

基金托管人:中国建设银行股份有限公司 报告送出日期:二〇一六年三月二十八日

50691万亿条支流。 本年度报告編要編自年度报告正文,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2015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2015年1月1日起至12月31日止。

### 《2. 基金简介

基金简称		光大保德信岁末红利纯债债券			
基金主代码		000	489		
交易代码		000	489		
基金运作方式		契约型	开放式		
基金合同生效日		2014年8	3月12日		
基金管理人		光大保徳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			
报告期末基金份额总额		767,220,344.70份			
基金合同存续期		不定	不定期		
下属分级基金的基金简称		光大保徳信岁末红利纯债债券A	光大保徳信岁末红利纯债债券C		
下属分级基金的交易代码		000489	000490		
报告期末下属分级基金的份额总额		720,012,084.77份	47,208,259.93份		
2 基金产品说	<b></b>				
投资目标	本基金在控制 产的长期稳定	信用风险、谨慎投资的前提下,力争在8 增值。	<b>庆取持有期收益的同时</b> ,实现基金领		

3 基金管理人和基金托管

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

				217 1154 177 - > C
3.1.1期间数据和	201	<b>5年</b>	2014年8月12日 (基金合 31	
指标	光大保徳信岁末红利 纯债债券A	光大保徳信岁末红利 纯债债券C	光大保徳信岁末红利纯 债债券A	光大保徳信岁末红利纯 债债券C
本期已实现收益	31,945,228.36	4,328,666.68	13,409,799.71	3,320,261.70

3111935	光大保德信罗末红利 纯债债券A	光大保德信罗末红利 纯债债券C	光大保德信罗米红利纯 债债券A	光大保德信罗米红利知 债债券C
本期已实现收益	31,945,228.36	4,328,666.68	13,409,799.71	3,320,261.70
本期利润	44,558,775.53	6,363,590.40	9,125,393.93	3,077,999.49
加权平均基金份 額本期利润	0.0865	0.0857	0.0118	0.0171
本期基金份额净 值增长率	9.38%	8.83%	1.40%	1.28%
3.1.2期末数据和	2015	年末	2014	年末
指标	光大保徳信岁末红利 纯债债券A	光大保徳信岁末红利 纯债债券C	光大保德信岁末红利纯 债债券A	光大保德信岁末红利纯 债债券C
期末可供分配基 金份额利润	0.0052	0.0049	0.0075	0.0070
期末基金资产净 值	742,980,534.88	48,694,967.39	448,775,230.37	69,500,405.32
期末基金份额净 值	1.032	1.031	1.007	1.007

性 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。 (2)所这基金业缴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 所列数字。 (3)期末可供分配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。 (2)其余分值(据则

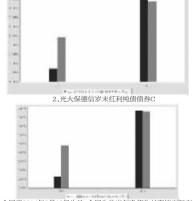
3.2 基金伊恒表现 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较 1. 光大保德信岁末红利炖债债券A:

	阶段	份额净值增长 率①	份额净值增长 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	10-33	2-4
	过去三个月	1.70%	0.07%	2.75%	0.07%	-1.05%	0.00%
	过去六个月	4.20%	0.07%	5.39%	0.07%	-1.19%	0.00%
	过去一年	9.38%	0.08%	8.74%	0.08%	0.64%	0.00%
	自基金合同生效 起至今	10.91%	0.13%	14.01%	0.10%	-3.10%	0.03%
2	<ul><li>光大保德信号</li></ul>	7末红利纯债·	债券C:				
	阶段	份额净值增长 率①	份額净值增长 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
	14 + - 1 A FI	A CUTO	o orași	O FIE O	o ome	4.4000	0.0000

(2014年8月12日至2015年12月31日) 1、光大保德信岁末红利纯债债券A



注:根据基金合同的规定,本基金建仓期为2014年8月12日至2015年2月11日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例应符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业统比较基础收益率的比较光保德信步术汇和域债债券型证券投资基金自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的住形对比图



注:本基金基金合同于2014年8月12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。

<ol> <li>3 以去二年</li> <li>光大保徳(</li> </ol>	F基金的利润分 言岁末红利纯(	部门有优 表债券A。			
() () () () ()	LD 712L715-01	V(1)V(7) 111			单位:人
年度	每10份基金份 额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015	0.694	42,776,882.64	7,191,956.12	49,968,838.76	-
2014	0.070	2,801,452.07	316,641.17	3,118,093.24	-
合计	0.764	45,578,334.71	7,508,597.29	53,086,932.00	-
光大保德	言岩末红利纯色	市债券C:			•

