丰PMI为49.5%,半年内再次跌破枯荣线,表明国内中小企业景气状况进一步下滑。2013年GDP增速为7.7%,完成全年7.5%的目标值,但1-12月工业企业主营业务收入累计同比增长11.2%,和1-6月相比下降0.2个百分点,1-12月主营活动利润累计增长4%,和1-6月相比进一步下滑3.2个百分点,需求疲软、盈利恶化。从三驾马车看,消费低迷、出口小幅回落,投资跳水。12月我国固定资产投资累计同比增长19.6%,全年呈现下滑走势。消费数据也持续低迷,尽管下半年有所回升,但全年基本围绕13%左右波动。12月CPI环比上涨0.3%,同比上涨2.5%,略低于市场的预期,2013年全年CPI同比上涨2.6%。通胀有望在未来几个月保持2.5%左右的水平,呈现历史最为稳定的一段时期。进出口方面,上半年出口增速逐月走低,6月更是出现了-3.07%的负增长,尽管下半年有所恢复,但总体改善不大。政府对虚假贸易方面的整治结束了一季度的高增长态势,而海外方面,随着经济与就业的好转,美国酝酿QE退出计划,该预期直接导致资金大幅撤离新兴市场。表现为二季度以来外汇占款持续减少,6月甚至出现-412亿的净流出。与之对应的央行公开市场净投放,2季度总数为5330亿,但6月开始,银行间资金面持续紧张,7天回购利率一度飙升至11.62%。央行一反常态作壁上观,收益率曲线出现倒挂,整条曲线平坦化上移,短端利率飙升,一级市场停滞,二级市场大幅偏离估值,在流动性预期持续恶化的情况下,部分机构开始在银行间市场套利。下半年央行调控以短期化、精细化操作为主,资金始终维持紧平衡,进入四季度叠加传统年末以及春节因素,短期利率再次上冲。在银行间流动性偏紧张的情况下,债券市场特别是利率债的供给过于充分,债券收益率快速上升。同业存款方面,4季度进入年底阶段,价格再次上行。特别是跨元旦和跨春节因素明显,银行报价呈现脉冲式上涨。在基金的日常操作中,按照契约要求,添盛基金主要投资于银行协议存款和银行间质押式回购,我们通过扩大交易对手范围、多方询价来提高组合的收益。

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3.9940%,业绩比较基准收益率为2.6361%;光大保德信添盛双月理财债券B份额净值增长率为4.2396%,业绩比较基准收益率为2.6361%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2014年1季度,无论从宏观还是从微观角度,内需增长依然乏力,工业企业利润累计增速还难见有明显改善,这预示着未来国内经济增速疲弱的趋势仍然持续,宏观政策将以调结构为主,2014年通胀将会温和盘整,不会有超预期的上行。资金面上,在对未来长期流动性的政策或变局均不明确的情况下,央行更倾向于将流动性调控工具向短期化方向倾斜,给自己留下操作空间。在整体数量上基本能做到中性,但是短期工具的释放存在一定的滞后性,特别是在长期利率高企的状况下,机构对流动性的担心会减少市场活跃度,表现在资金层面就是中性偏紧。在此背景下,添盛基金在兼顾收益性、流动性的前提下,会适时调整信用债的投资比例。操作上把平衡性作为第一位,谨慎投资,力求在投资标的种类、比例方面做到平衡和风险的可控。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金的估值业务严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》及监管机关有关规定和《光大保德信基金管理有限公司基金估值委员会工作制度》进行。日常估值由基金管理人和本基金托管人一同进行,基金份额净值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计的财务核对同时进行。

报告期内,公司设立由公司负责后台运营的高管、运营部代表(包括基金会计)、监察稽核部代表、投研部门代表、IT部代表以及金融工程业务代表人员组成的估值委员会。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序,选择基金估值模型及估值模型假设,定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督 。基金估值政策的议定和修改采用集体决策机制,对需采用特别估值程序的证券,基金管理人及时启动特别估值程序,由公司估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行、审计师沟通后由运营部具体执行。

公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和长期相关工作经历,并具有广泛的代表性,成员包括监察稽核代表1人、研究团队代表1人、基金经理代表2人、金融工程代表1人、运营部代表3人、与估值相关的IT工程师1人、公司分管后台运营的高管1人。估值委员会中的投研人员比例不超过三分之一。

公司估值委员会对各相关部门和代表人员的分工如下:投资研究部门和运营部共同负责关注相关投资品种的动态,评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种;运营部根据估值的专业技术对需要进行估值政策调整的品种提出初步意见提交估值委员会讨论,负责就估值政策调整的合规事宜与监察稽核部协商,负责执行基金估值政策进行日常估值业务并定期审核估值政策和程序的一致性,负责与托管行、审计师、基金同业、监管机关沟通估值调整事项;监察稽核部就估值程序、方法的合法合规发表意见;金融工程负责估值政策调整对投资绩效的评估;IT部就估值政策调整的技术实现进行评估。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突;截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及招募说明书(更新)等有关规定,本基金每日将基金净收益分配给基金份额持有人,并按自然月结转为相应的基金份额。

§5托管人报告

5.1报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2013年度,基金托管人在光大保德信添盛双月理财债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2013年度,光大保德信基金管理有限公司在光大保德信添盛双月理财债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配,符合基金合同的规定。

5.3托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2013年度,由光大保德信基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关光大保德信添盛双月理财债券型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6审计报告

本基金指定的会计师事务所普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)及其注册会计师汪棣 傅琛慧对本基金2013年度财务会计报告进行了审计,并于2013年3月25日为本基金出具了无保留意见的审计报告,审计报告文号为普华永道中天审字(2014)第20166号,投资者可通过年度报告正文查看审计报告正文。

