

**光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金**  
**2015 年年度报告摘要**  
**2015 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：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

## §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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 25 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 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

### 2.1 基金基本情况

基金简称	光大保德信岁末红利纯债债券	
基金主代码	000489	
交易代码	000489	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 8 月 12 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	
报告期末基金份额总额	767,220,344.70 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	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
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

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制信用风险、谨慎投资的前提下，力争在获取持有期收益的同时，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金根据工业增加值、通货膨胀率等宏观经济指标，结合国家货币政策和财政政策实施情况、市场收益率曲线变动情况、市场流动性情况，综合分析债券市场的变动趋势。最终确定本基金在债券类资产中的投资比率，构建和调整债券投资组合。
业绩比较基准	中证全债指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的风险较低的品种，其预期收益和风险高于货币市场基金，但低于股票型基金和混合型基金。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	魏丹	田青
	联系电话	021-33074700-3226	010-67595096
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008-202-888, 021-53524620	010-67595096
传真		021-63351152	010-66275853

### 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、中国建设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	2015 年		2014 年 8 月 12 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日	
	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	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
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 金份额本期 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 期末数据和指标	2015 年末		2014 年末	
	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	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

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）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。

### 3.2 基金净值表现

#### 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纯债债券 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	①-③	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. 光大保德信岁末红利纯债债券 C:

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	①-③	②-④
过去三个月	1.57%	0.07%	2.75%	0.07%	-1.18%	0.00%
过去六个月	3.97%	0.07%	5.39%	0.07%	-1.42%	0.00%
过去一年	8.83%	0.07%	8.74%	0.08%	0.09%	-0.01%
自基金合同生效起至今	10.22%	0.13%	14.01%	0.10%	-3.79%	0.03%

业绩比较基准收益率=100%\*中债综合指数收益率，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

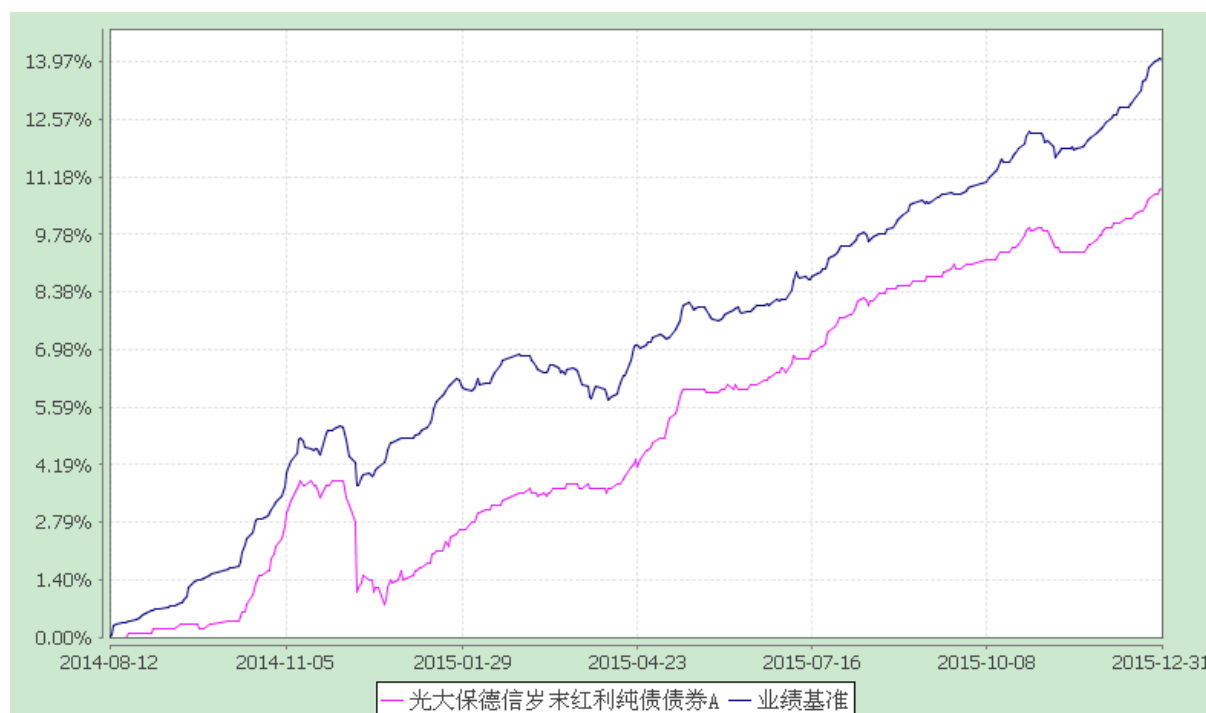
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金

