

2013年8月24日 星期六

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:二〇一三年八月二十四日

重要提示

基金管理人的董事、监事及高级管理人员在本基金担任虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对内容的真实性、准确性、完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告经三分之二以上独立董事签字并发表意见。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据基金合同的规定，于2013年8月23日复核了本报告书中的财务状况、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，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告全文。

本报告摘要仅供半年度报告正文、投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告全文。

本报告期财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	光大保德信量化核心证券投资基金
基金主代码	360001
交易代码	360001

契约型开放式

2004年8月27日

光大保德信基金管理有限公司

中国光大银行股份有限公司

报告期末基金份额总额

10,577,639,827.19份

基金份额存续期

不定期

2.2 基金产品声明

本基金追求长期持续稳定的超额收益

本基金通过量化技术以量化投资为核心的多重优化

保值体系综合考虑有效边界曲线的投资组合，在构建

投资组合中综合考虑收益要素及风险因素，并通过投资组合

优化器构建动态优化投资组合，确保投资组合风险收益特

征符合预期目标。本基金在正常市场情况下不作主动资产配

置，即股票、现金等类资产持有比例保持相对固定。

股票品种：股票型

90%

现金：10%

由于持有股票资产的市值波动导致仓位变化，股票持有

比例允许存在一定上下浮动。

业绩比较基准

90%×中国A股指数+10%同业存款利率。

风险收益特征

本基金风险收益特征属于债券投资基金在全风险程度中等偏高

的品种，按照风险收益比原则对投资组合进行严格的风险

管理，在风险限制范围内追求收益最大化。

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 中国光大银行股份有限公司

姓名 徐睿 张建春

信息披露负责人 联系电话 021-33074700-3110

电子邮箱 epf@epf.com.cn

客户服务电话 400-520-2888,021-

553524620

传真 021-63351512

010-63639132

2.4 信息披露方式

基金半年度报告正文的管理人

www.epf.com.cn

基金半年度报告备置地点

光大保德信基金管理有限公司、中国光大银行股份有限公司的办公场所。

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 利润数据和指标 报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)

本期实现收益 404,021,845.72

本期利润 -223,639,701.99

加权平均基金份额本期利润 -0.2025

本期基金份额净值增长率 -3.10%

3.1.2 期末数据和指标 报告期末(2013年6月30日)

期末可供分配基金份额利润 -0.0082

基金份额净值 8,039,971,512.77

基金份额净值增长率 0.7601

注:①本期实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利息收入已实现收益加上本期公允价值变动收益。②本期基金份额净值标准差率为0.50%。③本基金业经评估并扣除了认购、申购、赎回费用后,持有人实际获得的收益率将低于公布的收益率。

④期间可供分配利润采用月末资产负债表中未分配利润与未分配利润中实现部分的孰低数。

3.2 基金净值的表现

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

阶段 份额净值增长率(%) 增长率标准差(%)

过去一个月 -13.99% 1.86%

过去二个月 -6.70% 1.42%

过去六个月 -3.10% 1.42%

过去一年 -0.01% 1.27%

过去两年 4.82% 1.33%

成立以来 16.06% 1.76%

业绩比较基准 11.24% 1.65%

注:①本基金成立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

②本基金业经评估并扣除了认购、申购、赎回费用后,持有人实际获得的收益率将低于公布的收益率。

③本基金业经评估并扣除了认购、申购、赎回费用后,持有人实际获得的收益率将低于公布的收益率。

④期间可供分配利润采用月末资产负债表中未分配利润与未分配利润中实现部分的孰低数。

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

2004年8月27日至2013年6月30日)

单位:人民币元

3.2.3 与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图

2004年8月27日至2013年6月30日)

注:按基金合同的规定,本基金在每期为2004年8月27日至2005年2月26日。建仓期结束时本基金各项目配置比例与本基金合同规定的比例限制及投资范围的比例限制。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理概况

