光大保德信均衡精选股票型证券投资基金

【2013】第三季度报告

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:二〇一三年十月二十三日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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2013年10月22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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	光大保德信均衡精选股票
基金主代码	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3月4日
报告期末基金份额总额	156,331,923.94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健增值。
投资策略	本基金将主要采用"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确定大类证券资产的配置比例。本基金主要选取国际上普遍采用的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%×天相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 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7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	3,763,662.65
2.本期利润	14,608,724.91
3.加权平均基金份额本期利润	0.1081
4.期末基金资产净值	142,434,431.84
5.期末基金份额净值	0.9111

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

阶段	净值增长率①	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	16.82%	2.10%	7.24%	1.07%	9.58%	1.03%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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2013年9月30日)

注:根据基金合同的规定,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范围。

§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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李阳	基金经理	2013-5-21	-	16年	李阳先生,1996年至1999年在君安证券投资部担任投资经理;1999年至2003年在国泰君安证券投资部、国际部担任投资经理;2003年至2004年在国泰君安证券(香港)有限公司担任投资经理;2004年3月加入光大保德信基金管理有限公司先后担任交易员、高级交易员、交易主管、交易总监,并于2009年6月转岗至投资部担任投资经理/高级研究员;2010年3月担任中小盘基金基金经理助理工作,并于2010年7月至2013年5月担任光大保德信中小盘股票型证券投资基金基金经理。现任本基金基金经理。

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。报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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、组织结构设计、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。本报告期,本基金管理人各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,未发现存在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

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金与其他投资组合未发生交易所公开竞价同日反向交易。

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

国内市场方面,2013年第三季度上证指数总体呈现震荡走高走势,上半年年末1979点上涨至2174点,上涨9.88%,中小板指数和创业板指数在此期间表现相对强势,期间市场的相对超额收益来自偏小盘、非周期高估值类行业选择,尤其是信息服务、信息设备行业表现相对突出。

本季度初,本基金预判2013年下半年,我国的经济仍然较弱,盈利的下降使得市场不太可能出现趋势性的机会,而流动性相对宽裕,这种经济和流动性搭配相对利空大盘,利多中小盘。目前市场对经济弱反弹相对肯定,在政策中性的假设下,我们仍然认为市场在未来几个月总体趋势可能是下跌的,但我们也认识到经济调结构是上下的共识,是大势所趋,因此在行业配置方面,我们已经偏向了新兴成长行业,增加了非周期类行业配置,在非周期性行业中,我们相对看好医药、TMT等,主题投资看好与信息化相关的安防行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内份额净值增长率为16.82%,业绩比较基准收益率为7.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013年第四季度,影响四季度市场走势的不确定因素相对较多,我们判断市场走势会相对比较复杂。经济层面,预判经济同比的年中高点大概率出现在8、9月份,第四季度经济的反弹动量可能减弱,但增速相对平稳。政策层面,IPO重启和海外QE的退出大概率发生在四季度,将对市场产生负面影响,十八届三中全会可能在简政放权、金融、土地等一系列改革等方向上会有所突破,但市场对于政策红利已有部分反应,因此我们预期政策在四季度对市场的影响偏中性。

本季度末,光大均衡精选基金投资方向主要对医药、食品和电子信息等板块进行了重点布局,未来投资主线:在把握大环境和把握主题投资的基础上,坚持发掘新兴产业行业中符合产业政策发展方向的公司,以期其高增长的潜力反映在业绩表现上。

§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(%)
1	权益投资	127,881,076.10	86.21
	其中:股票	127,881,076.10	86.21
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	4,500,000.00	3.03
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	10,210,865.91	6.88
6	其他各项资产	5,748,761.67	3.88
7	合计	148,340,703.68	100.00

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(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	89,084,889.61	62.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	6,517,591.00	4.58
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,901,175.49	17.48
J	金融业	2,124,900.00	1.49
K	房地产业	4,070,000.00	2.86
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	1,182,520.00	0.83
	合计	127,881,076.10	89.78

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(%)
1	300074	华平股份	435,135	12,562,347.45	8.82
2	600804	鹏博士	388,910	7,210,391.40	5.06
3	600887	伊利股份	159,949	7,146,521.32	5.02
4	000538	云南白药	59,924	7,014,703.44	4.92
5	002241	歌尔声学	165,000	6,976,200.00	4.90
6	600196	复星医药	500,000	6,945,000.00	4.88
7	002415	海康威视	260,000	6,864,000.00	4.82
8	002236	大华股份	149,933	6,833,946.14	4.80
9	600535	天士力	149,915	6,749,173.30	4.74
10	600422	昆明制药	250,000	6,745,000.00	4.74

