

**光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金**  
**2017 年年度报告摘要**  
**2017 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：二〇一八年三月二十七日

## §1 重要提示

### 1.1 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 2018 年 3 月 26 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（特殊普通合伙）为本基金财务出具了 2017 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 2017 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	274,151,236.02 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	232,508,368.03 份	41,642,867.99 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) 80262888	010-67595096
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008-202-888	010-67595096
传真		(021) 80262468	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	2017 年		2016 年		2015 年	
	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	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	4,181,867.4 2	735,371.63	31,182,698.39	1,816,361.82	31,945,228.36	4,328,666.68
本期利 润	8,072,845.2 5	534,582.65	15,185,877.91	428,441.86	44,558,775.53	6,363,590.40
加权平 均基金	0.0233	0.0211	0.0189	0.0073	0.0865	0.0857

份额本期利润						
本期基金份额净值增长率	1.69%	1.53%	1.27%	0.49%	9.38%	8.83%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末		2016 年末		2015 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	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	0.0097	0.0040	0.0037	0.0003	0.0052	0.0049
期末基金资产净值	239,498,270.83	42,659,331.60	399,416,351.74	5,317,007.12	742,980,534.88	48,694,967.39
期末基金份额净值	1.0301	1.0244	1.013	1.009	1.032	1.031

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	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去三个月	0.10%	0.04%	-0.69%	0.05%	0.79%	-0.01%
过去六个月	1.09%	0.04%	-0.14%	0.05%	1.23%	-0.01%
过去一年	1.69%	0.06%	-0.34%	0.06%	2.03%	0.00%
过去三年	12.63%	0.08%	10.54%	0.08%	2.09%	0.00%
自基金合同生 效起至今	14.21%	0.10%	15.90%	0.09%	-1.69%	0.01%

## 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	-0.01%	0.03%	-0.69%	0.05%	0.68%	-0.02%
过去六个月	0.93%	0.04%	-0.14%	0.05%	1.07%	-0.01%
过去一年	1.53%	0.05%	-0.34%	0.06%	1.87%	-0.01%
过去三年	11.03%	0.08%	10.54%	0.08%	0.49%	0.00%
自基金合同生 效起至今	12.45%	0.10%	15.90%	0.09%	-3.45%	0.01%

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。

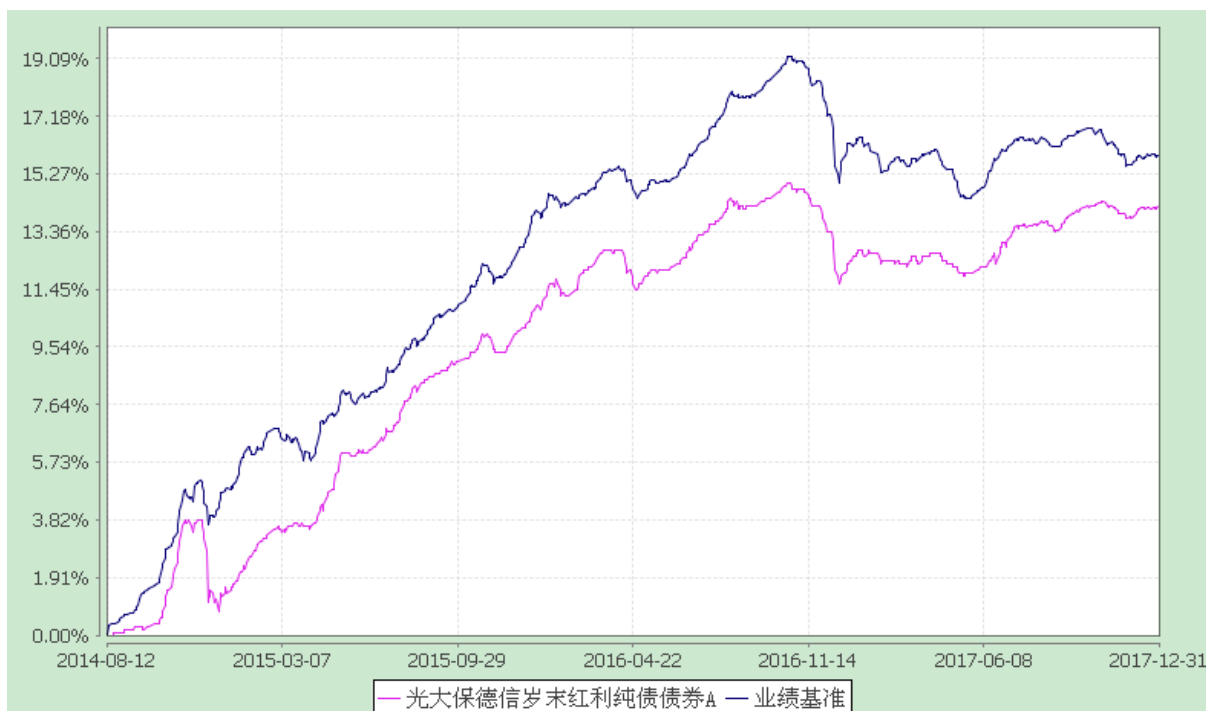
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金