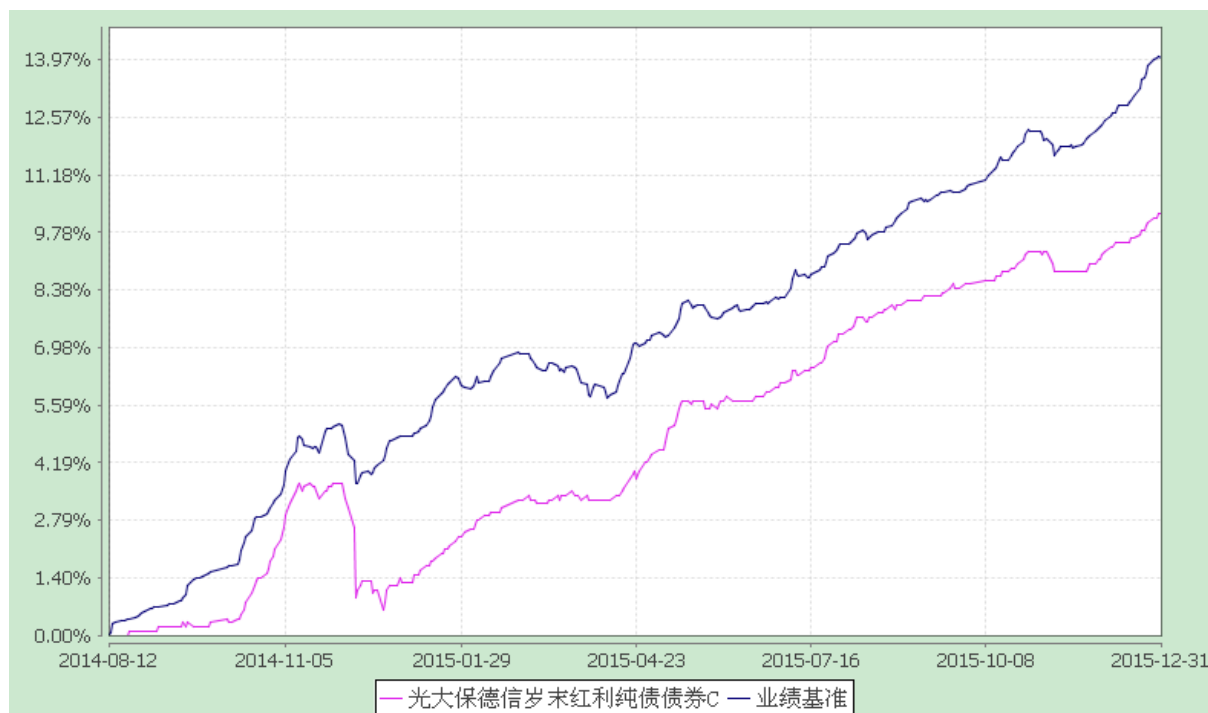
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(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



