

光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金

2015 第一季度报告

2015年3月31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

重要提示
基金管理人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。

基金管理人中国建设银行股份有限公司(以下简称光大基金合同)于2014年4月17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,也不保证基金资产净值不受损失,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。

本报告自2015年1月1日起至3月31日止。

Table with 2 columns: 基金名称 (Fund Name) and 基金代码 (Fund Code). Includes details like 基金运作方式 (Fund Operation Mode), 基金合同生效日 (Fund Contract Effective Date), and 基金管理人 (Fund Manager).

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators) and 单位:人民币元 (Unit: RMB Yuan). Shows metrics like 本期净收益 (Net Income), 本期基金份额净值增长率 (Net Asset Value Growth Rate), and 期末基金份额净值 (End of Period Net Asset Value).

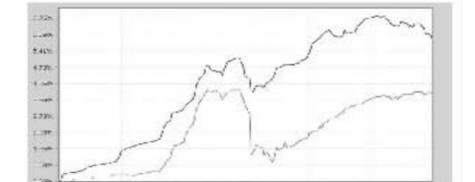
注:本期未实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本基金已实现收益加上本期公允价值变动收益。上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现
3.2.1 报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

Table with 6 columns: 阶段 (Period), 净值增长率 (Net Value Growth Rate), 净值增长率标准差 (Net Value Growth Rate Standard Deviation), 业绩比较基准收益率 (Benchmark Return Rate), 业绩比较基准收益率标准差 (Benchmark Return Rate Standard Deviation), ①-③ (Difference 1-3), ②-④ (Difference 2-4).

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对比

光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金
自净值增长率与业绩比较基准收益率对比图(2014年8月12日至2015年3月31日)



注:1.本基金合同于2014年4月17日生效,截至报告期末本基金合同生效满一年。
2.按基金合同约定,本基金合同于2014年8月12日至2015年2月11日,建仓期结束本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的资产配置比例。

3.3 基金管理人、基金托管人及基金经理简介

3.3.1 基金管理人及基金经理简介

Table with 5 columns: 姓名 (Name), 性别 (Gender), 任职日期 (Appointment Date), 离任日期 (Resignation Date), 说明 (Remarks). Lists Wang Jun and He Yizhi as fund managers.

