

光大保德信量化核心证券投资基金

2012 第二季度报告

基金管理人:光大保德信基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年七月二十日

重要提示
基金管理人及董事承诺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。

基金管理人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年7月19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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的投资业绩并不表示其未来表现。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。

本报告期财务资料未经审计。
本报告自2012年4月1日起至6月30日止。

基金简称:光大保德信量化股票
基金代码:360001
交易代码:360001

基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2004年8月27日
报告期末基金份额总额:11,615,094,230.33份

投资目标:本基金追求长期持续稳定超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略:本基金通过光大保德信特有的量化投资为核心的多策略优化资产配置构建于或超越有效边界曲线上的投资组合。

业绩比较基准:90%\*富时中国A200指数+10%\*同业存款利率
风险收益特征:本基金风险收益特征属于证券投资基金中风险程度中等偏高的品种,按照风险收益配比原则对投资组合进行严格的风险管理。

基金管理人:光大保德信基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2012年4月1日至2012年6月30日)

1.本期已实现收益 -168,552,084.29
2.本期利润 165,785,888.98
3.加权平均基金份额本期利润 0.0142
4.期末基金份额净值 8,830,206,038.41
5.期末基金份额净值 0.7602

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

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率④, ①-③, ②-④

光大保德信量化核心证券投资基金
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
(2004年8月27日至2012年6月30日)

注:根据基金合同的约定,本基金建仓期为2004年8月27日至2005年2月26日。建仓期结束时本基金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比例限制。

4.1 基金管理人 或基金经理小组介绍
姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

钱钧 权益投资部基金经理 2010-12-7 13年
钱钧先生,硕士。毕业于南京大学国际工商管理学院,获工商管理硕士学位。曾在联合证券担任研究员,在西南证券担任基金经理等工作。

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。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易专项说明
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、组织架构设计、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。

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,在宽松的货币政策与政策放松预期的博弈中,市场延续了之前的震荡走势。整个季度来看,市场先扬后抑,沪深300指数增长1.30%2.7%。在行业层面,跌幅多少,差异较大。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现
本基金本报告期基金份额净增长率为1.88%,业绩比较基准收益率为2.01%。

4.5 管理人及基金经理承诺
管理人及基金经理承诺: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。

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:二〇一二年七月二十日

重要提示
基金管理人及董事承诺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。

基金管理人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年7月19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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的投资业绩并不表示其未来表现。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。

本报告期财务资料未经审计。
本报告自2012年4月1日起至6月30日止。

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9日
报告期末基金份额总额:432,251,851.48份

投资目标:本基金通过投资于信用等级高、流动性强的短期金融工具,为投资者提供流动性和增值,并有效分散基金资产本金安全和流动性风险,获得稳健的增值收益。
投资策略:本基金按照自上而下的方法对基金资产进行动态的大类资产配置,类属资产配置和证券选择。一方面根据政策预期要求通过积极的投资策略主动调整资产配置,把握政策带来的投资机会。

业绩比较基准:1.50%\*一年期定期存款利率+0.50%\*一年期银行活期存款利率
风险收益特征:本基金风险收益特征属于证券投资基金中低风险品种,风险程度低于其他类型的基金品种。本基金按照风险收益配比原则对投资组合进行严格的风险管理,将风险水平控制在既定目标之内,在风险限制范围内追求收益最大化。

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

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2012年4月1日至2012年6月30日)

1.本期已实现收益 5,409,971.09
2.本期利润 5,409,971.09
3.期末基金份额净值 432,251,851.48

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。由于货币市场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。

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

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率④, ①-③, ②-④

光大保德信货币市场基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2005年6月9日至2012年6月30日)

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:二〇一二年七月二十日

位,精选行业,精选个股。
§ 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(%)

Table with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

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(%)

Table with columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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(%)

Table with columns: 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(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。

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
本基金本报告期末未持有债券。

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
本报告期末本基金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 投资组合报告附注
5.8.1 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受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情况。

5.8.2 本基金投资超出基金合同规定的备选股票库。
5.8.3 其他各项资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.4 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。

5.8.5 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中不存在流通受限的情况。

§ 6 开放式基金份额变动
单位:份
本报告期初基金份额总额 11,661,731,947.05
本报告期基金总申购份额 169,780,935.68

7.1 备查文件目录
1.中国证监会批准光大保德信量化核心证券投资基金设立的文件
2.光大保德信量化核心证券投资基金合同
3.光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书