					单位:人	民币元
年度	每10份基金份 额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注	
2015	0.649	3,032,263.47	31,552.56	3,063,816.03	-	
2014	0.058	391,877.12	8,432.70	400,309.82	-	
合计	0.707	3,424,140.59	39,985.26	3,464,125.85	-	

(41) 基金管理人及基金经理情况。
4.1.1 基金管理人及基金经理情况。
4.1.1 基金管理人及基金经理情况。
4.1.1 基金管理人及基金经理情况。
4.1.1 基金管理人及基金经理情况。
4.1.1 基金管理人及基金经理情况。
4.1.1 基金管理人及基金经理情况。
6.1.2 以为"大保德信")成立于2004年4月,由中国光大集团挖胶的光大证券股份有限公司和美国保德信金编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产产管理股外。
截至2015年12月31日,光大保德信旗下管理着24只开放工基金,即光大保德信新增长混合型证券投资基金、光大保德信的货币市场基金、光大保德信证和混合型证券投资基金、光大保德信新增长混合型证券投资基金、光大保德信的发市场运活配置混合型证券投资基金、光大保德信等和证券投资基金、光大保德信用添益债券型证券投资基金、光大保德信可小总裁合型证券投资基金、光大保德信等企业系投资基金、光大保德信用添益债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动混合型证券投资基金、光大保德信商现金等金型证券投资基金、光大保德信报会直接人工作保险。
4.2 大保德信报金是在《北大保德信报金》是一个保德信报金是在《北大保德信报金》是一个保德信报金。第一个保德信报金是在《北大保德信报金》,大保德信报金是在《北大保德信报金》,大保德信报金是在《北大保德信报金》,大保德信报金是在《北大保德信报金》,大保德信服金是资产品配置混合型证券投资基金、光大保德信和能包设百一场经 412 其全经理(或其全经理小组)及其全经理助理的简介

基金企业,具任时日明和周任日期分增公司做旧校定之日。 42、曾里人对报告期内本基金运作奠现守信情态记的记明 本报告期内,本基金管理人—格修章(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,本考破实信用。勤勉尽责彻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

# 光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金

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

一四、JPLE。 风险点上,我们将密切关注以下几点:首先,2016年,重点在于财政政策。 积极的财政政策要加大力 ,而货币政策直径稳定宏观环境。结合汇率方面的制约,货币政策的执行在时间点和力度上都有可能会 于市场预朗,其次,通货膨胀方面,需要提防超预期的可能。再次,密切关注全球各类资产价格变化,以 战阻内容未古统的影响

及对国内资本市场的影响。 在操作上,岁末红利基金将会密切关注经济基本面、流动性和大类资产配置方向的变化,整体方向在 稳妥的基础上留有进攻的空间。常态下维持中低久坝和中等杠杆水平,严格轻制组合信用风险,严格规履 低评级品种,密切关注行业及个券信用状况。择时提升杠杆水平,争取通过参与利率做的阶段性行情来增

本报告期内未发生连续二十个上作日出现基金份额持有人数量不测二自人或者基金资产净值帐于五千万元的情形。

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况即,
在报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金同,托管的议和其他有关规定、不在报告基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。
5.2 托管人均提与期内本基金投资运作遵规守值。净值计算,利润分配零情况的说明本报告则,本托管人按照回家有关规定。基金合同,托管协议和其他有关规定。对本基金的基金资产净值计算,基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。
报告期内,本基金实施利润分配金额:光大保德信岁未红利她债债券为为49,968,838.76元,光大保德信岁东归种价债债券公30.63。1810.05元。

4. 括告规内,本基金实施利润分配金额:光大保德信岁未红利她债债券为为49,968,838.76元,光大保德信岁不知她债债券各为249。668,283.76元,光大保德自岁不是知他债债券公30.63。1810.05元。

5.3 托管人对本生度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见本托管人复核审查了本报告中的财务指标,净值表现,利润完整发表意见本托管人复核审查了本报告中的财务指标,净值表现,利润完整发表意见,对多会计报告,投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载,误导性疾还或者重大进漏。

本基金2015年年度财务会计报告已经普华永道中天会计师事务所审计,注册会计师签字出具了普华 永道中天审学(2016)第21326号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正义查看审计报告 全文。 《7 年度财务报表

7.1 页产贝顷农 会计主体:光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金 报告截止日:2015年12月31日