#### 2、光大保德信岁末红利纯债债券 C



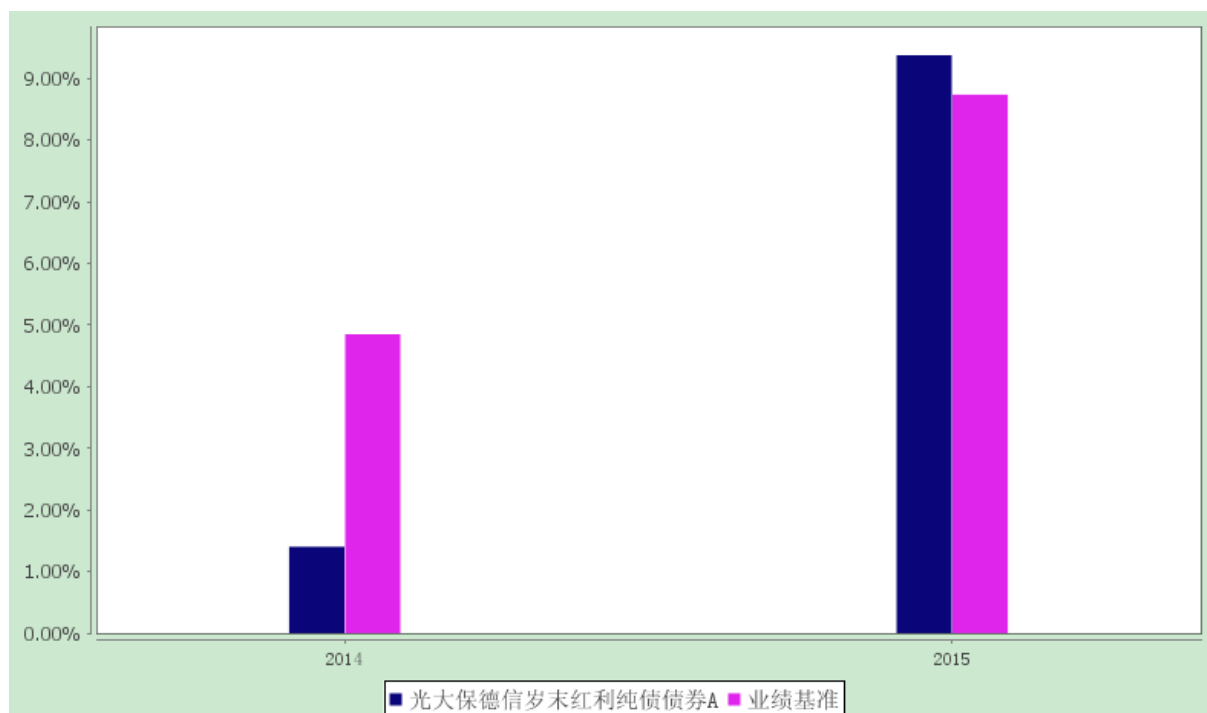
注：根据基金合同的规定，本基金建仓期为 2014 年 8 月 12 日至 2015 年 2 月 11 日。建仓期结束本项基金各项资产配置比例应符合本项基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

