

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
报告送达日期:二〇一四年八月二十九日
1 重要提示及目录
1.1 风险提示
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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字确认,并由董事签发。
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的约定,于2014年6月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务报告、投资报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导陈述或者重大遗漏。
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金,但不保证基金一定盈利。
本基金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。
本基金摘要摘要自上年度报告正文发布之日起,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告全文。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2014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 光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金
基金代码 360011
交易代码 360011
基金运作方式 契约型开放式
基金合同生效日 2009年10月26日
基金管理人 光大保德信基金管理有限公司
基金托管人 中国建设银行股份有限公司
报告期末基金资产净值 1,226,513,228.89元
基金合同的终止期 不定期

2.2 基金产品说明

投资目标 本基金通过对宏观经济、大类资产配置变化及证券估值三个层面的系统、深入的研究分析,适时调整大类资产配置策略及投资品种,以实现基金资产的长期稳健增值。

投资策略 本基金将通过对宏观经济、大类资产配置变化及证券估值三个层面的系统、深入的研究分析,适时调整大类资产配置策略及投资品种,以实现基金资产的长期稳健增值。本基金将充分运用研究团队的研究成果,深入挖掘行业投资机会,在充分考虑风险的前提下,积极配置股票、债券等投资品种,以获取超额收益。

业绩比较基准 35%×沪深300指数收益+45%×中证全债指数收益

风险收益特征 基金收益为混合收益,既分享投资于股票中的收益,同时获取收益和风险低于股票基金,但高于债券基金。

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 中国建设银行股份有限公司
姓名 余群 田青
信息披露负责人 姓名 余群
联系电话 021-3374000-3110 010-67599596
电子邮箱 epfrcv@epf.com.cn tianqing1@cbank.com
客户服务电话 400-820-2888-021-53524620 95533
传真 021-63315152 010-66275853

2.4 信息披露方式

基金管理人年度报告的管理人签章 www.epf.com.cn
网站网址

基金管理人半年报的报备地点 光大保德信基金管理有限公司,中国建设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

金额单位:人民币元

3.1 期间数据和指标 报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)

本期已实现收益 16,414,553.16
本期利润 18,868,475.32
加权平均基金份额本期利润 0.0257
期末基金份额净值 2.67%

3.1.2 本期利润构成 报告期(2014年6月30日)

本期可分配利润金额 0.0031
期末基金份额利润 1,322,760,011.75
期末基金份额总值 1,322,760,011.75
1.078

注:1)本期间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,即基金的本期利润。本期利润不包括期末已实现收益。
2)所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,费用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 基金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 份额净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 (1) (2) (3) (4)

过去一个月 2.96% 0.81% 0.59% 0.42% 2.37% 0.36%

过去三个月 3.26% 0.85% 1.86% 0.48% 1.40% 0.37%

过去六个月 2.67% 0.99% -1.38% 0.57% 4.05% 0.42%

过去一年 24.36% 1.04% 1.63% 0.65% 22.73% 0.36%

过去三年 18.77% 1.06% -10.93% 0.71% 29.70% 0.35%

成立以来 31.28% 1.05% -12.37% 0.78% 43.55% 0.36%

3.2.2 基金合同生效以来基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 份额净值增长率 份额净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 (1) (2) (3) (4)

过去一个月 2.96% 0.81% 0.59% 0.42% 2.37% 0.36%

过去三个月 3.26% 0.85% 1.86% 0.48% 1.40% 0.37%

过去六个月 2.67% 0.99% -1.38% 0.57% 4.05% 0.42%

过去一年 24.36% 1.04% 1.63% 0.65% 22.73% 0.36%

过去三年 18.77% 1.06% -10.93% 0.71% 29.70% 0.35%

成立以来 31.28% 1.05% -12.37% 0.78% 43.55% 0.36%

3.2.3 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 份额净值增长率 份额净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 (1) (2) (3) (4)

过去一个月 2.96% 0.81% 0.59% 0.42% 2.37% 0.36%

过去三个月 3.26% 0.85% 1.86% 0.48% 1.40% 0.37%

过去六个月 2.67% 0.99% -1.38% 0.57% 4.05% 0.42%

过去一年 24.36% 1.04% 1.63% 0.65% 22.73% 0.36%

过去三年 18.77% 1.06% -10.93% 0.71% 29.70% 0.35%

成立以来 31.28% 1.05% -12.37% 0.78% 43.55% 0.36%

3.3.1 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 份额净值增长率 份额净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 (1) (2) (3) (4)