锁phs	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产:	-	_
银行存款	25,701,486.43	7,010,684.89
结算备付金	6,168,502.97	9,264,044.94
存出保证金	20,192.85	47,825.83
交易性金融资产	1,176,309,505.50	826,884,647.01
其中:股票投资	_	
基金投资	_	-
债券投资	1,176,309,505.50	826,884,647.01
资产支持证券投资	_	_
贵金属投资	_	
衍生金融资产	_	_
买人返售金融资产	23,000,000.00	_
应收证券清算款	-	36,093.21
应收利息	24,306,987.00	21,299,464.94
应收股利	_	-
应收申购款	20,071,733.95	900.00
递延所得税资产	_	
其他资产	_	_
资产总计	1,275,578,408.70	864,543,660.82
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014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	406,962,259.56	339,999,805.00
应付证券清算款	23,000,000.00	_
应付赎回款	8,620.57	1,799,944.60
应付管理人报酬	362,678.50	375,152.88
应付托管费	120,892.85	125,050.97
应付销售服务费	17,359.36	31,177.41
应付交易费用	30,240.15	25,834.09
应交税费	_	-
应付利息	65,200.58	187, 192.64
应付利润	53,032,654.79	3,518,403.06
递延所得税负债	_	_
其他负债	303,000.07	205,464.48
负债合计	483,902,906.43	346,268,025.13
所有者权益:		
实收基金	767,220,344.70	514,460,757.84
未分配利润	24,455,157.57	3,814,877.85
所有者权益合计	791,675,502.27	518,275,635.69
负债和所有者权益总计	1,275,578,408.70	864,543,660.82

3份,份额净值1.031元。	03,03,000 111 0,	
1.2 利润表	ひかいて 独却 かせ 人	
会计主体:光大保德信岁末红利纯债债 k报告期:2015年1月1日至2015年12月	券型业券投資基金 121日	
自位:人民币元	191	
项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31 日	上年度可比期间 2014年8月12日(基金合同生效 日)至2014年12月31日
一、收入	62,850,238.59	21,579,121.97
1.利息收入	49,446,502.68	27,069,175.18
其中:存款利息收入	263,620.22	6,338,431.75
债券利息收入	49,148,993.48	20,531,288.23
资产支持证券利息收入	-	-
买人返售金融资产收人	33,888.98	199,455.20
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-1,271,157.15	-1,040,517.72
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	_	-
债券投资收益	-1,271,157.15	-1,040,517.72
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
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)	14,648,470.89	-4,526,667.99
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	26,422.17	77,132.50
减:二、费用	11,927,872.66	9,375,728.55
1. 管理人报酬	3,836,289.15	2,224,835.84
2. 托管费	1,278,763.10	741,611.96
3. 销售服务费	319,988.78	283,153.09
4. 交易费用	58,249.90	18,027.04
5. 利息支出	6,075,001.62	5,885,059.11
其中:卖出回购金融资产支出	6,075,001.62	5,885,059.11
6. 其他费用	359,580.11	223,041.51
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	50,922,365.93	12,203,393.42
No. RECOURT ARE FOR		

四、净利润(净亏损以"-"号填列) 3 所有者权益(基金净值)变动表 会计主体:光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金 本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

项目	20	本期 15年1月1日至2015年12月31	B		
	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)	514,460,757.84	3,814,877.85	518,275,635.69		
二、本期经营活动产生的基金 净值变动数(本期利润)	-	50,922,365.93	50,922,365.93		
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)	252,759,586.86	22,750,568.58	275,510,155.44		
其中:1.基金申购款	1,769,106,220.85	122,580,099.29	1,891,686,320.14		
2.基金赎回款	-1,516,346,633.99	-99,829,530.71	-1,616,176,164.70		
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)	-	-53,032,654.79	-53,032,654.79		
五、期末所有者权益(基金净 值)	767,220,344.70	24,455,157.57	791,675,502.27		
项目	上年度可比期间 2014年8月12日(基金合同生效日)至2014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)	1,369,066,125.59	-	1,369,066,125.59		
二、本期经营活动产生的基金 净值变动数(本期利润)	-	12,203,393.42	12,203,393.42		
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)	-854,605,367.75	-4,870,11251	-859,475,480.26		
其中:1.基金申购款	699,473,318.07	14,030,900.43	713,504,218.50		
2.基金赎回款	-1,554,078,685.82	-18,901,012.94	-1,572,979,698.76		
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)	-	-3,518,403.06	-3,518,403.06		
五、期末所有者权益(基金净值)	514,460,757.84	3,814,877.85	518,275,635.69		