### 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绩比较基准收益率的比较

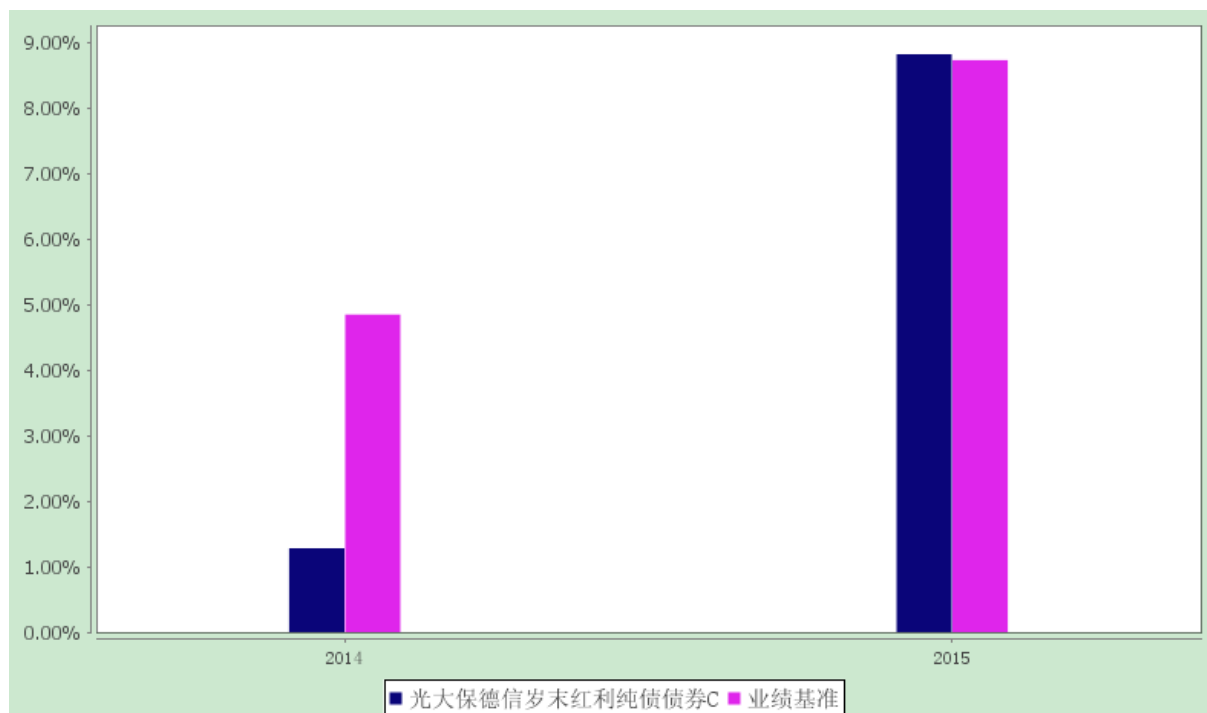
光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金

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柱形对比图

#### 1、光大保德信岁末红利纯债债券 A



#### 2、光大保德信岁末红利纯债债券 C



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。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

#### 1、光大保德信岁末红利纯债债券 A：

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	0.694	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	-

#### 2、光大保德信岁末红利纯债债券 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	-



## §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 2015 年 12 月 31 日，光大保德信旗下管理着 24 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、光大保德信优势配置混合型证券投资基金、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混合型证券投资基金、光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信中小盘混合型证券投资基金、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混合型证券投资基金、光大保德信添盛双月理财债券型证券投资基金、光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金、光大保德信现金宝货币市场基金、光大保德信银发商机主题混合型证券投资基金、光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金、光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金、光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信一带一路战略主题混合型证券投资基金、光大保德信耀钱包货币市场基金、光大保德信欣鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信尊尚一年定期开放债券型证券投资基金和光大保德信中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金。

#### 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		
王慧杰	基金经理	2014-08-28	-	7 年	王慧杰女士，硕士。2006 年毕业于南开大学数学系信息与计算科学专业，2009 年获得美国普渡大学计算金融方向硕士学位和应用统计学研究生学历资格认证。王慧杰女士于 2009 年 6 月至 2011 年 8 月在彭博资讯社纽约总

					部担任利率衍生品研发员； 2011 年 8 月加入光大保德信基金管理有限公司，担任固定收益研究员。现任光大保德信货币市场基金基金经理、光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金基金经理，光大保德信增利收益债券型证券投资基金基金经理（暂代），光大保德信信用添益债券型证券投资基金基金经理（暂代）。
何了乙	总经理助理、 固定收益投资 部总监、基金 经理	2014-08- 12	2015-03-02	17 年	何了乙先生，同济大学工商管理硕士。1999 年至 2005 年任亚洲证券固定收益部高级经理； 2005 年至 2006 年任天安保险投资管理中心投资经理；2006 年至 2008 年任中海基金基金经理助理； 2008 年至 2014 年历任长江养老保险固定收益部投资经理、固定收益部副总经理、投资管理部副总经理兼固定收益部总经理。 2014 年至 2015 年任光大保德信基金总经理助理兼固定收益投资部总监、光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金基金经理。