过去一个月 2.96% 0.81% 0.59% 0.42% 2.37% 0.36%

过去三个月 3.26% 0.85% 1.86% 0.48% 1.40% 0.37%

过去六个月 2.67% 0.99% -1.38% 0.57% 4.05% 0.42%

过去一年 24.36% 1.04% 1.63% 0.65% 22.73% 0.36%

过去三年 18.77% 1.06% -10.93% 0.71% 29.70% 0.35%

成立以来 31.28% 1.05% -12.37% 0.78% 43.55% 0.36%

3.3.2 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 份额净值增长率 份额净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 (1) (2) (3) (4)

过去一个月 2.96% 0.81% 0.59% 0.42% 2.37% 0.36%

过去三个月 3.26% 0.85% 1.86% 0.48% 1.40% 0.37%

过去六个月 2.67% 0.99% -1.38% 0.57% 4.05% 0.42%

过去一年 24.36% 1.04% 1.63% 0.65% 22.73% 0.36%

过去三年 18.77% 1.06% -10.93% 0.71% 29.70% 0.35%

成立以来 31.28% 1.05% -12.37% 0.78% 43.55% 0.36%

3.3.3 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 份额净值增长率 份额净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 (1) (2) (3) (4)

过去一个月 2.96% 0.81% 0.59% 0.42% 2.37% 0.36%

过去三个月 3.26% 0.85% 1.86% 0.48% 1.40% 0.37%

过去六个月 2.67% 0.99% -1.38% 0.57% 4.05% 0.42%

过去一年 24.36% 1.04% 1.63% 0.65% 22.73% 0.36%

过去三年 18.77% 1.06% -10.93% 0.71% 29.70% 0.35%

成立以来 31.28% 1.05% -12.37% 0.78% 43.55% 0.36%

3.3.4 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 份额净值增长率 份额净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 (1) (2) (3) (4)

过去一个月 2.96% 0.81% 0.59% 0.42% 2.37% 0.36%

过去三个月 3.26% 0.85% 1.86% 0.48% 1.40% 0.37%

过去六个月 2.67% 0.99% -1.38% 0.57% 4.05% 0.42%

过去一年 24.36% 1.04% 1.63% 0.65% 22.73% 0.36%

过去三年 18.77% 1.06% -10.93% 0.71% 29.70% 0.35%

成立以来 31.28% 1.05% -12.37% 0.78% 43.55% 0.36%

3.3.5 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 份额净值增长率 份额净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 (1) (2) (3) (4)

过去一个月 2.96% 0.81% 0.59% 0.42% 2.37% 0.36%

过去三个月 3.26% 0.85% 1.86% 0.48% 1.40% 0.37%

过去六个月 2.67% 0.99% -1.38% 0.57% 4.05% 0.42%

过去一年 24.36% 1.04% 1.63% 0.65% 22.73% 0.36%

过去三年 18.77% 1.06% -10.93% 0.71% 29.70% 0.35%

成立以来 31.28% 1.05% -12.37% 0.78% 43.55% 0.36%

3.3.6 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 份额净值增长率 份额净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 (1) (2) (3) (4)

过去一个月 2.96% 0.81% 0.59% 0.42% 2.37% 0.36%

过去三个月 3.26% 0.85% 1.86% 0.48% 1.40% 0.37%

过去六个月 2.67% 0.99% -1.38% 0.57% 4.05% 0.42%

过去一年 24.36% 1.04% 1.63% 0.65% 22.73% 0.36%

过去三年 18.77% 1.06% -10.93% 0.71% 29.70% 0.35%

成立以来 31.28% 1.05% -12.37% 0.78% 43.55% 0.36%

3.3.7 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 份额净值增长率 份额净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 (1) (2) (3) (4)

过去一个月 2.96% 0.81% 0.59% 0.42% 2.37% 0.36%

过去三个月 3.26% 0.85% 1.86% 0.48% 1.40% 0.37%

过去六个月 2.67% 0.99% -1.38% 0.57% 4.05% 0.42%

过去一年 24.36% 1.04% 1.63% 0.65% 22.73% 0.36%

过去三年 18.77% 1.06% -10.93% 0.71% 29.70% 0.35%

成立以来 31.28% 1.05% -12.37% 0.78% 43.55% 0.36%

3.3.8 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 份额净值增长率 份额净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 (1) (2) (3) (4)

过去一个月 2.96% 0.81% 0.59% 0.42% 2.37% 0.36%

过去三个月 3.26% 0.85% 1.86% 0.48% 1.40% 0.37%

过去六个月 2.67% 0.99% -1.38% 0.57% 4.05% 0.42%