3.3.2 报告期内基金管理人遵守《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发生。

3.4 管理人报告

3.4.1 公平交易制度的执行情况
3.4.2 关联交易事项的审批程序

3.4.3 公平交易制度的执行情况
3.4.4 关联交易事项的审批程序

3.4.5 公平交易制度的执行情况
3.4.6 关联交易事项的审批程序

3.4.7 公平交易制度的执行情况
3.4.8 关联交易事项的审批程序

3.4.9 公平交易制度的执行情况
3.4.10 关联交易事项的审批程序

3.4.11 公平交易制度的执行情况
3.4.12 关联交易事项的审批程序

3.4.13 公平交易制度的执行情况
3.4.14 关联交易事项的审批程序

3.4.15 公平交易制度的执行情况
3.4.16 关联交易事项的审批程序

3.4.17 公平交易制度的执行情况
3.4.18 关联交易事项的审批程序

3.4.19 公平交易制度的执行情况
3.4.20 关联交易事项的审批程序

3.4.21 公平交易制度的执行情况
3.4.22 关联交易事项的审批程序

3.4.23 公平交易制度的执行情况
3.4.24 关联交易事项的审批程序

3.4.25 公平交易制度的执行情况
3.4.26 关联交易事项的审批程序

3.4.27 公平交易制度的执行情况
3.4.28 关联交易事项的审批程序

3.4.29 公平交易制度的执行情况
3.4.30 关联交易事项的审批程序

3.4.31 公平交易制度的执行情况
3.4.32 关联交易事项的审批程序

3.4.33 公平交易制度的执行情况
3.4.34 关联交易事项的审批程序

3.4.35 公平交易制度的执行情况
3.4.36 关联交易事项的审批程序

3.4.37 公平交易制度的执行情况
3.4.38 关联交易事项的审批程序

3.4.39 公平交易制度的执行情况
3.4.40 关联交易事项的审批程序

3.4.41 公平交易制度的执行情况
3.4.42 关联交易事项的审批程序

3.4.43 公平交易制度的执行情况
3.4.44 关联交易事项的审批程序

3.4.45 公平交易制度的执行情况
3.4.46 关联交易事项的审批程序

3.4.47 公平交易制度的执行情况
3.4.48 关联交易事项的审批程序

3.4.49 公平交易制度的执行情况
3.4.50 关联交易事项的审批程序

3.4.51 公平交易制度的执行情况
3.4.52 关联交易事项的审批程序

3.4.53 公平交易制度的执行情况
3.4.54 关联交易事项的审批程序

3.4.55 公平交易制度的执行情况
3.4.56 关联交易事项的审批程序

3.4.57 公平交易制度的执行情况
3.4.58 关联交易事项的审批程序

3.4.59 公平交易制度的执行情况
3.4.60 关联交易事项的审批程序

3.4.61 公平交易制度的执行情况
3.4.62 关联交易事项的审批程序

3.4.63 公平交易制度的执行情况
3.4.64 关联交易事项的审批程序

3.4.65 公平交易制度的执行情况
3.4.66 关联交易事项的审批程序

3.4.67 公平交易制度的执行情况
3.4.68 关联交易事项的审批程序

3.4.69 公平交易制度的执行情况
3.4.70 关联交易事项的审批程序

3.4.71 公平交易制度的执行情况
3.4.72 关联交易事项的审批程序

3.4.73 公平交易制度的执行情况
3.4.74 关联交易事项的审批程序

3.4.75 公平交易制度的执行情况
3.4.76 关联交易事项的审批程序

3.4.77 公平交易制度的执行情况
3.4.78 关联交易事项的审批程序

3.4.79 公平交易制度的执行情况
3.4.80 关联交易事项的审批程序

3.4.81 公平交易制度的执行情况
3.4.82 关联交易事项的审批程序

3.4.83 公平交易制度的执行情况
3.4.84 关联交易事项的审批程序

3.4.85 公平交易制度的执行情况
3.4.86 关联交易事项的审批程序

3.4.87 公平交易制度的执行情况
3.4.88 关联交易事项的审批程序

3.4.89 公平交易制度的执行情况
3.4.90 关联交易事项的审批程序

3.4.91 公平交易制度的执行情况
3.4.92 关联交易事项的审批程序

下调存款准备金率,并全面下调存款准备金率,在公开市场操作上,央行先是启动逆回购操作,后多次下调逆回购利率,引导资金利率下行。

在债券市场运行方面,2015年一季度债券收益率曲线继续上行,债券收益率先是在经济下行、通胀低迷、货币政策宽松预期的刺激下大幅下行,随后在“政策托底、财政发力”预期下企稳回升,并随着“稳增长”预期下通胀的回升,债券收益率在1-2月期间,再度大幅上行,最大回撤幅度为1.5%左右。