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合规守信情况的说明

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 =  $(B \text{ 组合交易均价} / A \text{ 组合交易均价} - 1)$ ，卖出溢价率 =  $(A \text{ 组合交易均价} / B \text{ 组合交易均价} - 1)$ ；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%，得到交易价差是否趋近于 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。在同向交易价差分析中，本基金在同日内、3 日内、5 日内同向成交价格与其他投资组合无显著差异，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。本基金与公司旗下其他投资组合在交易所市场与银行间市场未发生较少单边成交量大于 5% 的同日反向交易。

### 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

2015 年全年，在全球性调整的大背景下，我国经济步入新常态，经济周期性和结构性问题相互叠加，经济增长持续面临下行压力。从生产层面来看，工业增加值在环比和同比层面持续显现颓势，粗钢产量增速、发电量增速和耗煤量增速等都出现了明显的下滑。从需求层面来看，受地产行业的拖累，投资累计增速全年呈现下滑态势，反映内需的疲弱。从微观层面上来看，工业品价格持续低迷，水泥、螺纹钢和煤炭价格持续下滑或维持在低位，印证了需求的疲弱。通胀水平稳定在低位，压力不大。在经济增长面临下行压力、通胀水平维持在低位的背景下，政府稳增长意图明显。积极财政政策力度有所加大，货币政策延续了宽松的基调。央行综合运用公开市场操作、中期借贷便利、普降金融机构存款准备金率等多种工具合理调节银行体系流动性，保持了银行体系流动性总体充裕。央行并多次下调人民币存贷款基准利率和公开市场逆回购操作利率，引导市场利率平稳适度下行，促进实际利率平稳下行。

在债券市场运行方面，2015 年全年债券市场在经济增长下行、货币政策宽松的背景下，走出一轮牛市。尽管在个别时间点，受地方政府债供给急剧增加、IPO 暂停后首次重启等短期因素的影响，债券市场出现了明显调整，但全年来看，收益率下行趋势未改。岁末红利纯债基金在日常操作中，保持稳健。在市场上涨时主动提升组合杠杆，拉长组合久期，并通过利率债波段操作，增厚收益。在市场出现调整的期间，降低组合杠杆和久期，最大限度减少了组合的亏损。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内光大保德信岁末红利纯债债券 A 份额净值增长率为 9.38%，业绩比较基准收益率为 8.74%，光大保德信岁末红利纯债债券 C 份额净值增长率为 8.83%，业绩比较基准收益率为 8.74%。

#### 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 2016 年，短期内宏观背景仍有望延续：首先，实体经济增长仍然处于弱势，经济增长复苏难以预见，仍然处于“下了台阶”的新的平台上。在“供给侧+结构性+改革”的宏观背景下，政策的目标定位为“在适度扩大总需求和调整需求结构的同时，着力加强供给侧结构性改革”，宏观政策的核心是稳住需求，加强改革，淘汰落后产能和僵尸企业。通胀水平尚且温和，基本面的整体环境对于债券市场仍有支撑。“下了台阶”的经济增长，对应着“下了台阶”的收益率中枢，尽管现在收益率水平处于低位，但是上行的空间并不大。其次，稳健的货币政策仍将延续，将继续为结构性改革营造适宜的货币金融环境，降低融资成本，保持流动性合理充裕。两者结合来看，总需求难以明显改善，实体经济回报率仍将下行。由于实体经济无法提供高回报的资产，对流动性的吸收仍然不足。那么过剩的流动性将更多的寻求金融资产进行配置。

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度，而货币政策重在稳定宏观环境。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弱于市场预期。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。常态下维持中低久期和中等杠杆水平，严格控制组合信用风险，严格规避低评级品种，密切关注行业及个券信用状况。择时提升杠杆水平，争取通过参与利率债的阶段性情来增强组合投资收益。

