光大保德信中小盘股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30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
报告送出日期:二〇一三年十月二十三日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2013年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	光大保德信中小盘股票
基金主代码	360012
交易代码	360012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年4月14日
报告期末基金份额总额	889,841,469.11份
投资目标	本基金通过深入挖掘具有高成长特性或者潜力的中小盘上市公司股票,以求获取基金资产的长期增值。
投资策略	本基金将通过对宏观经济基本面及证券市场双层面的数据进行研究,并通过定性定量分析、风险测算及组合优化,最终形成大类资产配置决策。本基金将主要投资于具备高成长特性或者潜力的中小盘上市公司股票以求获取高成长带来的资本增值回报,其中基金投资的股票资产中至少80%投资于中小盘股票。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为75%×中证700指数收益率+25%×中证全债指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于证券投资基金中预期收益和风险均较高的品种,其预期收益和风险高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	-24,053,515.57
2.本期利润	118,828,560.69
3.加权平均基金份额本期利润	0.1247
4.期末基金资产净值	892,186,376.01
5.期末基金份额净值	1.0026

注: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。上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字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	14.39%	1.30%	11.88%	1.04%	2.51%	0.26%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

光大保德信中小盘股票型证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2010年4月14日至2013年9月30日)

注:根据基金合同的规定,本基金建仓期为2010年4月14日至2010年10月13日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
戴奇雷	研究总监、本基金基金经理	2013-5-21	-	10年	戴奇雷先生,1995年毕业于华中理工大学生物医学工程专业,1998年获得华中理工大学生物技术专业硕士学位,2002年获得中欧国际工商学院工商管理专业硕士学位。2002年11月至2004年4月在上海融昌资产管理有限公司先后担任行业研究员、研究总监助理;2004年5月至2006年5月在广州金毅资产管理有限公司先后担任研究副总监、研究总监;2006年6月至2010年4月在诺德基金管理有限公司先后担任行业研究员、基金经理助理、投资研究部经理、基金经理;2010年5月加入光大保德信基金管理有限公司,先后担任研究副总监、研究总监。现任本基金基金经理兼研究总监。

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为充分保护持有人利益,确保本基金管理人旗下各基金在获得投研团队、交易团队支持等各方面得到公平对待,本基金管理人从投研制度设计、组织结构设计、工作流程制定、技术系统建设和完善、公平交易执行效果评估等各方面出发,建设形成了有效的公平交易执行体系。本报告期,本基金管理人各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,未发现存在违反公平交易原则的现象。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾本基金上期季报及中报,本基金认为下半年市场有望迎来一轮"挖坑"后的可操作行情。首先,代表传统经济的上市公司估值水平已经较低,其中的优秀企业有望在去产能过程中受益。其次,代表新兴经济的新兴成长型企业在经过充分洗礼后,新龙头和新蓝筹将逐渐浮出水面。最后,稳定增长的医药和食品饮料行业中,也存在可能因将进入快速成长期的细分行业和企业。

从实际情况来看,一方面,在肇始于去年8月的第二库存周期上升动力的作用下,三季度中国经济经历了一次阶段性见底回升的过程;另一方面,在上季度末市场出现一波创出本轮熊市新低的恐慌性快速杀跌,市场因之积聚了反弹动能。因此,我们看到进入三季度后,市场情绪逐渐恢复,并走出了一轮震荡上升行情,无论新兴成长,经典成长还是价值类股票都出现了一轮上涨。期间,7月至8月,周期及价值类股票一扫上半年的颓势,实现一轮逆袭,表现较好。进入9月,成长类股票再次延续年内良好表现。

本基金在二季度中期从仓位到结构都转向防御,有效规避了6月末的快速调整,为三季度的从容布局奠定基础。进入三季度后,本基金重点加大对成长类股票的投资。一方面,深入挖掘新兴成长中经历大浪淘沙后有可能成长为新龙头和新蓝筹的企业;另一方面,重点配置经典成长中公司治理完善、核心竞争力突出,或者细分行业中有望快速增长的企业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内份额净值增长率为14.39%,业绩比较基准收益率为11.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

短期来看,在第二库存周期上升阶段内生动力和政策面阶段性"兜底"外力的共同作用下,四季度经济将平稳增长,尽管增速可能有小幅降低,但2013年全年7.5%的经济增长目标应能顺利实现。不过,从更长一些时段来看,企业债务周期可能继续处于去杠杆阶段,并存在同十周期去产能共振向下的风险。总体来看,影响四季度股票市场的主要因素可能包括:三中全会改革预期,平台债重新起底的揭晓,美国财政预算僵局的破局以及QE缩减的兑现,第二库存周期上升阶段有望延续至明年2季度的预期。

