

光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金

[2015] 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:二〇一五年十月二十日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及高级管理人员保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导陈述或重大遗漏，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。

基金托管人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导陈述或重大遗漏，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。

基金合同由基金管理人和基金托管人订立，基金份额持有人按其持有的基金份额，享受权利并承担义务。

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的财产。基金管理人、基金托管人不以自有财产承担本基金的亏损或损害赔偿责任，但基金管理人、基金托管人未履行勤勉尽责义务时除外。

基金管理人承诺以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金过往业绩并不代表基金未来表现。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。

本基金由光大保德信基金管理有限公司管理。

本基金报告期自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 大光保德信鼎鑫

基金代码 000931

基金运作方式 封闭式

基金合同生效日 2015年1月22日

报告期末基金资产总额 134,924,953.23元

投资目标 本基金的投资，遵循价值投资原则，把握结构性调整机会，力争实现基金资产的长期稳定增值。

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -65,075,138.27

2.本期利润 48,698,759.40

3.加权平均基金份额本期利润 0.0257

4.期末基金份额净值 4.292,973.7439

5.期末基金资产净值 0.988

注:本期已实现收益指基金本期利息收入、应收股息、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份额的费用,申购费用计入申购金额后,赎回费用计入赎回金额,基金收益以有助于基金风险管理的多样化的原则,即依据法律法规的规定,结合本基金的实际情况,在不影响基金净值的情况下,将部分资金投资于货币市场基金,从而降低基金的波动性。

业绩比较基准 3%+[(1+同期银行定期存款利率)(1+股票型基金平均收益)]^0.5

风险收益特征 本基金是一只混合型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其预期收益和风险高于货币型基金和债券型基金,低于股票型基金。

基金管理人 光大保德信基金管理有限公司

基金托管人 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(2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -65,075,138.27

2.本期利润 48,698,759.40

3.加权平均基金份额本期利润 0.0257

4.期末基金份额净值 4.292,973.7439

5.期末基金资产净值 0.988

注:本期已实现收益指基金本期利息收入、应收股息、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份额的费用,申购费用计入申购金额后,赎回费用计入赎回金额,基金收益以有助于基金风险管理的多样化的原则,即依据法律法规的规定,结合本基金的实际情况,在不影响基金净值的情况下,将部分资金投资于货币市场基金,从而降低基金的波动性。

业绩比较基准 3%+[(1+同期银行定期存款利率)(1+股票型基金平均收益)]^0.5

风险收益特征 本基金是一只混合型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其预期收益和风险高于货币型基金和债券型基金,低于股票型基金。

基金管理人 光大保德信基金管理有限公司

基金托管人 中国光大银行股份有限公司

§ 3.2 报告期内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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%)

过去三个月 -0.90% 0.13% 1.21% 0.00%

-2.11% 0.13%

注:根据基金合同的约定,本基金建仓期为2015年6月11日至2015年12月10日。建仓期间结构化本基金各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 管理人报告

4.1 基金经理或基金经理助理简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

蔡乐 基金经理 2015-06-11 11年

蔡乐女士,金融学硕士,2003年7月至2005年2月任平安证券有限公司研究所研究员,2005年3月至2007年1月任光大保德信基金管理有限公司固定收益部研究员兼研究部负责人,2007年1月加入光大保德信基金管理有限公司,现任光大保德信基金管理有限公司基金经理,同时兼任光大保德信资产管理有限公司总经理,光大保德信资产管理有限公司基金经理,光大保德信资产管理有限公司执行董事。

4.2 管理人对报告期内基金运作总体情况的说明

本基金严格按照基金合同的约定,恪守基金投资纪律,遵守法律法规的规定,在投资决策、基金交易、风险控制等方面均不存在违法违规行为,报告期内实现了既定的投资目标,不存在对基金运作产生不利影响的因素。

4.3 公平交易制度的执行情况

本基金严格按照公平交易制度,确保基金管理人旗下所有基金在获得投资团队、交易团队支持等方面得到公平对待,本报告期内未发现不公平交易的情况。

4.4 报告期内基金的价格波动情况

本基金严格按照基金合同的约定,在投资决策、基金交易、风险控制等方面均不存在违法违规行为,报告期内实现了既定的投资目标,不存在对基金运作产生不利影响的因素。

4.5 管理人对宏观经济的专项说明

本基金严格按照基金合同的约定,在投资决策、基金交易、风险控制等方面均不存在违法违规行为,报告期内实现了既定的投资目标,不存在对基金运作产生不利影响的因素。

4.6 报告期内基金的税收情况

本基金严格按照基金合同的约定,在投资决策、基金交易、风险控制等方面均不存在违法违规行为,报告期内实现了既定的投资目标,不存在对基金运作产生不利影响的因素。

4.7 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

4.8 备查文件目录

1.中国证监会准予光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

2.光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同

3.光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金托管协议

4.光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书

5.光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金法律意见书

6.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人内部控制指引》

7.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金销售机构内部控制指引》

8.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

9.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人内部控制指引》

10.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

11.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

12.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

13.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

14.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

15.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

16.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

17.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

18.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

19.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

20.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

21.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

22.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

23.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

24.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

25.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

26.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

27.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

28.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

29.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

30.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

31.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

32.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

33.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

34.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

35.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

36.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

37.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

38.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

39.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

40.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

41.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

42.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

43.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

44.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

45.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

46.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

47.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

48.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

49.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

50.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

51.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

52.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

53.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

54.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

55.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

56.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

57.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

58.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

59.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

60.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

61.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

62.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

63.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

64.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

65.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

66.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

67.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

68.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

69.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》

70.基金业协会发布的新版《公开募集证券投资基金管理人公平交易制度指引》