#### 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，公司设立由负责运营的高管、运营部代表（包括基金会计）、投研部门代表、监察稽核部代表、IT 部代表、金融工程部门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、审计师沟通后形成建议，经公司管理层批准后由运营部具体执行。估值委员会向公司管理层提交推荐建议前，应审慎平衡托管行、审计师和基金同业的意见，并必须获得估值委员会二分之一以上成员同意。

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，估值委员会中的投研人员比例不超过三分之一。

委员会对各相关部门和代表人员的分工如下：投资研究部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，负责执行基金估值政策进行日常估值业务，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的合法合规发表意见；投资研究部负责估值政策调整对投资业绩影响的评估；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**

根据相关法律法规和基金合同以及基金实际运作情况，2015 年 12 月 31 日本基金 A 类基金份额每 10 份派发红利 0.694 元，C 类基金份额每 10 份派发红利 0.649 元。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## **§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**

本报告期，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》

、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害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 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、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关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：光大保德信岁末红利纯债债券 A 为 49,968,838.76 元，光大保德信岁末红利纯债债券 C 为 3,063,816.03 元。

### 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

本托管人复核审查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。

## §6 审计报告

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字(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文查看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	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	-	-
买入返售金融资产	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	-	-
<b>资产总计</b>	<b>1,275,578,408.70</b>	<b>864,543,660.82</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2015 年 12 月 31 日</b>	<b>2014 年 12 月 31 日</b>
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
<b>负债合计</b>	<b>483,902,906.43</b>	<b>346,268,025.13</b>
<b>所有者权益：</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
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
<b>所有者权益合计</b>	<b>791,675,502.27</b>	<b>518,275,635.69</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>1,275,578,408.70</b>	<b>864,543,660.82</b>

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，光大保德信岁末红利纯债基金份额总额 767,220,344.70 份，其中 A 类基金份额的份额总额为 720,012,084.77 份，份额净值 1.032 元；C 类基金份额的份额总额为 47,208,259.93 份，份额净值 1.031 元。

## 7.2 利润表

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

单位：人民币元

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
<b>一、收入</b>	<b>62,850,238.59</b>	<b>21,579,121.97</b>
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	-	-
买入返售金融资产收入	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
<b>减：二、费用</b>	<b>11,927,872.66</b>	<b>9,375,728.55</b>
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
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>50,922,365.93</b>	<b>12,203,393.42</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>50,922,365.93</b>	<b>12,203,393.42</b>

### 7.3 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

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2015 年 1 月 1 日至 2015 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)	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	-4,870,112.51	-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 报表附注

### 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末红利纯债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，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,368,912,481.50 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)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，《光大保德信岁末红利纯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纯债债券型证券投资基金招募说明书》，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，称为 A 类基金份额；不收取前后端认购费或申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 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

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》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、中期票据、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、可分离交易可转换公司债券的纯债部分、银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，可转债仅投资可分离交易可转债的纯债部分。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为中证全债指数。

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 2016 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项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》和在财务报表附注 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 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。

#### 7.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 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》、财税[2012]85号《关于实施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》、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，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(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。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
光大保德信基金管理有限公司(“光大保德信基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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
光大保德信资产管理有限公司	基金管理人控制的子公司

注：下述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

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。

##### 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	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年 12月31日	2014年8月12日（基金合同 生效日）至2014年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,836,289.15	2,224,835.84
其中：支付销售机构的客户维护费	401,925.97	1,301,586.10

注：支付基金管理人光大保德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，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.6\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年 12月31日	2014年8月12日（基金合同 生效日）至2014年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,278,763.10	741,611.96

注：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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.2\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期		
	2015年1月1日至2015年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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
光大保德信	-	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

获得销售服务费的各 关联方名称	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		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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
建设银行	-	272,251.59	272,251.59
合计	-	272,256.79	272,256.79

注：支付基金销售机构的 C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.4% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给光大保德信基金公司，再由光大保德信基金公司计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额基金资产净值} \times 0.4\% / \text{当年天数。}$$