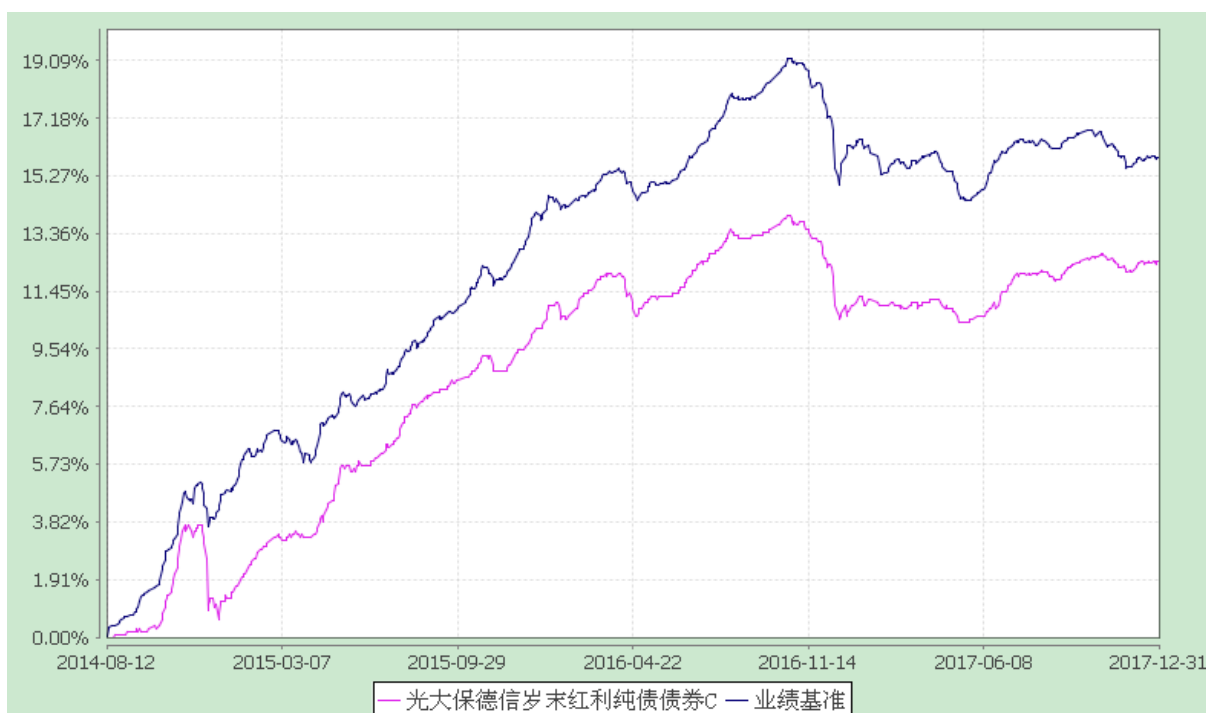
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年8月12日至2017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