7.2 存放地点
上海市延安路222号外滩中心大厦46层本基金管理人办公地址。
7.3 查阅方式
投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅,投资者对本报告如有疑问,可咨询本基金管理人。客户服务中心电话:400-820-2888-021-53524620。公司网址:www.epf.com.cn。

光大保德信基金管理有限公司
二〇一二年七月二十日

光大保德信货币市场基金

2012 第二季度报告

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:二〇一二年七月二十日

重要提示
基金管理人及董事承诺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。

基金管理人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年7月19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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的投资业绩并不表示其未来表现。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。

本报告期财务资料未经审计。
本报告自2012年4月1日起至6月30日止。

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9日
报告期末基金份额总额:432,251,851.48份

投资目标:本基金通过投资于信用等级高、流动性强的短期金融工具,为投资者提供流动性和增值,并有效分散基金资产本金安全和流动性风险,获得稳健的增值收益。

业绩比较基准:1.50%\*一年期定期存款利率+0.50%\*一年期银行活期存款利率
风险收益特征:本基金风险收益特征属于证券投资基金中低风险品种,风险程度低于其他类型的基金品种。本基金按照风险收益配比原则对投资组合进行严格的风险管理,将风险水平控制在既定目标之内,在风险限制范围内追求收益最大化。

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

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2012年4月1日至2012年6月30日)

1.本期已实现收益 5,409,971.09
2.本期利润 5,409,971.09
3.期末基金份额净值 432,251,851.48

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。由于货币市场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。

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

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率④, ①-③, ②-④

光大保德信货币市场基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2005年6月9日至2012年6月30日)

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:二〇一二年七月二十日

光大保德信均衡精选股票型证券投资基金

2012 第二季度报告

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:二〇一二年七月二十日

重要提示
基金管理人及董事承诺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2012年7月19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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的投资业绩并不表示其未来表现。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。

本报告期财务资料未经审计。
本报告自2012年4月1日起至6月30日止。

基金简称:光大保德信均衡精选股票
基金代码:360010
交易代码:360010

基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2009年4月4日
报告期末基金份额总额:134,777,063.73份

投资目标:通过投资于具备优良成长前景且估值水平相对合理或被低估的上市公司股票,实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略:本基金主要采用“自下而上”的资产配置策略,以精选个股为主,兼顾股票资产在行业间的合理配置;在形成最终股票投资组合后,本基金还将根据宏观经济及证券市场状况调整大类资产配置比例。本基金主要采取国际通用的GARP选股模型进行个股的选择。

业绩比较基准:75%\*沪深300指数收益率+25%\*中国国债全价指数收益率
风险收益特征:本基金为主动操作的股票型基金,属于证券投资基金中预期收益和风险均较高的基金品种。

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

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2012年4月1日至2012年6月30日)

1.本期已实现收益 -4,774,220.42
2.本期利润 1,471,983.45
3.加权平均基金份额本期利润 0.0108
4.期末基金份额净值 123,343,685.75
5.期末基金份额净值 0.9152

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

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率④, ①-③, ②-④

光大保德信均衡精选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
(2009年3月4日至2012年6月30日)

注:根据基金合同的约定,本基金建仓期为2009年3月4日至2009年9月3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限制。

4.1 基金管理人 或基金经理小组介绍
姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

黄素丽 基金经理 2010-4-15 16年
黄素丽女士,硕士。毕业于美国加州大学圣地亚哥分校,获经济学硕士学位。曾在台湾保德信担任国际证券投资部基金经理,台湾富凯信公司担任投资部基金经理。现担任光大保德信基金研究部副经理,台湾协和证券投资担任研究部副经理,台湾富凯信证券投资担任研究部副经理,台湾富凯信证券投资担任研究部副经理等工作。

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。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易专项说明
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、组织架构设计、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。

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
2012年上半年,中国经济出现震荡走势,2012年开市以来预期通压力舒缓,货币政策有望放松,A股连续两个月上涨,但三月以后经济数据不佳,新增信贷与货币数据不如预期,导致股指出现震荡下行的走势。整体来看,2012年上半年沪深300指数上涨1.81%,沪深300上涨4.94%,深成指上涨6.52%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现
本基金本报告期基金份额净增长率为1.05%,业绩比较基准收益率为0.52%。