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(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

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期末未运用自有资金投资本基金。

##### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金份额的情况。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	25,701,486.43	84,727.07	7,010,684.89	143,632.70

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 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。



#### 7.4.8.7 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

7.4.9.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
136104	15 市北债	2015-12-22	2016-01-06	新发行	100.00	100.00	200,000.00	20,000,000.00	20,000,000.00	-

##### 7.4.9.2 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牌等流通受限的股票。

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 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：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
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

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 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。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1)公允价值

##### (a)金融工具公允价值计量的方法

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决定：

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

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层次的余额为 0.00 元，属于第二层次的余额为 1,176,309,505.50 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)。

##### (ii)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入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关债券公允价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、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 30 日起改为采用中央国债登记结算有限责任公司根据《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果确定公允价值(附注 7.4.5.2)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未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差很小。

(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。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	买入返售金融资产	23,000,000.00	1.80
	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	31,869,989.40	2.50
7	其他各项资产	44,398,913.80	3.48

8	合计	1,275,578,408.70	100.00
---	----	------------------	--------

## 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重大变动

### 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 买入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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
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

### 8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	150218	15 国开 18	1,000,000	105,020,000.00	13.27
2	1380074	13 西安高新债	500,000	52,120,000.00	6.58
3	1282440	12 川电力 MTN1	500,000	51,885,000.00	6.55
4	101554097	15 北部湾 MTN003	500,000	50,375,000.00	6.36
5	101563015	15 渝江北嘴 MTN003	500,000	50,155,000.00	6.34

### 8.7 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。

### 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。

### 8.9 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。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 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。

#### 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。

### 8.11 报告期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

基金管理人可运用国债期货，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期货。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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或在报告编制日前一年内受到证监会、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

序号	名称	金额
1	存出保证金	20,192.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	24,306,987.00
5	应收申购款	20,071,733.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,398,913.80

### 8.12.4 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。

### 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

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
光大保德信岁末红利纯债债券 A	486	1,481,506.35	694,681,779.09	96.48%	25,330,305.68	3.52%
光大保德信岁末红利纯债债券 C	199	237,227.44	39,641,726.82	83.97%	7,566,533.11	16.03%
合计	685	1,120,029.70	734,323,505.91	95.71%	32,896,838.79	4.29%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	光大保德信岁末红利纯债债券 A	1,086.78	0.00%
	光大保德信岁末红利纯债债券 C	0.00	0.00%
	合计	1,086.78	0.00%

### 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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	光大保德信岁末红利纯债债券 A	0
	光大保德信岁末红利纯债债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	光大保德信岁末红利纯债债券 A	0

	光大保德信岁末红利纯 债债券 C	0
	合计	0

### §10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	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
基金合同生效日（2014年8月 12日）基金份额总额	1,098,538,427.85	270,527,697.74
本报告期期初基金份额总额	445,441,808.74	69,018,949.10
本报告期基金总申购份额	1,578,098,219.41	191,008,001.44
减：本报告期基金总赎回份额	1,303,527,943.38	212,818,690.61
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	720,012,084.77	47,208,259.93

### §11 重大事件揭示

#### 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、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

李常青先生自 2015 年 2 月 28 日起担任本基金管理人督察长；自李常青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一职，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，聘任张力铮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，解聘纪伟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

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师事务所的报酬是 5.4 万元，目前该审计机构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。

#### 11.7 基金租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

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

注：（1）报告期内租用证券公司交易单元变更情况

本基金本报告期无新增或退租的交易单元。

（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、研究实力等进行综合考量。

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；
- 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；
- 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求，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初步筛选；

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

投资研究团队根据各机构的得分排名，拟定要选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用交易席位的事宜。

### 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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券	552,442,089.28	85.82%	15,725,300,000.00	100.00%	-	-
中金公司	91,252,126.03	14.18%	-	-	-	-

光大保德信基金管理有限公司

二〇一六年三月二十八日