报表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:

基金管理人负责人: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 报表附在 7.4.1 基金基本情况 光大保德信岁末红利纯债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[2013]1526号(关于核准光大保德信岁东红利纯债债券型证券投资基金 筹集的附复》核准由光大保德信基金管理有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》和《光大保 德信岁末红利纯债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不 德司与水乱和地的应对组址对投资基金基金百间》以现公开海绵。本基金为实的至于成功。科学研究不 定,首次设立募集不包括抗网跨金和息其筹集1、368、3月2、48150万、业经普维未通中天会计师事务所待 殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第449号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《光大保德信岁 末红和地债债券型证券投资基金基金合同》于2014年8月12日正式生效,基金合同生效日的基金份额总 额为1、369、066、125.59份,其中认购资金利息折合153。644.09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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。 根据《光大保德信岁末红利地债债券型证券投资基金招募设明书》,本基金根据认购费,申购费和销 供服《光大保德信岁末红利地债债券型证券投资基金招募设明书》,本基金根据认购费,即费和销 供服《光生产业》和"基本经济之》,不是依然是一个社会类认规模的共享的特别。即费和销

根据《光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金招募的明书》,本基金根据认购费、申购费和销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取前端认购费或申购费的,然为公类基金份额。不收取前后端认购费或申购费。而从本类别压金资产中比最销售服务局。於为公类基金份额。A类、C类基金份额分别设置代码,分别计算和公告两类基金份额净值和两类基金份额累计净值。投资者可自行选择认购或申购基金份额类别,本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。根据《中华人民共和国证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具,包括国债,中央银行票据、中间票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、债券回购、次级债、资产支持证券、可分离交易可转换、中间票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、债券回购、次级债、资产支持证券、可分离交易明转换。中间债券的纯债部分,集行存款以及法律法规或监管部门允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场的新股申购或增发新股、可转日依经、有分司分离交易可转值的战酷部分。本基金投资产,也不参与一级市场的新股申购或增发新股、可转日依投资可分离交易可转值的收储部分。本基金投资产,也不参与一级市场的新股申购或增发新股、可转日仅投资可分离交易可转值的的债部分。本基金投资产,也不参与一级市场的新股申购或增发新股、可转日仅投资可分离交易可转值的的债部分。本基金的业绩比较基准为中证全债指数。

各項具体会计准则及相关规定以下合称"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以下简称"中国基金业协会") 颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金基金合同》 印在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操 海網制。 74.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明 本基金2015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2015年12月31日的

财务状况以及2015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。

知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息 红利差别化个人所得秘政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所 得税政策有关问题的通知》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

(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,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税

75.7 (1988) 15.3

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交易。 74821 基金管理费

本期 15年1月1日至2015年12月31日

注:支付基金管理人光大保總信基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.6%的年费率计提, 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 0.6% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

主:支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.2%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: 日托管费=前一日基金资产净值 X 0.2% / 当年天数。 7.4.8.2.3 销售服务费

	本期 2015年1月1日至2015年12月31日			
获得销售服务费的各关联 方名称	当期	发生的基金应支付的销售服务费		
77-1397	光大保徳信岁末红利纯债债券 A	光大保德信岁末红利纯债债券C	合计	
光大保徳信	-	206,547.61	206,547.61	
光大证券	-	486.16	486.16	
建设银行	-	95,974.09	95,974.09	
合计	-	303,007.86	303,007.86	
	上年度可比期间 2014年8月12日 ( 基金合同生效日 ) 至2014年12月31日			
获得销售服务费的各关联 方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费			
77-139	光大保德信岁末红利纯债债券 A	光大保德信岁末红利纯债债券C	合计	
光大证券	-	5.20	5.20	
	-	272,251.59	272,251.59	
建设银行				

放举订竞,该口系订至每月月底,按万支勺培元大保镖信基金公司,再田元大保 合各基金销售机构。A类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为: 日销售服务费=前一日C类基金份额基金资产净值 X 0.4% / 当年天数。 74.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债务(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况 7.48.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本期 2015年1月1日至2015年12月31日 期末余額 当期利息收入 期末余額 当期利息收入 注:本基金的活期存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。7.4.8.6 本基金在承销

本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本版上到这上一层。让人随时间几亿不再到的学家一次形式净和证式 7.48.7 其他关联交易事项的说明 本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。 7.4.9 期末(2015年12月31日)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