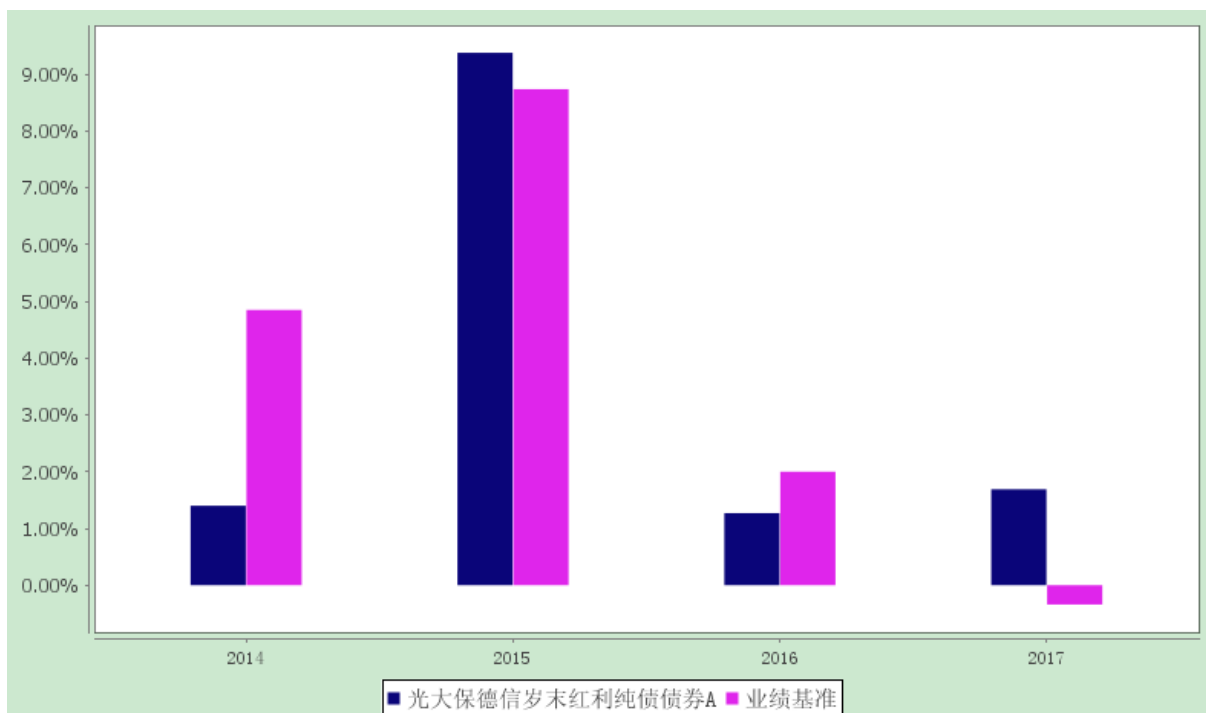
注：根据基金合同的规定，本基金建仓期为 2014 年 8 月 12 日至 2015 年 2 月 11 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例应符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

### 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

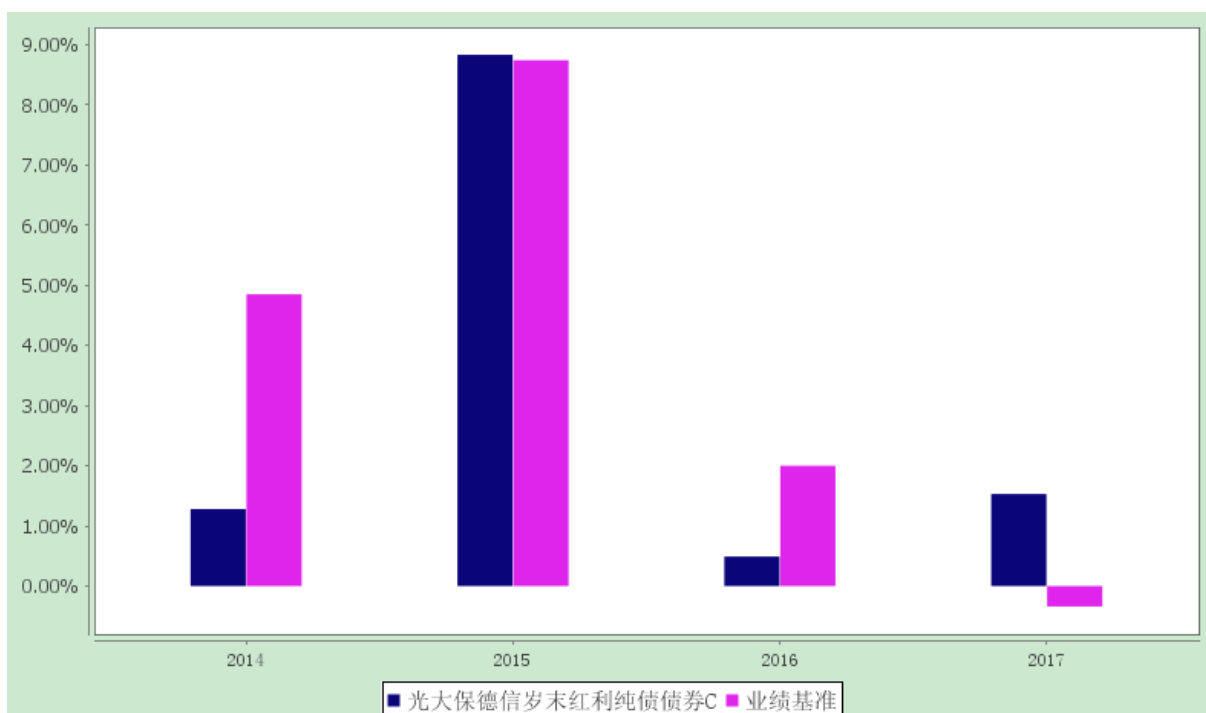
光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金