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投资债券。

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投资债券。

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

本基金本报告期末未投资资产支持证券。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金合同中尚无股指期货的投资政策。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	150,713.40
2	应收证券清算款	4,524,389.96
3	应收股利	-
4	应收利息	27,711.98
5	应收申购款	1,045,946.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,748,761.67

5.10.4 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有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 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情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	140,914,673.13
本报告期基金总申购份额	59,432,407.99
减:本报告期基金总赎回份额	44,015,157.18
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	156,331,923.94

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

无

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准光大保德信均衡精选股票型证券投资基金设立的文件

2、光大保德信均衡精选股票型证券投资基金基金合同

3、光大保德信均衡精选股票型证券投资基金招募说明书

4、光大保德信均衡精选股票型证券投资基金托管协议

5、光大保德信均衡精选股票型证券投资基金法律意见书

6、基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程

7、基金托管人业务资格批件和营业执照

8、报告期内光大保德信均衡精选股票型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

9、中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

上海市延安东路222号外滩中心大厦46层本基金管理人办公地址。

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。 投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人。 客户服务中心电话:4008-202-888,021-53524620。 公司网址:www.epf.com.cn。

光大保德信基金管理有限公司
二〇一三年十月二十三日

光大保德信量化核心证券投资基金

【2013】第三季度报告

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:二〇一三年十月二十三日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月22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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	光大保德信量化股票
基金主代码	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	10,234,773,783.92份
投资目标	本基金追求长期持续稳定超出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以量化投资为核心的多重优化保障体系构建处于或接近有效边际曲线的投资组合。在构建投资组合时综合考虑收益因素及风险因素,并通过投资组合优化器构建并动态优化投资组合,确保投资组合风险收益特征符合既定目标。本基金在正常市场情况下不作主动资产配置,即股票/现金等各类资产持有比例保持相对固定。 投资品种基准比例:股票90% 现金10% 由于持有股票资产的市值波动导致仓位变化,股票持有比例允许在一定范围(上下5%)内浮动。
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,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	中国光大银行股份有限公司

§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7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	72,287,367.36
2.本期利润	1,375,245,389.45
3.加权平均基金份额本期利润	0.1318
4.期末基金资产净值	9,122,842,663.89
5.期末基金份额净值	0.8914

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。

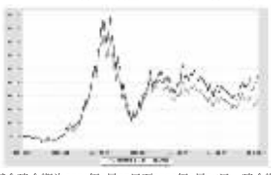
3.2 基金净值表现

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

阶段	净值增长率①	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	17.27%	1.35%	9.19%	1.28%	8.08%	0.07%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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2013年9月30日)



注:根据基金合同的规定,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范围。

§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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
钱钧	权益投资总监、本基金基金经理	2010-12-7	-	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,曾在联合证券担任高级研究员,在西部证券担任投资经理助理等工作。2007年1月加入光大保德信基金管理有限公司任高级研究员,现任光大保德信权益投资总监、光大保德信量化核心证券投资基金基金经理。

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。报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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、组织结构设计、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。本报告期,本基金管理人各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,未发现存在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

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金与其他投资组合未发生交易所公开竞价同日反向交易。

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

二季度以来,尽管海外股市不断创出金融危机以来的新高,但国内由于打击贪腐、房价不断超预期的上涨使投资者看淡宏观经济,而监管层的点刹政策更使投资者预期向悲观急剧转化,资金价格的暴涨使股市在二季度末呈现崩溃性下跌。

面对这一严峻局势,管理层首先在资金监管的态度上有所放松,其次发改委在投资、其他部委在消费、出口上也分别采取了一定措施,及时稳定了预期。随着GDP、PMI数据的逐步好转,投资者从季初对经济增速预期再度放缓以及资金紧张的午夜惊魂中逐步恢复了情绪,沪深综指分别从季度初的1965.99点和7649.30点分别上涨到2174.67点和8514.57点。分别上涨9.88%和10.66%。

行业方面,7、8月投资者的注意力仍集中在医药、TMT、环保、等中小板、创业板小市值公司,但随着经济恢复的扩散,9月以来前期受到抛弃的金融、周期、投资品等也终于有所表现。板块方面,随着新领导层在自贸区、国企改革、破除行业垄断和大力推行市场化等方面的表态,新的投资热点开始形成。

量化核心基金在三季度的表现有所改善。一是高仓位的坚持本身就使量化获益匪浅;其次在结构上,量化在季度内做了一定的调整,从季度初的适当增持中小板、创业板调整到季度末的对金融、周期、投资品的适度加仓。尽管这些调整在时机上不一定完全踏准了节奏,但总体而言对基金的表现贡献是比较显著的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内份额净值增长率为17.27%,业绩比较基准收益率为9.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

