

# 信息披露 Disclosure

## 光大保德信量化核心证券投资基金

[2014] 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:二〇一四年十月二十七日

基金管理人的董事会对本基金定期报告的整体内容及其虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其实质性、准确性和平完整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基金合同规定，于2014年10月24日复核了本基金定期报告的内容，对本基金定期报告的整体内容及其虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，不承担复核责任。

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。投资人投资有风险，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。

本报告期财务资料未经审计。

本报告期末至报告期期末止30日止。

### § 2 基金产品概况

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	7,614,009,297.19	92.71
其中：股票	7,614,009,297.19	92.71
2 固定收益投资	-	-
其中：债券	-	-
货币市场工具	-	-
3 贵金属投资	-	-
4 衍生金融工具投资	-	-
5 其他投资	-	-
其中，买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6 银行存款和结算备付金合计	596,663,423.47	7.26
7 其他资产	2,396,237.85	0.03
8 合计	8,213,006,959.61	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	51,502,260.14	0.63
B 矿业	105,774,932.25	1.30
C 制造业	4,358,170,012.36	53.38
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	121,717,132.28	5.05
E 工业	120,946,423.73	1.48
F 制造业、批发和零售业	367,898,370.99	4.51
G 交通运输、仓储和邮政业	280,238,115.51	3.54
H 餐饮和住宿业	2,296,178.48	0.03
I 信息传输、软件和信息技术服务业	490,448,547.13	6.01
J 房地产业	449,509,266.01	5.51
K 批发零售业	625,463,946.88	7.66
L 食品、饮料和烟草业	48,639,195.26	0.60
M 研究和试验发展及技术服务	43,166,085.94	0.53
N 科学、技术及专业服务业	55,542,909.32	0.68
O 公共服务、修理和其他服务业	-	-
P 教育	-	-
Q 卫生和社会工作	30,961,588.00	0.38
R 文化、体育和娱乐业	96,795,462.51	1.19
S 综合	64,938,875.40	0.80
总计	7,614,009,297.19	92.76

5.3 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

单位:人民币元

报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)

1.本期已实现收益 298,875,921.45

2.本期利润 1,105,371,301.78

3.期初平均基金份额利润 0.10232

4.期末基金份额净值 8,164,573,395.66

5.期末可供分配基金份额 0.9407

注:自本期实现收益基金本期累计收入、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入加上本期公允价值变动收益。

本基金业绩指标不包括持有大额申购或赎回费用,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(%) 业绩比较基准收益(%) 业绩比较基准差额(%) ①-③ ②-④

过去三个月 14.99% 8.08% 11.85% 0.81% 3.14% -0.01%

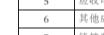
注:为更好地反映债券市场整体运行情况和基金经理人旗下相关基金投资组合的运作情况,经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致,自2014年4月1日起,将本基金的业绩比较基准由“90%×沪深300指数+10%×同业存款利率”变更为“90%×沪深300指数+10%×同业存款利率+0.5%×国债收益率”。

3.2.2基金经理因生变以来基金份额累计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

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2010年4月27日至2014年9月30日)



注:1.为更好地反映债券市场整体运行情况和基金经理人旗下相关基金投资组合的运作情况,经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致,自2014年4月1日起,将本基金的业绩比较基准由“90%×沪深300指数+10%×同业存款利率”变更为“90%×沪深300指数+10%×同业存款利率+0.5%×国债收益率”。

2.根据基金合同的规定,本基金在建仓期(2004年7月27日至2006年2月26日)。建仓期结束时本基

金份额配置比例符合基金合同约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(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理时间 说明

周伟伟 资产配置总监、基金经理 2014-1-9 2014-9-2 12年

基金经理对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人没有从事损害基金持有人利益的行为。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人没有从事损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2014年3个季度,本基金加强了新常态经济(我们称之为存量经济)下跨行业的研究,我们逐渐看到经济在不断调整,在逐步适应经济基本面的变化,因此本基金在投资策略上也做了相应的调整。

具体来看,前三季度,本基金沿着“经营经济本身自发的机会”以及“政策改革带来的机会”,本基金认为主要可以大概率把握住以下四个方面的机会:“供给收缩”、“后端市场”、“存量替代”以及“长尾消费”。对于“政策改革带来的机会”,本基金遵循新一届政府的改革思路,重点关注“国企改革”、“安全建设”,“破除垄