§7年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:光大保德信添盛双月理财债券型证券投资基金

报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

姓名	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产:		
银行存款	63,061,920.96	94,985,072.36
结算备付金	216,666.67	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	-	-
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	42,000,263.00	20,000,150.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	743,805.04	507,499.49
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	106,022,655.67	115,492,721.85
负债和所有者权益	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	22,427.17	24,366.94
应付托管费	7,176.70	7,797.42
应付销售服务费	20,189.22	19,239.55
应付交易费用	480.25	150.00
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	17,241.21	10,104.26
递延所得税负债	-	-
其他负债	54,500.00	194,500.00
负债合计	122,014.55	256,158.17
所有者权益:		
实收基金	105,900,641.12	115,236,563.68
未分配利润	-	-
所有者权益合计	105,900,641.12	115,236,563.68
负债和所有者权益总计	106,022,655.67	115,492,721.85

注:报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额105,900,641.12份;其中A级基金份额总额94,891,822.14份,B级基金份额总额11,008,818.98份。

7.2利润表

会计主体:光大保德信添盛双月理财债券型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

姓名	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年9月5日(基金合同生效日)至2012年12月31日
一、收入	3,651,379.71	6,831,928.54
1.利息收入	3,651,379.71	6,831,928.54
其中:存款利息收入	2,578,847.81	6,749,407.18
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,072,531.90	82,521.36
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-	-
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-	-
减:二、费用	458,902.44	1,178,659.39
1.管理人报酬	186,375.40	457,196.55
2.托管费	60,581.56	154,251.28
3.销售服务费	140,834.48	371,252.06
4.交易费用	-	-
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	71,111.00	195,959.50
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	3,192,477.27	5,653,269.15
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列	3,192,477.27	5,653,269.15

7.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:光大保德信添盛双月理财债券型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	115,236,563.68	-	115,236,563.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,192,477.27	3,192,477.27
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-9,335,922.56	-	-9,335,922.56
其中:1.基金申购款	295,403,164.68	-	295,403,164.68
2.基金赎回款	-304,739,087.24	-	-304,739,087.24
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-3,192,477.27	-3,192,477.27
五、期末所有者权益(基金净值)	105,900,641.12	-	105,900,641.12
项目	上年度可比期间 2012年9月5日(基金合同生效日)至2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3,443,822,310.62	-	3,443,822,310.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,653,269.15	5,653,269.15
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-3,328,585,746.94	-	-3,328,585,746.94
其中:1.基金申购款	58,878,274.91	-	58,878,274.91
2.基金赎回款	-3,387,464,021.85	-	-3,387,464,021.85
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-5,653,269.15	-5,653,269.15
五、期末所有者权益(基金净值)	115,236,563.68	-	115,236,563.68

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码(序号)从7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:林昌,主管会计工作负责人:梅雷军,会计机构负责人:王永万

7.4报表附注

7.4.1基金基本情况

光大保德信添盛双月理财债券型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2012] 1071号《关于核准光大保德信添盛双月理财债券型证券投资基金募集的批复》核准,由光大保德信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《光大保德信添盛双月理财债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集3,443,462,391.11元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第342号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《光大保德信添盛双月理财债券型证券投资基金基金合同》于2012年9月5日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为3,443,822,310.62份基金份额,其中认购资金利息折合359,919.51份基金份额。本基金的基金管理人为光大保德信基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金根据投资者认(申)购本基金的金额,对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用,因此形成不同的基金份额等级。本基金设A 级和B 级两级基金份额,两级基金份额分别设置基金代码,并单独公布每万份基金净收益和7 日年化收益率。投资者可自行选择认(申)购的基金份额等级,不同基金份额等级之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《光大保德信添盛双月理财债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为现金、通知存款、短期融资券、1年及1年以内的银行定期存款、银行协议存款、大额存单、逆回购、剩余期限在397天以内(含397天)的债券、期限在1年以内(含1年)的债券回购、剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券及中期票据、期限在1年以内(含1年)的中央银行票据以及中国证监会、中国人民银行认可的其他货币市场工具。其中,本基金投资于银行存款的比例不低于基金资产的80%,其中银行存款包括银行通知存款、银行定期存款、银行协议存款和备付金存款。本基金在每个开放期之前10个工作日至开放期后10个工作日的期间,不受上述投资比例限制,但必须保持现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:3个月银行定期存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人光大保德信基金管理有限公司于2014年3月25日批准报出。

7.4.2会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则 - 基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《 光大保德信添盛双月理财债券型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2013年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2013年12月31日的财务状况以及2013年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税。

7.4.7关联方关系

项目	与本基金的关系
光大保德信基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司("交通银行")	基金托管人、基金代销机构
光大证券股份有限公司("光大证券")	基金管理人的股东、基金代销机构
保德信投资管理有限公司	基金管理人的股东

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.4债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年9月5日(基金合同生效日)至2012年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
光大证券	45,500,000.00	100.00%	-	-

7.4.8.1.5应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无支付关联方佣金。

7.4.8.2关联方报酬

7.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年9月5日(基金合同生效日)至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	186,375.40	457,196.55
其中:支付销售机构的客户维护费	98,576.28	240,612.04

注:支付基金管理人光大保德信基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

当出现巨额赎回时,为保护投资者利益,本基金管理人与基金托管人协商一致后,有权不计提巨额赎回日下一个工作日的管理费。

7.4.10.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年9月5日(基金合同生效日)至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	60,581.56	154,251.28

注:支付基金托管人交通银行的托