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
2017	-	-	-	-	-
2016	0.320	10,867,156.83	1,754,146.07	12,621,302.90	-
2015	0.694	42,776,882.64	7,191,956.12	49,968,838.76	-
合计	1.014	53,644,039.47	8,946,102.19	62,590,141.66	-

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
2017	-	-	-	-	-
2016	0.270	122,687.68	19,555.16	142,242.84	-
2015	0.649	3,032,263.47	31,552.56	3,063,816.03	-
合计	0.919	3,154,951.15	51,107.72	3,206,058.87	-

## §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 2017 年 12 月 31 日，光大保德信旗下管理着 41 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、光大保德信中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信风格轮动混合型证券投资基金、光大保德信产业新动力灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信永鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信恒利纯债债券型证券投资基金、光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信诚鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信安和债券型证券投资基金、光大保德信安祺债券型证券投资基金、光大保德信事件驱动灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信永利纯债债券型证券投资基金、光大保德信安诚债券型证券投资基金、光大保德信多策略智选 18 个月定期开放混合型证券投资基金、光大保德信尊盈半年定期开放债券型发起式证券投资基金、光大保德信中高等级债券型证券投资基金、光大保德信先进服务业灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信尊富 18 个月定期开放债券型证券投资基金、光大保德信多策略优选一年定期开放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	2017-04-08	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、光大保德信永利纯债债券型证券投资基金基金经理。
陈晓	基金经理	2017-04-08	-	6 年	陈晓女士，硕士。2007 年毕业于哈尔滨工业大学数学专业，2010 年获得南开大学精算学专业硕士学位。2010 年 7 月加入光大保德信基金管理有限公司，先后担任

					<p>投资部研究助理、固定收益研究员、固定收益高级研究员。现任光大保德信增利收益债券型证券投资基金基金经理、光大保德信信用添益债券型证券投资基金基金经理、光大保德信安和债券型证券投资基金基金经理、光大保德信安祺债券型证券投资基金基金经理、光大保德信安诚债券型证券投资基金基金经理、光大保德信永利纯债债券型证券投资基金基金经理、光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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：交易价差不趋向于零、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

宏观经济方面，2017 年国内经济整体呈现温和复苏的迹象。2017 年 4 季度我国 GDP 同比增长 6.8%，与 3 季度整体持平，全年增长 6.9%，比 2016 年增速回升 0.2 个百分点。从最新的 12 月 PMI 数据来看，官方制造业 PMI 为 51.6%，比上月回落 0.2 个百分点，但仍达到年均值水平。生产与新订单指标和上月相比出现回落，但幅度有限，绝对水平仍高于 10 月水平。2017 年 12 月份，规模以上工业增加值同比实际增长 6.2%，比 11 月份加快 0.1 个百分点。2017 年，全国规模以上工业增加值比上年实际增长 6.6%，增速较上年提高 0.6 个百分点。从经济数据的分项指标来看，2017 年全国固定资产投资比上年增长 7.2%，增速与 1-11 月份持平，比上年回落 0.9 个百分点。2017 年全国房地产开发投资比上年名义增长 7.0%，增速比 1-11 月份回落 0.5 个百分点，比上年加快 0.1 个百分点。2017 年全年社会消费品零售总额比上年增长 10.2%，增速比上年回落 0.2 个百分点。进出口方面，全年进出口总额比上年增长 14.2%，扭转了连续两年下降的局面。其中，出口增长 10.8%；进口增长 18.7%。

