

光大保德信中小盘混合型证券投资基金 [2015] 年度报告摘要

基金管理人：光大保德信基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年三月二十八日
§ 1 重要提示

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。本基金年度报告已经二分之一以上独立董事签字同意，并由董事长签章。

基金托管人交通银行股份有限公司根据法律法规和基金合同的约定，于2016年3月25日复核了报告期内的财务指标、基金净值表现、基金份额持有人数、基金资产净值、基金份额净值、投资组合报告、投资运作情况报告、净值公告、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则运用基金财产，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。

本年度报告摘要年度报告正文，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2015年度无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2015年1月1日起至2015年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	光大保德信中小盘混合
基金代码	360012
交易代码	360012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年4月14日
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
基金类别	混合型
报告期末基金总资产	200,036,224,10份
报告期末基金份额总额	1,069,703,134份
报告期净值涨跌情况	不定期

2.2 基金产品说明

本基金通过人批准具有高成长性或者潜力的上市公司股票，以求获得基金资产的增值。

本基金将通过宏观经济基本面分析与市场双重驱动的双重策略进行分析，并通过行业配置、个股精选、择时操作等方法，精选具有高成长性或者潜力的上市公司股票，以求获得基金资产的增值。

本基金的股票投资比例不低于基金资产的80%，其中全仓借券投资比例不超过基金资产的5%。

本基金的债券投资比例不高于基金资产的20%，其中全仓借券投资比例不超过基金资产的5%。

风险收益特征

本基金为混合型基金，主要投资于高成长性或者潜力的小型上市公司股票为投资对象，同时对部分固定收益类品种进行适当配置，以期在获得基金资产的增值的同时，降低基金资产的波动风险。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；截止报告期末未与外部估价定价服务机构构成一致行动人。

47 评估对象：报告期内基金内所有影响利润分配的情况的说明

根据相关法律法规及基金合同的有关规定，本基金本报告期内不进行利润分配。

48 报告期内本机构内部对基金资产估值政策的说明

本基金内部对基金资产估值政策有如下规定：最近交易日环境未发生重大变化或未发生严重影响估值的重大事件，按最近交易日的收盘价估值；最近交易日环境发生重大变化或发生严重影响估值的重大事件，按估值方法确定的公允价值估值。

49 托管费报告

2010年，光大保德信基金管理有限公司向光大保德信中小盘混合型证券投资基金托管人支付了托管费。

50 基金投资组合报告

51 资产负债表

52 审计报告

53 其他费用

54 会议纪要

55 基金份额净值

56 申购赎回费用

57 买卖基金费用

58 交易费用

59 其他费用

60 交易费用

61 交易费用

62 交易费用

63 交易费用

64 交易费用

65 交易费用

66 交易费用

67 交易费用

68 交易费用

69 交易费用

70 交易费用

71 交易费用

72 交易费用

73 交易费用

74 交易费用

75 交易费用

76 交易费用

77 交易费用

78 交易费用

79 交易费用

80 交易费用

81 交易费用

82 交易费用

83 交易费用

84 交易费用

85 交易费用

86 交易费用

87 交易费用

88 交易费用

89 交易费用

90 交易费用

91 交易费用

92 交易费用

93 交易费用

94 交易费用

95 交易费用

96 交易费用

97 交易费用

98 交易费用

99 交易费用

100 交易费用

101 交易费用

102 交易费用

103 交易费用

104 交易费用

105 交易费用

106 交易费用

107 交易费用

108 交易费用

109 交易费用

110 交易费用

111 交易费用

112 交易费用

113 交易费用

114 交易费用

115 交易费用

116 交易费用

117 交易费用

118 交易费用

119 交易费用

120 交易费用

121 交易费用

122 交易费用

123 交易费用

124 交易费用

125 交易费用

126 交易费用

127 交易费用

128 交易费用

129 交易费用

130 交易费用

131 交易费用

132 交易费用

133 交易费用

134 交易费用

135 交易费用

136 交易费用

137 交易费用

138 交易费用

139 交易费用

140 交易费用

141 交易费用

142 交易费用

143 交易费用

144 交易费用

145 交易费用

146 交易费用

147 交易费用

148 交易费用

149 交易费用

150 交易费用

151 交易费用

152 交易费用

153 交易费用

154 交易费用

155 交易费用

156 交易费用

157 交易费用

158 交易费用

159 交易费用

160 交易费用

161 交易费用

162 交易费用

163 交易费用

164 交易费用

165 交易费用

166 交易费用

167 交易费用

168 交易费用

169 交易费用

170 交易费用

171 交易费用

172 交易费用

173 交易费用

174 交易费用

175 交易费用

176 交易费用

177 交易费用

178 交易费用

179 交易费用

180 交易费用

181 交易费用

182 交易费用

183 交易费用

184 交易费用

185 交易费用

186 交易费用

187 交易费用

188 交易费用

189 交易费用

190 交易费用

19