时间是检验一切的试金石,站在四季度初这个金色秋季的时点,价值投资者们的信心将有所恢复。目前的市场估值差异已经达到甚至超越了历史峰值。我们不否认一些公司在结构转型的大背景下未来仍有广阔发展空间,但"一人得道,鸡犬升天"的景象不可能永远持续,在宏观经济仍持续疲弱的背景下,随着中报的逐步披露,公司业绩、中小板创业板股票的走势也将出现分化将是大概率事件。

我们认为,今年前三季度的资金结构化趋势将有所调整,A股市场今年以来"反复且狂热地追求新经济、成长型公司,宁愿追逐短期的市场热点也坚决回避诸如银行、地产、汽车、有色、煤炭等产能过剩型的周期性产业"的特征将会出现一定转变,市场将会出现新的热点和趋势。

给我一个机会,量化核心将竭力争取给投资者更多回报。

§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(%)
1	权益投资	8,580,825,625.62	93.57
	其中:股票	8,580,825,625.62	93.57
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	541,510,017.69	5.90
6	其他各项资产	48,621,804.31	0.53
7	合计	9,170,957,447.62	100.00

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(%)
A	农、林、牧、渔业	88,309,411.18	0.97
B	采矿业	150,090,125.39	1.65
C	制造业	3,153,209,623.78	34.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	458,328,965.00	5.02
E	建筑业	93,023,143.27	1.02
F	批发和零售业	420,683,254.88	4.61
G	交通运输、仓储和邮政业	687,816,085.04	7.54
H	住宿和餐饮业	5,980,000.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	541,340,493.33	5.93
J	金融业	2,004,602,584.67	21.97
K	房地产业	560,915,514.45	6.15
L	租赁和商务服务业	28,227,395.84	0.31
M	科学研究和技术服务业	968,000.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	127,981,248.63	1.40
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	57,486,117.91	0.63
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	201,863,662.25	2.21
	合计	8,580,825,625.62	94.06

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(%)
1	601166	兴业银行	56,739,711	633,782,571.87	6.95
2	601601	中国太保	21,927,835	385,272,060.95	4.22
3	600221	海南航空	164,881,800	336,358,872.00	3.69
4	600000	浦发银行	32,203,807	324,936,412.63	3.56
5	600104	上汽集团	22,034,920	298,132,467.60	3.27
6	600009	上海机场	16,830,123	254,639,760.99	2.79
7	600886	国投电力	52,749,980	194,647,426.20	2.13
8	000616	亿城股份	51,171,634	187,799,896.78	2.06
9	600256	广汇能源	19,000,487	179,364,597.28	1.97
10	300074	华平股份	6,170,956	178,155,499.72	1.95

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期内未持有债券。

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

本基金本报告期内未持有债券。

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

报告期内本基金未投资资产支持证券。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 根据2013年4月23日海通证券股份有限公司《海通证券股份有限公司关于收到上海证监局行政监管措施决定书的公告》,海通证券股份有限公司收到中国证券监督管理委员会上海监管局《关于对海通证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》(沪证监决【2013】12号),中国证券监督管理委员会上海监管局决定根据《证券公司业务(产品)创新工作指引(试行)》的规定,就海通证券发行的"一海通财"系列产品系现行监管规则未予明确的创新型产品,未向中国证监会机构监管部履行创新产品方案报送义务,责令海通证券进行整改。海通证券公司已针对上述事件整改结束,本基金管理人认为海通证券股份有限公司负面事件影响已经基本消化。本基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

根据2013年7月20日广汇能源股份有限公司《"汇能源股份有限公司关于控股子公司新疆广汇新能源有限公司"3?6"爆炸燃烧事故处理结果的公告》,2013年7月18日,广汇能源股份有限公司的控股子公司-新疆广汇新能源有限公司收到哈密地区安全生产监督管理局《关于新疆广汇新能源有限公司"3?6"爆炸燃烧事故的处理决定》(哈地安监管字【2013】95号)。经哈密地区安委会审定,新能源公司"3?6"爆炸燃烧事故属于较大生产安全责任事故,事故类别为爆炸燃烧事故。经哈密地区安全生产监督管理局认定,对相关责任单位及责任人给予相应处罚。其中:由于新能源公司安全管理不到位,未能及时检查消除事故隐患,导致事故发生给予20万元的行政处罚;新能源公司董事长向东等3名责任人分别给予3万-0.3万元的行政处罚;新能源公司造气车间造气回收班长俞克昌等3名操作人员要求新能源公司分别依照公司规章进行处理。

广汇能源股份有限公司在该事故发生之后,采取多项措施,开展安全生产整改。鉴于广汇能源股份有限公司针对上述事故的整改已经结束,并且该装置已经恢复正常生产。本基金管理人认为广汇能源股份有限公司的此事故的负面影响已经基本消除。本基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

