

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:二〇一三年三月二十六日

重要提示

基金管理人的董事、监事、经理及其他高级管理人员对本报告书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。本年度报告已由三分之二以上独立董事签字确认，并由董事长签章。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2013年3月26日复核了本报表中的财务指标、净值表现、利润分配政策、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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细情况，可阅读年度报告全文。

本报告书中财务数据已经审计，安永华明会计师事务所为本基金财务出具了2012年度无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本基金报告期自2012年1月1日起至2012年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称 光大保德信量化股票

基金主代码 360001

交易代码 360001

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2004年8月27日

基金管理人 光大保德信基金管理有限公司

基金托管人 中国光大银行股份有限公司

报告期基金份额总额 11,194,340,793.71份

基金合同存续期 不定期

2.2 基金产品说明

投资目标 本基金追求长期持续稳定的超额收益

本基金的基本特征通过光大保德信特有的以量化投资为核心的多层次化投资策略，实现基金的多维化保障。

本基金通过构建多层次化的投资组合，在构建投资组合时综合考虑收益性与风险因素，并通过投资组合优化构建，确保投资组合风险收益特征符合既定目标。

基金经理在正常市场情况下不主动调整资产配置，即股票/债券等各类资产持有比例保持相对稳定。

基金经理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，投资者欲了解详细情况，可阅读年度报告全文。

本报告书中财务数据已经审计，安永华明会计师事务所为本基金财务出具了2012年度无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本基金报告期自2012年1月1日起至2012年12月31日止。

§2 基金简介

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 中光大银行股份有限公司

姓名 伍文彬 石立平

信息披露负责人 010-63639161

联系电子邮箱 eplservice@epf.com.cn

客户服务电话 400-820-2888, 021-53524620

传真 021-63351152

010-63639132

2.4 基金信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网网址 www.epf.com.cn

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。

基金年度报告备置点

3.3 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 2012年末 2011年末 2010年末

本期实现收益 -1,038,116,350.60 -745,739,186.60 487,807,817.55

本期利润 678,089,286.98 -2,297,205,104.27 -282,883,843.43

加权平均基金份额本期利润 0.0587 -0.1878 -0.0196

本期基金份额净值增长率为 8.31% -21.07% -3.20%

3.1.2 期末数据和指标 2012年末 2011年末 2010年末

期末可供分配基金份额利润 -0.0456 0.0442 0.1053

8,780,605,442.58 5,808,170,423.57 11,721,765,653.09

期末基金份额净值 0.7844 0.7242 0.9175

3.1.3 利润分配情况

注:①本期实现收益指基金本期已实现收益加上本期未分配利润。②所涉基金业绩指标不包括所有认申购人交易基金的各项费用，计算时未考虑实际收益水平低于所列数字。

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

阶段 份额净增率(%) 份额净值增长率(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率(%)

过去一个月 10.98% 1.22% 9.87% 1.14% 0.08%

过去一年 3.18% 1.13% 3.75% 1.10% -0.57%

过去三年 8.31% 1.19% 10.71% 1.12% -2.40% 0.07%

过去五年 -17.24% 1.36% -21.68% 1.23% 4.44% 0.13%

成立以来 -44.39% 1.91% -45.39% 1.76% 0.96% 0.15%

注:业绩比较基准收益率=90%×新华富时A股200指数+10%×同业存款利率。新华富时A股200指数是沪深两市A股中选取市值最大的200家A股公司，成份股采取二级分类的权重方式，每年的4月、7月、10月进行成份股的审核，本基金每日业绩比较基准进行动态平衡，即每期权重90%的新财富中国A股200指数+10%的同业存款利率。

3.2.2 基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比例

注:本基金合同生效以来基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图

光大保德信量化核心证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率走势图

2004年8月27日至2012年12月31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各项资产配置比例符合本基金合同规定的各项资产配置比例限制。

3.2.3 过去五年基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

光大保德信量化核心证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

2004年8月27日至2012年12月31日)

注:本基金管理人于2004年8月27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

金额单位:人民币元

3.4 管理人报告

4.1 基金管理人基本情况

4.1.1 基金管理人及其实管基金的规模

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控股股份有限公司和光大保德信保险资产管理有限公司共同创建，公司总部主要从事基金管理、证券、上海证券人为人民币16亿元人民币，两家股东分别持有55%和45%的股份，公司主要从事基金管理、证券投资基金和国债投资，以及相关的其他金融业务。

截至2012年12月31日，光大保德信保险资产管理有限公司通过旗下光大保德信保险资产管理有限公司、光大保德信基金管理有限公司、光大保德信添盛双月理财债券型证券投资基金、光大保德信添盈定期开放型债券型证券投资基金、光大保德信添盈定期开放型债券型证券投资基金。

4.2 基金经理管理基金的经验及管理的基金情况

4.2.1 基金经理的简历

姓名 职务 任职日期 离任日期 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，毕业于南京航空航天大学工商管理学院，获工商管理硕士学位。曾在国泰君安证券有限公司担任过高级研究员、基金经理助理、基金经理等职务。2007年加入光大保德信基金管理有限公司，担任高级研究员、基金经理助理、基金经理等职务。2010年1月加入光大保德信基金管理有限公司，现担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、光大保德信添盈定期开放型债券型证券投资基金、光大保德信添盈定期开放型债券型证券投资基金。

4.2.2 基金经理管理基金的从业经验

4.2.3 基金经理的过往业绩

4.2.4 基金经理的诚信记录

4.3 对报告期内基金运作的总体评价

4.3.1 对报告期内基金的运作总体评价

4.3.2 对报告期内基金的运作管理情况的说明

4.3.3 对报告期内基金的会计政策的说明

4.3.4 对报告期内基金的税收情况的说明

4.3.5 对报告期内基金费用的计提、支付和核销情况的说明

4.3.6 对报告期内基金收益分配情况的说明

4.3.7 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.8 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.9 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.10 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.11 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.12 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.13 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.14 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.15 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.16 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.17 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.18 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.19 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.20 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.21 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.22 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.23 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.24 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.25 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.26 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.27 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.28 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.29 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.30 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.31 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.32 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.33 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.34 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.35 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.36 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.37 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.38 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.39 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.40 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.41 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.42 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.43 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.44 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明

4.3.45 对报告期内基金的费用计提、支付和核销情况的说明