金额单位:人民币元 
 证券
 成功
 可流
 流通受
 认购
 期末估

 代码
 名称
 认购日
 通日
 限类型
 价格
 值单价
 136104 15市北 2015-12 2016-01 新发行 100.00 100.00 4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末无暂时停牕等流涌受限的股票

本基金45時人心由1079年子の心型文限的效果。 7.49.31 银行间市场债券正回购 载至本报告期来2015年12月31日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券 款余额226,962,259.56元,是以如下债券作为抵押:

041553009	15横店CP001	2016-01-04	101.12	70,000.00	7,078,400.00
041573008	15丹东港CP002	2016-01-04	100.44	300,000.00	30,132,000.00
101459016	14桑德MTN001	2016-01-04	104.62	200,000.00	20,924,000.00
101560001	15南通国投 MTN001	2016-01-04	106.71	200,000.00	21,342,000.00
101563015	15渝江北嘴 MTN003	2016-01-04	100.31	500,000.00	50,155,000.00
1380074	13西安高新债	2016-01-06	104.24	500,000.00	52,120,000.00
1380152	13烟开发债	2016-01-06	105.28	200,000.00	21,056,000.00
1280386	12绍城投债	2016-01-06	85.01	361,000.00	30,688,610.00
合计				2,331,000.00	233,496,010.00

概主年成古朔杰烈15年12月3日正广,本金亚州事证券之奶州低券正凹购文物形成的实面凹购证券 薪余额180,000,000.00 元,于2016年1月5日到期,该类交易要求本基金转入质押库的债券,按证券交易 所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。 74.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次

: 第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。 第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。 第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具 (i)各层次金融工具公允价值

层次的余额为0.00元,属于第二层次的余额为1,176,309,50550元,无属于第三层次的余额(2014 年12 月31日:第一层次175,043,661,60元,第二层次651,840,985.41元,无第三层次)。

于2015年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一

况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关债券的公允价值列人第一层次;并根据估值调整中采用的不可观整输入值对于从金属特殊的发生。 00、斗巷重不完了的呼日主义物%延60次日朔旧及义务小任6次朔旧将相关60券和公允101直90人弟一族 次;并根据信值赐整中采用的不可观察输入值对于公人价值的影响得度,确定相关债券令允允付值应属第 二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种可转换债券。资产支持证券和 从募储券除外,本基金于2015年3月30日起效为采用中央围债登记转算有根责任公司根据(中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准)所独立提供的估值结 里确定公允价值(附注7452) 并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第一层次 (iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

元。 (公]非持续的以公允价值计量的金融工具 于2015年12月31日,本基金末持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014年12月31日;同)。 (d)不以公允价值计量的金融工具 不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

01 期末其今资立组合桂汩

0.1 997/\2	经亚贝	) ALD HOL				金额单位:人戶	
序号	<u></u>	项目		金額		占基金总资产的比 例(%)	
1	权益	投资		_		-	
	其中	:股票		-		-	
2	固定	收益投资		1,176,309,505.50		92.22	
	其中	:债券		1,176,309,505.50		92.22	
	资产	支持证券		-		-	
3	贵金	属投资		-		-	
4	金融	衍生品投资		-		-	
5	买人	返售金融资产		23,000,000.00		1.80	
	其中	:买断式回购的买人返售金融资产		-		-	
6	银行	存款和结算备付金合计		31,869,989.40		2.50	
7	其他	各项资产		44,398,913.80		3.48	
0	AH			1 275 570 400 70		100.00	

8 合计 1,275,578,408.70 8.2 期末按行业分类的股票投资组合 本基金本报告期末未持有股票。 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细 本基金本报告期末未持有股票。 8.4 报告期内股票投资组合的直大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细 本基金本报告期末未持有股票。

8.4.2 平人股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

债券代码

13-13	収み方面付け	ZCTUTIEL	(%)					
1	国家债券	19,986,000.00	2.52					
2	央行票据	-	-					
3	金融债券	166,836,000.00	21.07					
	其中:政策性金融债	166,836,000.00	21.07					
4	企业债券	631,280,005.50	79.74					
5	企业短期融资券	40,244,000.00	5.08					
6	中期票据	225,452,000.00	28.48					
7	可转债	-	-					
8	其他	92,511,500.00	11.69					
9	合计	1,176,309,505.50	148.58					
6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细								

数量(张)