在这些重要因素中,我们认为,改革预期将成为7月以来反弹延续的重要动力;外围因素如美国财政预算僵局及QE缩减兑现是验证改革预期成为国内股票市场主要矛盾的试金石;平台债重新起底的揭晓以及改革预期的阶段性兑现有可能成为市场调整的理由;第二库存周期上升极端的延续则将构成未来市场震荡下行时的反弹扰动项,并有助于适当缓解今年第四季度到明年第一季度间市场的系统性风险。

基于此,我们认为股票市场在四季度需要防范系统性风险的同时,依然需要继续着力于结构性投资机会的挖掘,重点包括两方面的机会:一是把握社会发展趋势,积极挖掘新兴成长中的新蓝筹和经典成长中的消费类优质企业;二是在改革真正深入推进的背景下,积极挖掘确实能够从制度性变革过程中中长期受益的品种。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	781,336,691.58	86.03
	其中:股票	781,336,691.58	86.03
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	40,000,260.00	4.40
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	82,834,823.36	9.12
6	其他各项资产	4,081,951.95	0.45
7	合计	908,253,726.89	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	348,564,587.46	39.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	23,759,223.84	2.66
F	批发和零售业	84,593,576.18	9.48
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	169,829,942.97	19.04
J	金融业	149,300.00	0.02
K	房地产业	68,333,128.63	7.66
L	租赁和商务服务业	366,500.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	907,890.00	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	81,823,447.17	9.17
R	文化、体育和娱乐业	3,009,095.33	0.34
S	综合	-	-
	合计	781,336,691.58	87.58

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300015	爱尔眼科	2,391,231	74,295,547.17	8.33
2	600637	百视通	1,390,000	72,766,500.00	8.16
3	300059	东方财富	3,390,000	72,647,700.00	8.14
4	600332	白云山	1,832,851	65,212,838.58	7.31
5	002646	青青稞酒	3,139,684	61,412,219.04	6.88
6	600649	城投控股	5,130,000	41,758,200.00	4.68
7	000831	五矿稀土	1,219,600	31,697,404.00	3.55
8	002262	恩华药业	880,924	25,872,737.88	2.90
9	000848	承德露露	880,000	25,528,800.00	2.86
10	601117	中国化学	2,999,902	23,759,223.84	2.66

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期内未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期内未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

报告期内本基金未投资资产支持证券。

5.7 报告期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。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为债券型基金,不参与股指期货交易。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本基金投资国债期货的投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂不参与国债期货交易。

5.9.2 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投资国债期货。

5.9.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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,在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.10.2 本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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	800,083.37
2	应收证券清算款	2,947,334.31
3	应收股利	-
4	应收利息	67,956.45
5	应收申购款	266,577.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,081,951.95

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	1,030,140,710.36
本报告期基金总申购份额	10,024,779.28
减:本报告期基金总赎回份额	150,324,020.53
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	889,841,469.11

§7 影响投资者决策的其他重要信息

无

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准光大保德信中小盘股票型证券投资基金设立的文件

2、光大保德信中小盘股票型证券投资基金基金合同

3、光大保德信中小盘股票型证券投资基金招募说明书

4、光大保德信中小盘股票型证券投资基金托管协议

5、光大保德信中小盘股票型证券投资基金法律意见书

6、基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程

7、基金托管人业务资格批件和营业执照

8、报告期内光大保德信中小盘股票型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

9、中国证监会要求的其他文件

8.2 存放地点

上海市延安东路222号外滩中心大厦46层本基金管理人办公地址。

8.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。 投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人。 客户服务中心电话:4008-202-888,021-53524620。 公司网址:www.epf.com.cn。

光大保德信基金管理有限公司
二〇一三年十月二十三日

宝盈增强收益债券型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

基金管理人:宝盈基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年十月二十三日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈增强收益债券	
基金主代码	213007	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年5月15日	
报告期末基金份额总额	678,874,091.82份	
投资目标	基于中国经济处于宏观变革期以及对资本市场未来持续、健康增长的预期,本基金在严格控制投资风险与保持资产流动性的前提下努力保持基金资产持续增值,并力争创造超越业绩基准的主动管理回报。	
投资策略	本基金基于对以下因素的判断,进行基金资产在固定收益品种、可转换债券、新股(含增发)申购以及二级市场股票投资之间的配置: ①基于对利率、信用等因素的分析,预测固定收益品种的风险和收益; ②可转换债券发行公司的成长性和转债价值的判断; ③基于对新股发行频率、中签率、上市后的平均涨幅等因素的分析,预测新股申购的风险和收益; ④股票市场走势的预测。	
业绩比较基准	中信标普全债指数	
风险收益特征	本基金是一只债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险较低收益品种,本基金的风险与预期收益都要低于股票型和混合型基金,高于货币市场基金。	
基金管理人	宝盈基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	宝盈增强收益债券A/B	宝盈增强收益债券C
下属两级基金的交易代码	213007(前端),213907(后端)	213917
报告期末下属两级基金的份额总额	580,744,235.32份	98,129,856.50份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)	
	宝盈增强收益债券A/B	宝盈增强收益债券C
1.本期已实现收益	3,138,901.47	1,186,245.95
2.本期利润	4,592,813.31	1,042,764.03
3.加权平均基金份额本期利润	0.0083	0.0049
4.期末基金资产净值	646,575,319.15	106,997,135.26
5.期末基金份额净值	1.1134	1.0904