通货膨胀方面，2017 年全年 CPI 上涨 1.6%，涨幅比上年回落了 0.4 个百分点。食品价格下降 1.4%，是自 2003 年以来首次出现下降，主要受猪肉和鲜菜价格下降较多影响。非食品价格上涨 2.3%，涨幅比上年扩大 0.9 个百分点，其中，工业消费品价格上涨 1.7%，服务价格上涨 3.0%。2017 年全年 PPI 上涨 6.3%，结束了自 2012 年以来连续 5 年的下降态势。生产资料价格上涨 8.3%，影响 PPI 上涨约 6.13 个百分点。其中，涨幅较大的行业有石油和天然气开采业、煤炭开采和洗选业、黑色金属冶炼和压延加工业。

货币政策方面，央行在 2017 年全年三次上调公开市场操作利率，一次定向降准。三次上调公开市场利率分别是在春节前 1 月 24 日、春节后即上调 SLF 利率，美联储加息后 3 月 15 日、幅度为 10bp，美联储加息后 12 月 14 日、但幅度只有 5bp，而 6 月没有跟随美联储加息。一次降准发生在 9 月 30 日（国庆节前），但从 2018 年开始实施。货币政策保持稳健中性。

债券市场的运行方面，2017 年全年来看，10 年国债收益率上行 87BP 至 3.88%，10 年国开债收益率上行 114BP 至 4.82%。一季度债券收益率先是大幅上行，随后震荡下行。信贷数据超预期、资金面紧张等因素引发收益率上行。二季度市场在金融去杠杆基调下持续调整。4 月份银监会陆续出台整治“三违反”、“三套利”、“四不当”，银行进入到自查阶段。随着去杠杆全面铺开，债券收益率迅速突破前期高位，5 月 10 日 10 年国债收益率达到 3.69%。三季度债券市场处于窄幅震荡格局。四季度债券收益率大幅上行，10-11 月是 2017 年利率升幅相对较高且速度较快的一波。

在基金的日常操作中，该基金逐渐形成以信用债持仓为主，配合阶段性参与利率债行情的操作

风格，尽量控制组合收益的确定性，降低组合回撤风险。2017 年我们对于债券市场较为谨慎，基金配置久期较 2016 年进一步降低，组合继续偏防御，力争寻求确定性较大的收益。信用债资质方面，在 2017 年我们继续降低低等级信用债的配置，增持优质短端信用债资产，组合规避信用风险和流动性风险。

#### 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 1.69%，业绩比较基准收益率为 -0.34%，光大保德信岁末红利纯债债券 C 份额净值增长率为 1.53%，业绩比较基准收益率为 -0.34%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于债券市场方面，展望 2018 年，短期内债市整体仍然维持震荡格局，短端信用债资产具有较高的投资价值。2018 年国内经济呈现宏观稳、微观改善的格局，CPI 通胀压力上升，PPI 中枢下移；政策方面，金融去杠杆继续，资管新规落地关键年份，市场扰动较大；叠加全球经济延续复苏以及货币政策边际趋紧，因此，判断债市整体仍然维持震荡格局。但是考虑到债市已经经过一年半左右的大幅调整，目前收益率水平处在相对较高的中枢位置，且期限利差非常平坦，因此，投资短端信用债具有较好的收益回报。

在这种情况下，我们 2018 年的操作思路是在基本面和政策面尚未出现对债市较大利好之前，债券整体配置较稳健，组合久期较短，以短端信用债且适度加杠杆的方式争取获取较高的确定性收益。在具体投资方面，我们会继续根据基本面变化和市场变化调整组合久期，严控组合信用风险，规避低等级信用债的持仓，增持优质公司债或城投债，择机参与利率债的阶段性情来增强组合投资收益，争取提高组合收益率的确定性和稳定性。

#### 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验，并具有广泛的代表性。

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；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，本基金本报告期末未进行利润分配。

#### **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。

报告期内本基金未实施利润分配。

### 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

本报告期的基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师薛竞、陈腾签字出具了普华永道中天审字(2018)第 20907 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：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：	-	-
银行存款	1,119,276.17	757,417.34
结算备付金	-	9,678,454.37
存出保证金	5,915.51	3,560.93
交易性金融资产	362,981,949.50	514,292,809.10
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	362,981,949.50	514,292,809.10
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	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	7,718,453.08	11,511,342.26
应收股利	-	-
应收申购款	1,022.04	1,390.81
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>371,826,616.30</b>	<b>536,244,974.81</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2017 年 12 月 31 日</b>	<b>2016 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	88,879,666.68	117,919,650.12
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	337,699.06	31,267.43
应付管理人报酬	152,899.78	300,723.85
应付托管费	50,966.61	100,241.30
应付销售服务费	14,492.24	14,942.96
应付交易费用	23,174.70	22,137.84
应交税费	-	-
应付利息	61,114.80	40,106.67
应付利润	-	12,763,545.74
递延所得税负债	-	-
其他负债	149,000.00	319,000.04
<b>负债合计</b>	<b>89,669,013.87</b>	<b>131,511,615.95</b>

