

光大保德信货币市场基金

2013第四季度报告

2013年12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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年一月二十二日
1.1 重要提示
基金管理人的董事会及监察稽核部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。
本报告财务资料未经审计。
本报告自2013年10月1日起至2013年12月31日止。

5.2 基金产品概况

基金简称	光大保德信货币
基金代码	360003
交易代码	360003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年6月19日
报告期末基金份额总额	536,366,160.41份
投资目标	本基金通过资产配置策略，在固定收益类金融工具、另类投资品种和流动性强的短期金融工具之间，在保持资金资产安全和高流动性的前提下，获得超额的绝对收益比基准的当期收益。
投资策略	本基金将通过资产配置策略，在固定收益类金融工具、另类投资品种和流动性强的短期金融工具之间，在保持资金资产安全和高流动性的前提下，获得超额的绝对收益比基准的当期收益。
业绩比较基准	业绩比较基准：活期存款利率(税后)+0.8%定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金、混合型基金、债券型基金等其他类型的基金，其风险收益水平高于货币型基金。
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
§ 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10月1日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	4,365,908.78
2.本期利润	4,365,908.78
3.期末基金资产净值	536,366,160.41

(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平均公允价值变动收益,因此,本期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。)

3.2 基金净值表现表

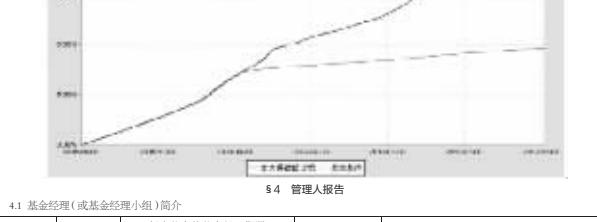
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长① (%) 净值增长率标准差② (%) 业绩比较基准收益率③ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 1.0507% 0.0084% 0.0000% 0.9613% 0.0034%

3.2.2 日基金分红情况表

光大保德信货币市场基金 累计净值收益与业绩比较基准收益率走势图对比图 (2005年6月9日至2013年12月31日)



§ 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间	证券从业年限	说明
韩丽丽	基金经理	2012-3-1	-	6年 韩丽丽女士,复旦大学经济学硕士,CFA,2006年8月至2010年8月在上海浦东发展银行总行金融市场部工作,历任金融市场部副经理、风险管理部高级经理,现任光大保德信货币市场基金基金经理。光大保德信盛盈分级债券型证券投资基金基金经理,光大保德信盛盈分级债券型证券投资基金基金经理,光大保德信货币市场基金基金经理。

4.2 报告期内本基金运作跟踪情况说明

本报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定,建立健全内部风险控制制度,并根据基金的经营特点,严格控制风险,在保证基金资产安全的前提下,争取最大的投资收益。

4.3 公公平交易执行情况

4.3.1 平等对待所有客户的执行情况

光大保德信基金管理人旗下各基金在获知调研团队、交易团队等各方面得到公平对待,本基金管理人从投研设计制度、组织构架、工作流程规范、技术系统建设完善、公平交易执行效果评估等方面出发,建设形成了有效的公平交易执行体系。

本报告期,基金管理人各交易执行制度均得到良好地贯彻执行,未发现有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

本报告期内未发现任何异常交易行为。

4.4 报告期内基金管理费和业绩报酬计提情况

2013年1月1日至2013年12月31日,本基金未发生过因降低管理费率而增加客户收益的情况。

4.5 报告期内发生的基金投资策略调整和投资额度变更情况

本基金未发生过因降低管理费率而增加客户收益的情况。

4.6 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	固定收益投资	129,628,360.69	24.15
2	银行存款	129,628,360.69	24.15
3	买入返售金融资产	-	-
4	应收利息	162,000,701.00	30.18
5	银行存款和结算备金合计	240,532,260.08	44.81
6	其他资产	4,673,433.91	0.87
7	合计	536,847,775.68	100.00

5.2 报告期预期的现金情况

基金管理人:光大保德信基金管理有限公司

报告送出日期:二〇一四年一月二十二日

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及监察稽核部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未来表现,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。