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。

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、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字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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、宝盈增强收益债券A/B:

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	0.76%	0.04%	0.38%	0.04%	0.38%	0.00%

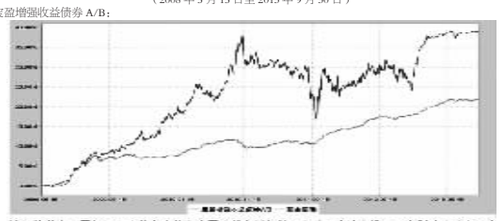
2、宝盈增强收益债券C:

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	0.66%	0.04%	0.38%	0.04%	0.28%	0.00%

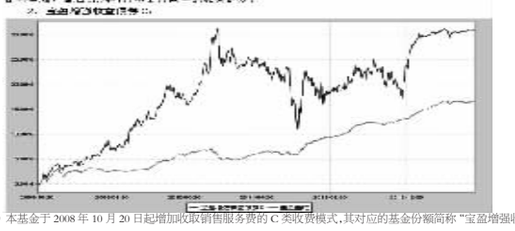
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

宝盈增强收益债券型证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2008年5月15日至2013年9月30日)

1. 宝盈增强收益债券A/B:



注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起的6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。



注:① 本基金于2008年10月20日起增加收取销售服务费的C类收费模式,其对应的基金份额简称"宝盈增强收益债券C"。

②按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起的6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈若劲	本基金基金经理、宝盈货币市场证券投资基金基金经理兼固定收益部总监	2008-9-2	-	10年	陈若劲女士,香港中文大学金融MBA。曾在第一创业证券有限责任公司固定收益部从事债券投资、研究及交易等工作,2008年4月加入宝盈基金管理有限公司任债券组合研究员。现同时担任宝盈货币市场证券投资基金基金经理、固定收益部总监。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同等有关基金法律文件的规定,以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金持有人谋求最大利益。在本报告期内,基金运作合法合规,无损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控,并定期制作公平交易分析报告,对不同投资组合的收益率、同向交易价差、同向交易价差作专项分析。报告结果表明,本基金在本报告期内的同向交易价差均在可合理解释范围之内;在本报告期内基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,在投资活动中公平对待不同投资组合,公平交易制度执行情况良好,无损害基金持有人利益的行为。

4.3.2 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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度末,我们认为货币政策仍将维持中性偏紧(尽管较6月会有所缓和),股份制银行为代表的金融机构去杠杆的进程刚刚开始,而且很大概率影响将向实体经济传导,对于债券市场和权益市场均偏谨慎。报告期内宏观经济实际运行情况基本略强于我们的预期,债券市场走势符合预期,而权益市场极端分化的持续性超出预期。

报告期内,"钱荒"引发市场对于资金中枢价格、合适杠杆比例的重新评估,债券收益率三季度一路飙升,上行趋势由短端向中长端、由利率债向信用债扩散。受资息品种带动,shibor浮息债点差也有一定程度上行。我们基本维持了一季度短久期高评级的配置思路,在临近季末适当增持部分浮息债提高组合收益。

报告期内,权益市场出现反弹,中小盘个股涨幅依然更加巨大。我们认为经过连续快速上行后,中小盘个股整体估值过高,而大盘股的投资机会尚需等待更好的时间窗口。因此,本报告期我们没有参与权益投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

增强收益A/B:本基金在本报告期内净值增长率是0.76%,同期业绩比较基准收益率是0.38%。

增强收益C:本基金在本报告期内净值增长率是0.66%,同期业绩比较基准收益率是0.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,我们预期经济增长或将弱于三季度,而通胀仍有上行压力,货币政策仍将维持中性,资金价格大概率将维持高位运行,临近年末时段资金仍有可能出现阶段性紧张。

我们对债券类资产配置维持谨慎乐观。我们认为经过持续调整之后,中短期限债券品种收益率已经上升至与回购利率和定期存款利率接近的水平,具备较强的配置价值,长期限品种票息的绝对值也较为可观,我们将在控制组合整体久期和信用风险的前提下积极参与。

我们对权益类资产配置也较为谨慎,短期经济增长乏力将制约大盘股的表现,而中小盘股估值过高,系统性风险不断积聚。我们将等待市场进一步的调整,择机选择基本面良好、符合国家产业政策的优质公司参与一二级市场的投资。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	879,151,554.50	80.59
	其中:债券	879,151,554.50	80.59
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	202,542,364.37	18.57
7	其他各项资产	9,166,498.01	0.84
8	合计	1,090,860,416.88	100.00