公允价值

50.375.000 15渝江北嘴 MTN003

期末按公允价值占基金资产净值比例 本基金本报告期末未持有资产支持证券。 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。 不確立少以下水分下的立地流 多。則末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细 本基金本报告期末未持有权证。 8.10 报告期末未基金投资的股精明货交易情况说明 8.10.1 报告期末本基金投资的股指明货产品损益明细

债券名称

本基金本报告期末未投资股指期货。 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策 本基金本报告期末未投资股指期货。

本基金本报告即来未投资股捐职债。 8.11报告原末本基金投资的国债期货交易情况说明 8.11.1 本期国债期货投资政策 基金管型人口运用国债期货、以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在国债期货投资中将根据风险管理的原则、以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与国债期货的投资,以管理投资组合的利率风险,改善组合的风险收益特性。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债明货。 8.12 投资组合报告附注 8.12.报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前

年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情形。 8.12.2本报告期内基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 本基金本报告期末未持有股票 § 9 基金份额持有人信息

本基金本报告期末未持有可转换债券。

单位:人民币元

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

持有份额 持有份额 486 1,481,506.38 694,681,779 25,330,305.6 3.529 9.2 期末基金管理人的从业人 、员持有本基金的情况

9.3期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

1,098,538,427. 本报告期期末基金份额总数

11.1基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。
11.2 基金管理人,基金托管人协专门基金托管部门的重大人事变动李常肯先生自2015年2月28日起担任本基金管理人督察长;自李常肯先生担任督察长职务之日起,陶耿先生不再代行督察长职务。经公司管理层批准及八届十九次董事会审议通过,自2015年11月11日起,张弛因个人原因正式离职。经公司八届二十一次董事会会议审议通过,自2016年3月3日起,陶耿先生正式离任公司总经理。由林昌先生代任公司总经理。本基金托管人2015年1月4日发布任免通知,聘任张力静为中国建设银行投资托管业务部副总经理。本基金托管人2015年9月18日发布任免通知,聘任张力静为中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

11.4 基金投资策略的改变 本报告期本基金投资策略无改变。 11.5为基金进行审计的会计师事务所情况 报告期内,本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所情况。报告年度应支付给聘任普华永道会计 等务所的根配是4万元,目前该审计机版已提供审计服务连续年限为2年。 11.6 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未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。 17.1 基本律用证金从司令包裹单元的在考情况

11.7 基金和用证券公司交易单元的有关情况 11.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况 金额单位:人民币元

		交易单 元数量	放帶父勿		应文的谈舞图	i			
	券商名称		成交金額	占当期股票 成交总额的 比例	佣金	占当期佣金 总量的比例	备注		
	安信证券	1	-	-	-	-	-		
	中金公司	1	_	-	-	-	-		
生:(1)报告期内租用证券公司交易单元变更情况									

(2)选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准 基金管理人选择证券经营机构,并选用其交易单元供本基金买卖证券专用,应本着安全、高效、低成本、能够为本基金提供高质量增值研究服务的原则,对该证券经营机构的经营情况、治理情况、研究实力

能够为本基金提供高质量增值射究服务的原则,对该业券经营机构 结介综合考量。 基本选择标准如下: ?实力雄厚,信誉良好,注册资本不少于3亿元人民币; ?财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定; ?经营行为规范,近两年未发生重大违规行为而受到证监会处罚;

7内部管理规范,严格,具备健全的内部控制制度,并能满足基金运作高度保密的要求 ?内部管理规范,严格,具备健全的内部控制制度,开能减止基金运作高度保密的要求,并能 为本基金提供全面的信息服务; ?研究实力较强,有固定的研究机构和专门的研究人员,能及时为本基金提供高质量的咨询服务; ?对于某一领域的研究实力超群,或是能够提供全方面,高质量的服务。 (3)选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序 ?投资研究团队按照(1)中列出的有关经营情况,治理情况的选择标准,对备选的证券经营机构进行

2对通过初洗的各证券经营机构,投资研究团队各成员在其分管行业或领域的范围内,对该机构所提

(水) 通过初处的对征证分还含40%,及60%,200%。 (水) 通过的研究报告和信息资讯进行评分。 "根据各成员评分,得出各证券经营机构的综合评分。 程设研究团队根据各机构的得分排名,我定要还据用其专用交易单元的证券经营机构。 董事会已做出决议,授权总经理依照公司对各券商的评价结果全权处理并决定公司旗下基金租用专

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

成交金額 占当期回购成 交总额的比例 成交金额 与当期权证成 交总额的比例

二〇一六年三月二十八日

(山)公允价值所属层次间的重大变动 对于证券交易所上市的债券,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情