所有者权益：	-	-
实收基金	274,151,236.02	399,683,965.57
未分配利润	8,006,366.41	5,049,393.29
所有者权益合计	<b>282,157,602.43</b>	<b>404,733,358.86</b>
负债和所有者权益总计	<b>371,826,616.30</b>	<b>536,244,974.81</b>

注：1.报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额总额 274,151,236.02 份，其中 A 类基金份额总额为 232,508,368.03 份，基金份额净值为 1.0301 元；C 类基金份额总额为 41,642,867.99 份，基金份额净值为 1.0244 元。

2.根据《关于光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金提高估值精度并修改基金合同的公告》，自 2017 年 7 月 10 日起，基金提高估值精度并保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

## 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	<b>15,152,422.29</b>	<b>29,060,596.84</b>
1.利息收入	23,881,813.86	58,064,019.22
其中：存款利息收入	75,248.87	243,305.76
债券利息收入	23,711,670.77	57,760,008.81
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	94,894.22	60,704.65
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-12,423,430.94	-11,642,056.52
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-12,423,430.94	-11,642,056.52

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）	3,690,188.85	-17,384,740.44
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	3,850.52	23,374.58
<b>减：二、费用</b>	<b>6,544,994.39</b>	<b>13,446,277.07</b>
1. 管理人报酬	2,275,065.31	5,463,832.34
2. 托管费	758,355.20	1,821,277.52
3. 销售服务费	102,388.81	246,920.88
4. 交易费用	44,605.06	59,990.89
5. 利息支出	3,002,859.21	5,471,655.04
其中：卖出回购金融资产支出	3,002,859.21	5,471,655.04
6. 其他费用	361,720.80	382,600.40
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>8,607,427.90</b>	<b>15,614,319.77</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>8,607,427.90</b>	<b>15,614,319.77</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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	399,683,965.57	5,049,393.29	404,733,358.86
二、本期经营活动产生	-	8,607,427.90	8,607,427.90

的基金净值变动数（本期利润）			
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）	-125,532,729.55	-5,650,454.78	-131,183,184.33
其中：1.基金申购款	655,604,176.82	10,806,573.21	666,410,750.03
2.基金赎回款	-781,136,906.37	-16,457,027.99	-797,593,934.36
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	274,151,236.02	8,006,366.41	282,157,602.43
项目	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	767,220,344.70	24,455,157.57	791,675,502.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	15,614,319.77	15,614,319.77
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）	-367,536,379.13	-22,256,538.31	-389,792,917.44
其中：1.基金申购款	1,331,006,783.34	65,604,627.32	1,396,611,410.66
2.基金赎回款	-1,698,543,162.47	-87,861,165.63	-1,786,404,328.10
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-12,763,545.74	-12,763,545.74

金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	399,683,965.57	5,049,393.29	404,733,358.86

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：包爱丽，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人民币 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(以下简称“中国建设银行”)。

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，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，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、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。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。本基金的投资组合比例为: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 2018 年 3 月 23 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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财法规规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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。

### 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、基金销售机构
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
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
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,275,065.31	5,463,832.34
其中：支付销售机构的客户维护费	37,038.94	87,919.11

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
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	758,355.20	1,821,277.52

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		
	2017年1月1日至2017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	-	87,861.22	87,861.22
光大证券	-	69.87	69.87
建设银行	-	7,008.55	7,008.55
合计	-	94,939.64	94,939.64
获得销售服务费的各	上年度可比期间		



关联方名称	2016年1月1日至2016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	-	213,640.21	213,640.21
光大证券	-	72.89	72.89
建设银行	-	16,272.44	16,272.44
合计	-	229,985.54	229,985.54

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未与关联方进行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固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

#### 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		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年12月31日		2016年1月1日至2016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	1,119,276.17	39,469.87	757,417.34	90,166.79