4.2 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.2.1 行业配置
4.2.2 个股配置

4.3 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.3.1 行业配置
4.3.2 个股配置

4.4 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.4.1 行业配置
4.4.2 个股配置

4.5 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.5.1 行业配置
4.5.2 个股配置

4.6 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.6.1 行业配置
4.6.2 个股配置

4.7 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.7.1 行业配置
4.7.2 个股配置

4.8 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.8.1 行业配置
4.8.2 个股配置

4.9 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.9.1 行业配置
4.9.2 个股配置

4.10 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.10.1 行业配置
4.10.2 个股配置

4.11 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.11.1 行业配置
4.11.2 个股配置

4.12 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.12.1 行业配置
4.12.2 个股配置

4.13 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.13.1 行业配置
4.13.2 个股配置

4.14 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.14.1 行业配置
4.14.2 个股配置

4.15 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.15.1 行业配置
4.15.2 个股配置

4.16 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.16.1 行业配置
4.16.2 个股配置

4.17 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.17.1 行业配置
4.17.2 个股配置

4.18 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.18.1 行业配置
4.18.2 个股配置

4.19 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.19.1 行业配置
4.19.2 个股配置

4.20 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.20.1 行业配置
4.20.2 个股配置

4.21 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.21.1 行业配置
4.21.2 个股配置

4.22 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.22.1 行业配置
4.22.2 个股配置

4.23 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.23.1 行业配置
4.23.2 个股配置

4.24 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.24.1 行业配置
4.24.2 个股配置

4.25 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.25.1 行业配置
4.25.2 个股配置

4.26 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.26.1 行业配置
4.26.2 个股配置

4.27 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.27.1 行业配置
4.27.2 个股配置

4.28 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.28.1 行业配置
4.28.2 个股配置

4.29 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.29.1 行业配置
4.29.2 个股配置

4.30 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.30.1 行业配置
4.30.2 个股配置

4.31 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.31.1 行业配置
4.31.2 个股配置

4.32 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.32.1 行业配置
4.32.2 个股配置

4.33 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.33.1 行业配置
4.33.2 个股配置

4.34 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.34.1 行业配置
4.34.2 个股配置

4.35 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.35.1 行业配置
4.35.2 个股配置

4.36 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.36.1 行业配置
4.36.2 个股配置

4.37 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.37.1 行业配置
4.37.2 个股配置

4.38 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.38.1 行业配置
4.38.2 个股配置

4.39 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.39.1 行业配置
4.39.2 个股配置

4.40 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.40.1 行业配置
4.40.2 个股配置

4.41 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.41.1 行业配置
4.41.2 个股配置

4.42 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.42.1 行业配置
4.42.2 个股配置

4.43 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.43.1 行业配置
4.43.2 个股配置

4.44 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.44.1 行业配置
4.44.2 个股配置

4.45 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.45.1 行业配置
4.45.2 个股配置

4.46 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.46.1 行业配置
4.46.2 个股配置

4.47 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.47.1 行业配置
4.47.2 个股配置

4.48 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.48.1 行业配置
4.48.2 个股配置

4.49 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.49.1 行业配置
4.49.2 个股配置

4.50 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.50.1 行业配置
4.50.2 个股配置

4.51 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.51.1 行业配置
4.51.2 个股配置

4.52 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.52.1 行业配置
4.52.2 个股配置

4.53 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.53.1 行业配置
4.53.2 个股配置

4.54 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.54.1 行业配置
4.54.2 个股配置

4.55 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.55.1 行业配置
4.55.2 个股配置

4.56 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.56.1 行业配置
4.56.2 个股配置

4.57 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.57.1 行业配置
4.57.2 个股配置

4.58 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.58.1 行业配置
4.58.2 个股配置