断”等领域的机会。

4.4 管理人对报告期内基金的估值政策和会计政策的说明

本基金在估值方法上严格按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算办法》以及相关的法律法规、证监会规定的基金估值原则进行估值。

4.5 管理人对报告期内基金利润分配政策的说明

本基金在利润分配上严格按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算办法》以及相关的法律法规、证监会规定的基金利润分配政策进行分配。

4.6 管理人对中期报告中显示的本基金投资组合的说明

本基金在投资组合上严格按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算办法》以及相关的法律法规、证监会规定的基金投资组合的编制方法进行编制。

4.7 管理人对报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在持有人数或基金资产净值预警方面没有设置预警线。

4.8 管理人对报告期内基金估值政策和会计政策的说明

本基金在估值方法上严格按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算办法》以及相关的法律法规、证监会规定的基金估值原则进行估值。

4.9 管理人对报告期内基金的投资组合报告的说明

本基金在投资组合上严格按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算办法》以及相关的法律法规、证监会规定的基金投资组合的编制方法进行编制。

4.10 管理人对报告期内基金业绩表现的说明

本基金在投资业绩上严格按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算办法》以及相关的法律法规、证监会规定的基金投资业绩表现的编制方法进行编制。

4.11 管理人对基金定期报告中显示的基金组合的说明

本基金在基金组合上严格按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算办法》以及相关的法律法规、证监会规定的基金组合的编制方法进行编制。

4.12 管理人对基金组合的说明

本基金在基金组合上严格按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算办法》以及相关的法律法规、证监会规定的基金组合的编制方法进行编制。

4.13 管理人对基金组合的说明

本基金在基金组合上严格按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算办法》以及相关的法律法规、证监会规定的基金组合的编制方法进行编制。

4.14 管理人对基金组合的说明

本基金在基金组合上严格按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算办法》以及相关的法律法规、证监会规定的基金组合的编制方法进行编制。

4.15 管理人对基金组合的说明

本基金在基金组合上严格按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算办法》以及相关的法律法规、证监会规定的基金组合的编制方法进行编制。

4.16 管理人对基金组合的说明

本基金在基金组合上严格按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算办法》以及相关的法律法规、证监会规定的基金组合的编制方法进行编制。

4.17 管理人对基金组合的说明

本基金在基金组合上严格按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算办法》以及相关的法律法规、证监会规定的基金组合的编制方法进行编制。

4.18 管理人对基金组合的说明

本基金在基金组合上严格按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算办法》以及相关的法律法规、证监会规定的基金组合的编制方法进行编制。

4.19 管理人对基金组合的说明

本基金在基金组合上严格按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算办法》以及相关的法律法规、证监会规定的基金组合的编制方法进行编制。

4.20 管理人对基金组合的说明

本基金在基金组合上严格按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算办法》以及相关的法律法规、证监会规定的基金组合的编制方法进行编制。

4.21 管理人对基金组合的说明

本基金在基金组合上严格按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算办法》以及相关的法律法规、证监会规定的基金组合的编制方法进行编制。

4.22 管理人对基金组合的说明

本基金在基金组合上严格按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算办法》以及相关的法律法规、证监会规定的基金组合的编制方法进行编制。

4.23 管理人对基金组合的说明

本基金在基金组合上严格按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算办法》以及相关的法律法规、证监会规定的基金组合的编制方法进行编制。

4.24 管理人对基金组合的说明

本基金在基金组合上严格按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算办法》以及相关的法律法规、证监会规定的基金组合的编制方法进行编制。

4.25 管理人对基金组合的说明

本基金在基金组合上严格按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算办法》以及相关的法律法规、证监会规定的基金组合的编制方法进行编制。

4.26 管理人对基金组合的说明

本基金在基金组合上严格按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算办法》以及相关的法律法规、证监会规定的基金组合的编制方法进行编制。

4.27 管理人对基金组合的说明

本基金在基金组合上严格按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算办法》以及相关的法律法规、证监会规定的基金组合的编制方法进行编制。

4.28 管理人对基金组合的说明

本基金在基金组合上严格按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算办法》以及相关的法律法规、证监会规定的基金组合的编制方法进行编制。

4.29 管理人对基金组合的说明

本基金在基金组合上严格按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算办法》以及相关的法律法规、证监会规定的基金组合的编制方法进行编制。

4.30 管理人对基金组合的说明

</div