4.5 管理人及基金经理承诺
管理人及基金经理承诺: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。

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:二〇一二年七月二十日

光大保德信货币市场基金

2012 第二季度报告

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:二〇一二年七月二十日

重要提示
基金管理人及董事承诺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。

基金管理人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年7月19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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的投资业绩并不表示其未来表现。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。

本报告期财务资料未经审计。
本报告自2012年4月1日起至6月30日止。

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9日
报告期末基金份额总额:432,251,851.48份

投资目标:本基金通过投资于信用等级高、流动性强的短期金融工具,为投资者提供流动性和增值,并有效分散基金资产本金安全和流动性风险,获得稳健的增值收益。

业绩比较基准:1.50%\*一年期定期存款利率+0.50%\*一年期银行活期存款利率
风险收益特征:本基金风险收益特征属于证券投资基金中低风险品种,风险程度低于其他类型的基金品种。本基金按照风险收益配比原则对投资组合进行严格的风险管理,将风险水平控制在既定目标之内,在风险限制范围内追求收益最大化。

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

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2012年4月1日至2012年6月30日)

1.本期已实现收益 5,409,971.09
2.本期利润 5,409,971.09
3.期末基金份额净值 432,251,851.48

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。由于货币市场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。

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

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率④, ①-③, ②-④

光大保德信货币市场基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2005年6月9日至2012年6月30日)

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:二〇一二年七月二十日

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:二〇一二年七月二十日

重要提示
基金管理人及董事承诺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。

我们将综合考虑上市公司的增长潜力和市场估值水平,在最大范围内发现具有投资价值的股票,选择具有优良成长前景且价格合理或被低估的上市公司股票,以精选个股为主,兼顾股票资产在行业间的合理配置,以实现基金资产的长期稳定增值。

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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的投资业绩并不表示其未来表现。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。

本报告期财务资料未经审计。
本报告自2012年4月1日起至6月30日止。

基金简称:光大保德信均衡精选股票
基金代码:360010
交易代码:360010

基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2009年4月4日
报告期末基金份额总额:134,777,063.73份

投资目标:通过投资于具备优良成长前景且估值水平相对合理或被低估的上市公司股票,实现基金资产的长期稳定增值。

业绩比较基准:75%\*沪深300指数收益率+25%\*中国国债全价指数收益率
风险收益特征:本基金为主动操作的股票型基金,属于证券投资基金中预期收益和风险均较高的基金品种。

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

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2012年4月1日至2012年6月30日)

1.本期已实现收益 -4,774,220.42
2.本期利润 1,471,983.45
3.加权平均基金份额本期利润 0.0108
4.期末基金份额净值 123,343,685.75
5.期末基金份额净值 0.9152

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

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率④, ①-③, ②-④

光大保德信均衡精选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
(2009年3月4日至2012年6月30日)

注:根据基金合同的约定,本基金建仓期为2009年3月4日至2009年9月3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限制。

4.1 基金管理人 或基金经理小组介绍
姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

黄素丽 基金经理 2010-4-15 16年
黄素丽女士,硕士。毕业于美国加州大学圣地亚哥分校,获经济学硕士学位。曾在台湾保德信担任国际证券投资部基金经理,台湾富凯信公司担任投资部基金经理。现担任光大保德信基金研究部副经理,台湾协和证券投资担任研究部副经理,台湾富凯信证券投资担任研究部副经理等工作。

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。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易专项说明
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、组织架构设计、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。

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
2012年上半年,中国经济出现震荡走势,2012年开市以来预期通压力舒缓,货币政策有望放松,A股连续两个月上涨,但三月以后经济数据不佳,新增信贷与货币数据不如预期,导致股指出现震荡下行的走势。整体来看,2012年上半年沪深300指数上涨1.81%,沪深300上涨4.94%,深成指上涨6.52%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现
本基金本报告期基金份额净增长率为1.05%,业绩比较基准收益率为0.52%。

4.5 管理人及基金经理承诺
管理人及基金经理承诺: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。

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:二〇一二年七月二十日

光大保德信货币市场基金

2012 第二季度报告

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:二〇一二年七月二十日

重要提示
基金管理人及董事承诺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。

基金管理人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年7月19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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的投资业绩并不表示其未来表现。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。

本报告期财务资料未经审计。
本报告自2012年4月1日起至6月30日止。

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9日
报告