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

金额单位：人民币元

本期					
2017年1月1日至2017年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：）	总金额

				股/张)	
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 股/张)	总金额
光大证券	1680417	16 国网债 02	新债网下 发行	500,000.00	49,920,000.00

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.8.7.1 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(2017 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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告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 2017 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 88,879,666.68 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
011758070	17 洋河 SCP002	2018-01-03	99.77	200,000.00	19,954,000.00
011763029	17 天业 SCP006	2018-01-03	99.70	200,000.00	19,940,000.00
041753021	17 河钢集 CP004	2018-01-03	100.36	200,000.00	20,072,000.00

041759027	17 义乌国资 CP002	2018-01-03	99.94	200,000.00	19,988,000.00
101666008	16 孚日 MTN001	2018-01-03	97.16	120,000.00	11,659,200.00
合计				920,000.00	91,613,200.00

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止, 本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### §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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	362,981,949.50	97.62
	其中：债券	362,981,949.50	97.62
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,119,276.17	0.30
8	其他各项资产	7,725,390.63	2.08
9	合计	371,826,616.30	100.00

#### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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

本基金本报告期内未持有股票。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未持有股票。

### 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,960,000.00	7.07
	其中：政策性金融债	19,960,000.00	7.07
4	企业债券	114,784,349.50	40.68
5	企业短期融资券	139,866,000.00	49.57
6	中期票据	88,371,600.00	31.32
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	362,981,949.50	128.65

### 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	101458012	14 龙净环 保 MTN001	200,000	20,726,000.00	7.35
2	041753021	17 河钢集 CP004	200,000	20,072,000.00	7.11
3	041759027	17 义乌国 资 CP002	200,000	19,988,000.00	7.08
4	011765005	17 鲁黄金 SCP009	200,000	19,986,000.00	7.08
5	170204	17 国开 04	200,000	19,960,000.00	7.07

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金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序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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于股指期货。

### 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	5,915.51
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,718,453.08
5	应收申购款	1,022.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,725,390.63

### 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	337	689,935.81	223,989,784.42	96.34%	8,518,583.61	3.66%
光大保德信岁末红利纯债债券 C	156	266,941.46	39,397,820.98	94.61%	2,245,047.01	5.39%
合计	493	556,087.70	263,387,605.40	96.07%	10,763,630.62	3.93%

### 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	9,815.80	0.00%
	光大保德信岁末红利纯债债券 C	39.60	0.00%
	合计	9,855.40	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	394,415,714.87	5,268,250.70
本报告期基金总申购份额	591,507,147.33	64,097,029.49
减：本报告期基金总赎回份额	753,414,494.17	27,722,412.20
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	232,508,368.03	41,642,867.99

## §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

经公司九届十一次董事会会议审议通过，自 2017 年 8 月 1 日起，董文卓先生正式担任公司副总经理一职。

2017 年 9 月 1 日，中国建设银行发布公告，聘任纪伟为中国建设银行资产托管业务部总经理。

### 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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期持有的基金未发生重大影响事件。

### 11.6 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 6 万元，目前该审计机构已提供审计服务的连续年限为 4 年。

### 11.7 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。

### 11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.8.1 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。

11.8.2 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	300,753,541.73	69.13%	1,967,000,000.00	100.00%	-	-
中金公司	134,294,599.57	30.87%	-	-	-	-

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017-01-01 至 2017-03-22	93,093,391.47	-	93,093,391.47	0.00	0.00%
	2	2017-03-29 至 2017-05-10	-	49,357,354.39	-	49,357,354.39	18.00%
	3	2017-03-29 至 2017-05-10	47,041,469.61	-	47,041,469.61	0.00	0.00%

产品特有风险

本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过20%的情形，可能面临单一投资者集中赎回的情况，从而：

- (1) 对基金的流动性造成冲击，存在对剩余投资者的赎回办理造成影响的风险。
- (2) 基金管理人因基金赎回的流动性要求致使部分投资受到限制，或因赎回费归入基金资产等原因，而导致基金资产净值波动的风险，影响基金的投资运作和收益水平。
- (3) 因基金资产规模过小，而导致部分投资不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略，或导致基金不能满足存续条件的风险。

本管理人将审慎评估大额申购对基金持有集中度的影响，在运作中保持合适的流动性水平，保护持有人利益。

光大保德信基金管理有限公司

二〇一八年三月二十七日