本报告财务资料未经审计。

本报告自2013年10月1日起至2013年12月31日止。

1.2 基金产品概况

5.3 主要财务指标和基金净值表现

5.3.1 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① (%) 净值增长率标准差② (%) 业绩比较基准收益率③ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 -3.03% 1.11% -3.44% 0.85% 0.41% 0.26%

5.3.2 日基金分红情况表

光大保德信货币市场基金 累计净值收益与业绩比较基准收益率走势图对比图 (2005年6月9日至2013年12月31日)



注:根据基金合同,本基金建仓期为2006年3月24日至2006年6月23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范围。

5.4 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间 证券从业年限 说明

于杰先生,复旦大学经济学硕士,CFA,2006年3月至今在上海浦东发展银行总行金融市场部工作,历任金融市场部副经理、风险管理部高级经理,现任光大保德信货币市场基金基金经理。光大保德信盛盈分级债券型证券投资基金基金经理,光大保德信货币市场基金基金经理。

4.2 报告期内本基金运作跟踪情况说明

本报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定,建立健全内部风险控制制度,并根据基金的经营特点,严格控制风险,在保证基金资产安全的前提下,争取最大的投资收益。

4.3 公公平交易执行情况

4.3.1 平等对待所有客户的执行情况

光大保德信基金管理人旗下各基金在获知调研团队、交易团队等各方面得到公平对待,本基金管理人从投研设计制度、组织构架、工作流程规范、技术系统建设完善、公平交易执行效果评估等方面出发,建设形成了有效的公平交易执行体系。

本报告期,基金管理人各交易执行制度均得到良好地贯彻执行,未发现有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

本报告期内未发现任何异常交易行为。

4.4 报告期内基金管理费和业绩报酬计提情况

2013年1月1日至2013年12月31日,本基金未发生过因降低管理费率而增加客户收益的情况。

4.5 报告期内发生的基金投资策略调整和投资额度变更情况

本基金未发生过因降低管理费率而增加客户收益的情况。

4.6 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 固定收益投资 2,911,232,42,60 84.71

2 银行存款 2,911,232,42,60 84.71

3 买入返售金融资产 137,486,970.00 4.51

4 保证金存款 160,000,000.00 5.23

5 其他资产 11,488,415.36 0.37

6 合计 3,059,608,576.39 100.00

5.2 报告期预期的现金情况

基金管理人:光大保德信基金管理有限公司

报告送出日期:二〇一四年一月二十二日

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及监察稽核部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未来表现,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。

本报告财务资料未经审计。

本报告自2013年10月1日起至2013年12月31日止。

1.2 基金产品概况

5.3 主要财务指标和基金净值表现

5.3.1 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① (%) 净值增长率标准差② (%) 业绩比较基准收益率③ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 -3.03% 1.11% -3.44% 0.85% 0.41% 0.26%

5.3.2 日基金分红情况表

光大保德信货币市场基金 累计净值收益与业绩比较基准收益率走势图对比图 (2005年6月9日至2013年12月31日)

注:根据基金合同,本基金建仓期为2006年3月24日至2006年6月23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范围。

5.4 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间 证券从业年限 说明

于杰先生,复旦大学经济学硕士,CFA,2006年3月至今在上海浦东发展银行总行金融市场部工作,历任金融市场部副经理、风险管理部高级经理,现任光大保德信货币市场基金基金经理。光大保德信盛盈分级债券型证券投资基金基金经理,光大保德信货币市场基金基金经理。

4.2 报告期内本基金运作跟踪情况说明

本报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定,建立健全内部风险控制制度,并根据基金的经营特点,严格控制风险,在保证基金资产安全的前提下,争取最大的投资收益。

4.3 公公平交易执行情况

4.3.1 平等对待所有客户的执行情况

光大保德信基金管理人旗下各基金在获知调研团队、交易团队等各方面得到公平对待,本基金管理人从投研设计制度、组织构架、工作流程规范、技术系统建设完善、公平交易执行效果评估