4.1.1 基金管理人

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共同打造的保德信基金管理有限公司,公司总部设在上海,注册资本为人民币1亿元,股东两家股东各占55%和45%的股份。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理等中国证监会许可的其他业务,以及取得许可的凭证类经营业务(以下简称“凭证类经营服务”),今后,将在法律法规允许的范围内为类投资品提供更多资产管理服务。

截至2013年6月30日,光大保德信旗下管理着14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、光大保德信红利股票型证券投资基金、光大保德信新嘉道股票型证券投资基金、光大保德信优势配置型证券投资基金、光大保德信增强型证券投资基金、光大保德信稳健型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金。

4.1.2 基金经理及基金经理的简介

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

钱钧 权益投资总监、本基金基金经理 2010-12-07 14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,曾在联华超市担任高级经理,现任任光大保德信基金管理有限公司任高级研究员,现就任光大保德信权益投资总监,现就任光大保德信权益投资总监,现就任光大保德信量化核心证券投资基金基金经理。

注:①任职日期和离任日期分别为公司决定的聘任日期和解聘日期;

②任职期间,本公司对基金业经评估并扣除了认购、申购、赎回费用后,持有人实际获得的收益率将低于公布的收益率。

③管理人报告期间本基金未发生违反《信息披露办法》规定的情况。

④报告期内,本公司管理人所持有的基金份额和基金资产,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。

⑤管理人报告期间公平交易情况的专项说明

⑥报告期内,本公司管理人所持有的基金份额和基金资产,在严格控制风险的前提下,未发生交易所公开竞价区间内反向交易。

⑦管理人报告期间基金的投资策略和业绩表现说明

⑧报告期内基金投资策略和运作分析

⑨2013年中,新的纲领逐步落实了宏观经济政策,稳增长、调结构大政已定,但投资者对于经济增长逐步放缓的态势担忧,同时国际国内流动性呈现收缩,A股市场的回调压力较大,但资金流向却依然向新兴产业倾斜,如医药、新能源、新材料、新能源汽车等新兴产业的发展,煤炭、钢铁、有色、煤炭等产能过剩的周期性行业则表现不佳,投资者对于新兴产业的前景形成了较好的共识并积极买入。报告期内,本基金管理人密切关注宏观经济政策,并结合自身的投资风格,在把握好风险的前提下,适时调整投资组合,从而更好的把握住结构性的投资机会,并取得了良好的投资回报。

⑩管理人报告期间公平交易情况的专项说明

⑪报告期内,本基金业经评估并扣除了认购、申购、赎回费用后,持有人实际获得的收益率将低于公布的收益率。

⑫管理人报告期间基金的偏离度情况

⑬报告期内,本基金业经评估并扣除了认购、申购、赎回费用后,持有人实际获得的收益率将低于公布的收益率。

⑭管理人报告期间基金的流动性情况

⑮管理人报告期间基金的现金头寸情况

⑯管理人报告期间基金的资产准备情况

⑰管理人报告期间基金的资产准备情况

⑱管理人报告期间基金的资产准备情况

⑲管理人报告期间基金的资产准备情况

⑳管理人报告期间基金的资产准备情况

㉑管理人报告期间基金的资产准备情况

㉒管理人报告期间基金的资产准备情况

㉓管理人报告期间基金的资产准备情况

㉔管理人报告期间基金的资产准备情况

㉕管理人报告期间基金的资产准备情况

㉖管理人报告期间基金的资产准备情况

㉗管理人报告期间基金的资产准备情况

㉘管理人报告期间基金的资产准备情况

㉙管理人报告期间基金的资产准备情况

㉚管理人报告期间基金的资产准备情况

㉛管理人报告期间基金的资产准备情况

㉜管理人报告期间基金的资产准备情况

㉝管理人报告期间基金的资产准备情况

㉞管理人报告期间基金的资产准备情况

㉟管理人报告期间基金的资产准备情况

㉟管理人报告期间基金的资产准备情况