4.59 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.59.1 行业配置
4.59.2 个股配置

4.60 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.60.1 行业配置
4.60.2 个股配置

4.61 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.61.1 行业配置
4.61.2 个股配置

4.62 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.62.1 行业配置
4.62.2 个股配置

4.63 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.63.1 行业配置
4.63.2 个股配置

4.64 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.64.1 行业配置
4.64.2 个股配置

4.65 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.65.1 行业配置
4.65.2 个股配置

4.66 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.66.1 行业配置
4.66.2 个股配置

4.67 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.67.1 行业配置
4.67.2 个股配置

4.68 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.68.1 行业配置
4.68.2 个股配置

4.69 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.69.1 行业配置
4.69.2 个股配置

4.70 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.70.1 行业配置
4.70.2 个股配置

4.71 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.71.1 行业配置
4.71.2 个股配置

4.72 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.72.1 行业配置
4.72.2 个股配置

4.73 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.73.1 行业配置
4.73.2 个股配置

4.74 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.74.1 行业配置
4.74.2 个股配置

4.75 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.75.1 行业配置
4.75.2 个股配置

4.76 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.76.1 行业配置
4.76.2 个股配置

4.77 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.77.1 行业配置
4.77.2 个股配置

4.78 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.78.1 行业配置
4.78.2 个股配置

4.79 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.79.1 行业配置
4.79.2 个股配置

4.80 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.80.1 行业配置
4.80.2 个股配置

4.81 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.81.1 行业配置
4.81.2 个股配置

4.82 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.82.1 行业配置
4.82.2 个股配置

4.83 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.83.1 行业配置
4.83.2 个股配置

4.84 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.84.1 行业配置
4.84.2 个股配置

4.85 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.85.1 行业配置
4.85.2 个股配置

4.86 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.86.1 行业配置
4.86.2 个股配置

4.87 报告期内本基金重仓持股的行业和个股
4.87.1 行业配置
4.87.2 个股配置

光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金

2015 第一季度报告

2015年3月31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

重要提示
基金管理人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。

基金管理人中国建设银行股份有限公司(以下简称光大基金合同)于2015年4月17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,也不保证基金资产净值不受损失,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。

本报告自2015年1月1日起至3月31日止。

Table with 2 columns: 基金名称 (Fund Name) and 基金代码 (Fund Code). Includes details like 基金运作方式 (Fund Operation Mode), 基金合同生效日 (Fund Contract Effective Date), and 基金管理人 (Fund Manager).

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators) and 单位:人民币元 (Unit: RMB Yuan). Shows metrics like 本期净收益 (Net Income), 本期基金份额净值增长率 (Net Asset Value Growth Rate), and 期末基金份额净值 (End of Period Net Asset Value).

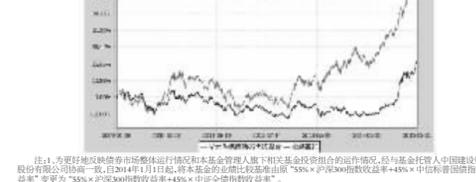
注:本期未实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本基金已实现收益加上本期公允价值变动收益。上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现
3.2.1 报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

Table with 6 columns: 阶段 (Period), 净值增长率 (Net Value Growth Rate), 净值增长率标准差 (Net Value Growth Rate Standard Deviation), 业绩比较基准收益率 (Benchmark Return Rate), 业绩比较基准收益率标准差 (Benchmark Return Rate Standard Deviation), ①-③ (Difference 1-3), ②-④ (Difference 2-4).

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对比

光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金
自净值增长率与业绩比较基准收益率对比图(2014年8月12日至2015年3月31日)



注:1.本基金合同于2014年4月17日生效,截至报告期末本基金合同生效满一年。
2.按基金合同约定,本基金合同于2014年8月12日至2015年2月11日,建仓期结束本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的资产配置比例。

3.3 基金管理人、基金托管人及基金经理简介

3.3.1 基金管理人及基金经理简介

Table with 5 columns: 姓名 (Name), 性别 (Gender), 任职日期 (Appointment Date), 离任日期 (Resignation Date), 说明 (Remarks). Lists Wang Jun and He Yizhi as fund managers.

3.3.2 报告期内基金管理人遵守《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发生。

3.4 管理人报告

3.4.1 公平交易制度的执行情况
3.4.2 关联交易事项的审批程序

3.4.3 公平交易制度的执行情况
3.4.4 关联交易事项的审批程序

3.4.5 公平交易制度的执行情况
3.4.6 关联交易事项的审批程序

3.4.7 公平交易制度的执行情况
3.4.8 关联交易事项的审批程序

3.4.9 公平交易制度的执行情况
3.4.10 关联交易事项的审批程序

3.4.11 公平交易制度的执行情况
3.4.12 关联交易事项的审批程序

3.4.13 公平交易制度的执行情况
3.4.14 关联交易事项的审批程序

3.4.15 公平交易制度的执行情况
3.4.16 关联交易事项的审批程序

3.4.17 公平交易制度的执行情况
3.4.18 关联交易事项的审批程序

3.4.19 公平交易制度的执行情况
3.4.20 关联交易事项的审批程序

3.4.21 公平交易制度的执行情况
3.4.22 关联交易事项的审批程序

3.4.23 公平交易制度的执行情况
3.4.24 关联交易事项的审批程序