本基金投资的前十名证券的发行主体除上述公司之外,本期未出现被监管部门立案调查,并且未在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2 本基金未投资超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,958,661.50
2	应收证券清算款	45,375,717.08
3	应收股利	-
4	应收利息	102,595.32
5	应收申购款	1,184,830.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	48,621,804.31

5.10.4 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。

5.10.5 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不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	10,577,639,827.19
本报告期基金总申购份额	139,193,280.66
减:本报告期基金总赎回份额	482,059,323.93
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	10,234,773,783.92

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

无

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无

§9 备查文件目录

9.1 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

4、光大保德信量化核心证券投资基金托管协议

5、光大保德信量化核心证券投资基金法律意见书

6、基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程

7、基金托管人业务资格批件和营业执照

8、报告期内光大保德信量化核心证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

9、中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

上海市延安东路222号外滩中心大厦46层本基金管理人办公地址。

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。 投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人。 客户服务中心电话:4008-202-888,021-53524620。 公司网址:www.epf.com.cn。

光大保德信基金管理有限公司
二〇一三年十月二十三日

光大保德信添盛双月理财债券型证券投资基金

【2013】第三季度报告

基金管理人:光大保德信基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年十月二十三日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月22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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	光大保德信添盛双月理财债券
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月5日
报告期末基金份额总额	114,863,431.25份
投资目标	本基金通过投资于银行存款等投资标的,力争获得超过人民币3个月银行定期存款利率(税后)的投资回报。
投资策略	本基金将综合考虑各类投资品种的收益和风险特征,在保证基金资产安全性的基础上力争为投资人创造稳定的收益。同时,本基金将关注宏观经济走势、货币政策和财政政策的变化,结合对货币市场利率变动的预期,对投资组合进行管理。银行存款一般具有收益稳定、风险低等基本特征,特别是机构投资者在投资银行存款时,往往能获得比普通投资者更高的收益率。本基金资产可以投资于上市商业银行、大型商业银行、国有商业银行、股份制商业银行、城市商业银行、邮政储蓄银行、农村商业银行、外资银行中具有证券投资基金托管人资格、证券投资基金代销业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的商业银行的协议存款。若本基金投资的协议存款中未约定可提前支取并无利息损失的,则该笔存款的到期日不得晚于该运作周期的第一个开放日。本基金在投资银行存款时将对不同银行的银行存款收益率做深入的分析,同时结合各银行的信用等级、存款期限等因素的研究,综合考量整体利率市场环境及其变动趋势,在严格控制风险的前提下决定各银行存款的投资比例。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为人民币3个月银行定期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的风险较低的品种,其预期收益和预期风险低于普通债券型基金、混合型基金和股票型基金。
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	光大保德信添盛双月理财债券A类 / 光大保德信添盛双月理财债券B类
下属两级基金的交易代码	360021 / 360022
报告期末下属两级基金的份额总额	92,732,570.22份 / 22,130,861.03份

§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7月1日-2013年9月30日)	
	光大保德信添盛双月理财债券A类	光大保德信添盛双月理财债券B类
1.本期已实现收益	436,384.55	271,185.47
2.本期利润	436,384.55	271,185.47
3.期末基金资产净值	92,732,570.22	22,130,861.03

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,由于本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收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1.光大保德信添盛双月理财债券A类

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.0527%	0.0027%	0.6644%	0.0000%	0.3883%	0.0027%

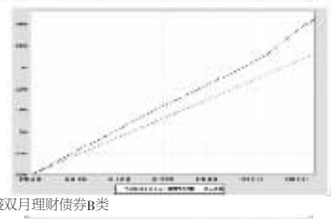
2.光大保德信添盛双月理财债券B类

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.1124%	0.0027%	0.6644%	0.0000%	0.4480%	0.0027%

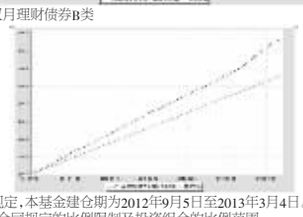
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

光大保德信添盛双月理财债券型证券投资基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年9月5日至2013年9月30日)

1、 光大保德信添盛双月理财债券A类



2、光大保德信添盛双月理财债券B类



注:根据基金合同的规定,本基金建仓期为2012年9月5日至2013年3月4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范围。

§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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
韩爱丽	基金经理	2012-9-5	-	6年	韩爱丽女士,复旦大学经济学硕士,CFA。2006年7月至2010年8月在上海浦东发展银行总行资金部从事固定收益交易、研究工作;2010年8月加盟光大保德信基金管理有限公司,任高级债券研究员,现任光大保德信货币市场