5.2 报告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。

5.3 报告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。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	269,012,000.00	35.70
	其中:政策性金融债	269,012,000.00	35.70
4	企业债券	409,820,554.50	54.38
5	企业短期融资券	200,319,000.00	26.58
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	879,151,554.50	116.66

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	126011	08石化债	720,000	70,884,000.00	9.41
2	122065	11上港01	700,000	69,986,000.00	9.29
3	126016	08宝钢债	700,000	67,977,000.00	9.02
4	041373001	13黔桂发电CP001	600,000	60,216,000.00	7.99
5	130214	13国开14	600,000	59,808,000.00	7.94

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期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。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为债券型基金,不参与股指期货交易。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本基金投资国债期货的投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂不参与国债期货交易。

5.9.2 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投资国债期货。

5.9.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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,在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.10.2 本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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	21,210.71
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,912,821.72
5	应收申购款	101,215.58
6	其他应收款	131,250.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,166,498.01

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.10.5 报告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。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	宝盈增强收益债券A/B	宝盈增强收益债券C
本报告期期初基金份额总额	500,974,055.61	113,984,944.34
本报告期基金总申购份额	103,382,304.01	277,969,407.46
减:本报告期基金总赎回份额	23,612,124.30	293,824,495.30
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	580,744,235.32	98,129,856.50

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本公司管理的基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

中国证监会关于核准宝盈增强收益债券型证券投资基金募集的文件。

《宝盈增强收益债券型证券投资基金基金合同》。

《宝盈增强收益债券型证券投资基金基金托管协议》。

宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。

本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。

8.2 存放地点

基金管理人办公地址:广东省深圳市深南大道6008号特区报业大厦15层

基金托管人办公地址:北京市西城区阜市口大街1号院1号楼

8.3 查阅方式

上述备查文件文本存放在基金管理人和基金托管人的办公场所,在办公时间内基金持有人可免费查阅。

宝盈基金管理有限公司
二〇一三年十月二十三日

光大保德信添天盈季度理财债券型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30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
报告送出日期:二〇一三年十月二十三日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	光大保德信添天盈季度理财债券
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年10月25日
报告期末基金份额总额	75,716,423.67份
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。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。
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
下属两级基金的基金简称	光大保德信添天盈理财债券A类	光大保德信添天盈理财债券B类
下属两级基金的交易代码	360019	360020
报告期末下属两级基金的份额总额	75,716,423.67份	-份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)	
	光大保德信添天盈理财债券A类	光大保德信添天盈理财债券B类
1.本期已实现收益	905,171.39	-
2.本期利润	905,171.39	-
3.期末基金资产净值	75,716,423.67	-

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,由于本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、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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. 光大保德信添天盈理财债券A类

阶段	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	1.0870%	0.0021%	0.6644%	0.0000%	0.4226%	0.0021%

注:基金收益的分配是按日结转份额的。

2. 光大保德信添天盈理财债券B类

阶段	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	-	-	-	-	-	-

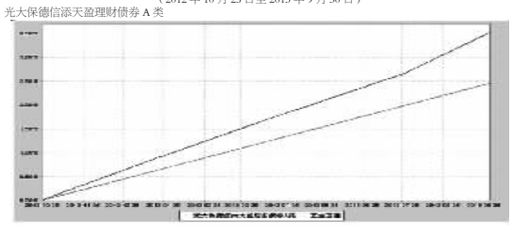
注:基金收益的分配是按日结转份额的。

B类基金份额于2013年4月25日全部赎回。

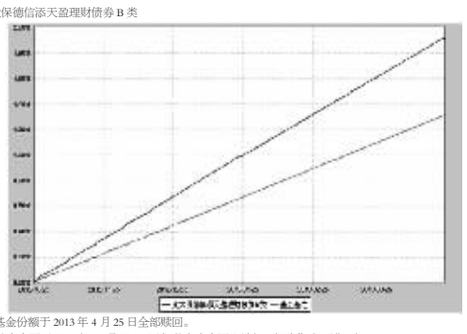
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

光大保德信添天盈季度理财债券型证券投资基金
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10月25日至2013年9月30日)

1、 光大保德信添天盈理财债券A类



2、 光大保德信添天盈理财债券B类



注:B类基金份额于2013年4月25日全部赎回。

注:1、本基金合同于2012年10月25日生效,基金自合同生效起至报告期末不满一年。

2、根据基金合同的规定,本基金建仓期为2012年10月25日至2013年4月24日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
韩爱丽	基金经理	2012-10-25	-	6年	韩爱丽女士,复旦大学经济学硕士,CFA。