

<p>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:二〇一三年三月二十七日</p> <p>§1重要提示</p> <p>基金管理人的董事会、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的法律责任。在年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。</p> <p>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3月26日复核了本报告中的财务指标、净值数据、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。</p> <p>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其本金安全。</p> <p>基金的投资过往业绩并不预示其未来表现,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及其摘要。</p> <p>本报告自披露之日起,投资者欲了解详细情况,应阅读该年度报告全文。</p> <p>本报告中基金资料已经审计,由安永华明会计师事务所出具了2012年度无保留意见的审计报告,本报告投资者注意。</p> <p>本报告自2013年1月1日起至12月31日止。</p>	<p>§2 基金简介</p> <p>2.1 基金基本情况</p> <table> <tr> <td>基金简称</td><td>光大保德信量化股票</td></tr> <tr> <td>基金代码</td><td>360001</td></tr> <tr> <td>交易代码</td><td>360001</td></tr> <tr> <td>基金运作方式</td><td>契约型开放式</td></tr> <tr> <td>基金合同生效日</td><td>2004年8月27日</td></tr> <tr> <td>基金管理人</td><td>光大保德信基金管理有限公司</td></tr> <tr> <td>基金托管人</td><td>中国光大银行股份有限公司</td></tr> <tr> <td>报告期末基金份额总额</td><td>11,194,340,793.71份</td></tr> <tr> <td>基金合同存续期</td><td>不定期</td></tr> <tr> <td>2.2 基金产品说明</td><td></td></tr> <tr> <td>投资目标</td><td>本基金追求长期持续稳定超出业绩比较基准的投资回报。</td></tr> <tr> <td>投资策略</td><td>本基金主要通过光大保德信特有的以量化投资为核心的多因子优化模型,系统性地投资于收益和风险可控的投资组合。在构建投资组合时会综合考虑因素及风险因素,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。本基金在正常市场条件下奉行主动资产配置,即股票/现金等各类资产持有比例与权重保持动态平衡。</td></tr> <tr> <td>业绩比较基准</td><td>90%*富时中国A200指数+10%*同业存款利率。</td></tr> <tr> <td>风险收益特征</td><td>本基金属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,在风险限额范围内追求收益最大化。</td></tr> </table>	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	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	报告期末基金份额总额	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超出业绩比较基准的投资回报。	投资策略	本基金主要通过光大保德信特有的以量化投资为核心的多因子优化模型,系统性地投资于收益和风险可控的投资组合。在构建投资组合时会综合考虑因素及风险因素,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。本基金在正常市场条件下奉行主动资产配置,即股票/现金等各类资产持有比例与权重保持动态平衡。	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	本基金属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,在风险限额范围内追求收益最大化。
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																												
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																												
报告期末基金份额总额	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超出业绩比较基准的投资回报。																												
投资策略	本基金主要通过光大保德信特有的以量化投资为核心的多因子优化模型,系统性地投资于收益和风险可控的投资组合。在构建投资组合时会综合考虑因素及风险因素,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。本基金在正常市场条件下奉行主动资产配置,即股票/现金等各类资产持有比例与权重保持动态平衡。																												
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	本基金属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,在风险限额范围内追求收益最大化。																												

23基金管理人	基金管理人	基金管理人
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
信息披露负责人	姓名 王立平	姓名 石立平
联系电话	400-1-33074700-3105	010-63639161
电子邮箱	fundinfo@epf.com.cn	ali@epf.com.cn
客户服务电话	400-820-2888; 021-53524620	95595
传真	021-63351152	010-63639132
2.4信息披露方式		
登载基金年度报告全文的互联网网址	www.epf.com.cn	
基金年度报告备置地点	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。	

3.1 主要会计数据和财务指标	3.2 主要会计数据和财务指标	3.3 主要会计数据和财务指标
3.1.1 期间数据和指标	2012年	2011年
本期已实现收益	-1,038,116,350.60	-745,739,186.60
本期公允价值变动损益	678,089,286.98	-2,297,205,104.27
加权平均基金份额本期利润	0.0587	-0.1878
本期基金份额净值增长率	8.31%	-21.07%
3.1.2 期末基金份额净值	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0456	0.0442
期末基金份额净值	8,780,605,442.58	8,508,170,423.57
期末基金份额净值增长率	0.7844	0.7242

§3主要财务数据、基金净值表现及利润分配情况				
				金额单位:人民币
3.1.1 期间数据和指标	2012年	2011年	2010年	
本期已实现收益	-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	-282,883,834.43	
加权平均基金份额本期利润	0.0587	-0.1878	-0.0946	
本基金净值增长率	8.31%	-21.07%	-3.03%	
期末可供基金份额持有人分配的基金净值	-0.0456	0.0442	0.1525	
基金净值增长率	8.780,605,422.58	8,508,170,423.57	11,721,765,695.03	
期末基金净值总额	7,484.84	7,242.57	0.9175	

注:1.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)扣除相关费用和后的余额,本期利润和基金净值增长率均以期末数据为准。
2.本基金净值增长率和基金份额净值增长率,采用本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差额,按照简单算术平均的方法计算得出。