

光大保德信行业轮动混合型证券投资基金

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
报告送出日期：二〇一六年四月二十二日

§1 重要提示

基金管理人及基金托管人承诺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责任。
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年4月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
基金的过往业绩并不预示其未来业绩表现。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。
本报告自财务资料截止日2016年3月31日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	光大保德信行业轮动混合
基金代码	501003
交易代码	501003E
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年12月15日
报告期末基金份额总额	57,840,661.07份
投资目标	本基金通过对宏观经济周期和行业景气度分析判断，根据行业基本面和估值水平进行资产配置，力争获取不同经济周期下的相对优异收益，以超越业绩比较基准并实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金将通过对宏观经济基本面及证券市场宏观面的数据进行分析，并通过对行业进行细分，从周期及组合化、周期性或成长型产业等方面，进行行业轮动配置。本基金将采用“估值、成长或动量”三个因素进行行业轮动配置。具体地，本基金将通过行业基本面轮动策略对行业的长期价值和性价比进行分析，同时结合估值、成长或动量进行行业的短期、中长期进行分析。
业绩比较基准	70%×沪深300指数收益率+30%×中国全债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，属于证券投资基金中的较高风险品种，其预期收益和风险高于债券型基金及货币型基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期 (2016年1月1日至2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-4,306,006.67
2.本期利润	-6,263,368.81
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0962
4.期末基金份额净值	49.90,853.93
5.期末基金份额净值	0.964
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）扣除相关费用后的余额。本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。	

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）扣除相关费用后的余额。本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.1 本期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益的比较

阶段	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-③	②-④
过去三个月	-14.29%	1.28%	-15.57%	-4.73%	1.46%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益比较的变动情况

光大保德信行业轮动混合证券投资基金净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年12月15日至2016年3月31日)

注：根据基金合同的约定，本基金合同于2012年12月15日（即2012年08月14日）建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同规定的比例限制和投资组合比例的情况。

§4 管理人报告

4.1 基金运作分析

4.1.1 基金运作分析

4.1.2 基金运作分析

4.1.3 基金运作分析

4.1.4 基金运作分析

4.1.5 基金运作分析

4.1.6 基金运作分析

4.1.7 基金运作分析

4.1.8 基金运作分析

4.1.9 基金运作分析

4.1.10 基金运作分析

4.1.11 基金运作分析

4.1.12 基金运作分析

4.1.13 基金运作分析

4.1.14 基金运作分析

4.1.15 基金运作分析

4.1.16 基金运作分析

4.1.17 基金运作分析

4.1.18 基金运作分析

4.1.19 基金运作分析

4.1.20 基金运作分析

4.1.21 基金运作分析

4.1.22 基金运作分析

4.1.23 基金运作分析

4.1.24 基金运作分析

4.1.25 基金运作分析

4.1.26 基金运作分析

4.1.27 基金运作分析

4.1.28 基金运作分析

4.1.29 基金运作分析

4.1.30 基金运作分析

4.1.31 基金运作分析

4.1.32 基金运作分析

4.1.33 基金运作分析

4.1.34 基金运作分析

4.1.35 基金运作分析

4.1.36 基金运作分析

4.1.37 基金运作分析

4.1.38 基金运作分析

4.1.39 基金运作分析

4.1.40 基金运作分析

4.1.41 基金运作分析

4.1.42 基金运作分析

4.1.43 基金运作分析

4.1.44 基金运作分析

4.1.45 基金运作分析

4.1.46 基金运作分析

4.1.47 基金运作分析

4.1.48 基金运作分析

4.1.49 基金运作分析

4.1.50 基金运作分析

§2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	制造业	26,562,365.00	53.15
C	金融业	-	-
D	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,512,320.00	5.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	2,353,582.00	4.71
J	房地产业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	6,775,700.00	13.56
M	科学研究和技术服务业	4,210,000.00	8.46
N	水利、环境和公共设施管理业	2,547,170.00	5.10
O	教育、文化、体育和娱乐业	-	-
P	教育、文化、体育和娱乐业	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	1,524,621.00	3.05
合计		46,483,772.00	93.04

§3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300156	神华能源	100,000	4,616,000.00	9.24
2	300274	华电国际	200,000	4,414,000.00	8.93
3	300058	蓝色光标	400,000	4,222,000.00	8.47
4	300012	华测检测	200,000	4,218,000.00	8.44
5	002548	金新农	194,000	3,247,034.00	6.56
6	300196	长海股份	78,800	2,549,180.00	5.10
7	002672	东江环保	152,000	2,547,170.00	5.10
8	002403	省广股份	139,000	2,543,700.00	5.09
9	300013	海创药业	166,000	2,512,320.00	5.03
10	300040	福瑞股份	112,800	2,509,300.00	5.02

§4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	2,001,000.00	4.01
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	2,001,000.00	4.01

§5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券品种	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019518	16国债18	20,000	2,001,000.00	4.01

§6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

§7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

§8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

§9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于股指期货。

5.9.3 影响股指期货投资的其他重要信息

5.10.1 本期股指期货投资损益

根据本基金基金合同，本基金不能投资于股指期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.11 股指期货投资报告

5.11.1 本基金投资的股指期货前一名称的发行主体未被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.11.2 本基金未投资超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他各项资产

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	246,541.63
2	应收证券清算款	1,200,163.33
3	应收利息	-
4	应收股利	28,543.73
5	应收申购款	17,119.11
6	其他应收款	-
7	预付款项	-
8	其他	-
9	合计	1,491,477.79

§11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。 客户服务电话：4008 2020 88 000 001 00000000 公司网址：www.gdsc.com.cn

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金基金份额变动情况

光大保德信一带一路	
-----------	--

§7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金报告期内，基金管理人不存在持有、申购、赎回或买卖本基金的其他重要信息。

经公司八届二十一次董事会会议审议通过，自2016年3月31日起，黄秋生正式离任公司总经理一职，由林蔚先生代任公司总经理。

§9 备查文件目录

1. 中国证监会批准光大保德信行业轮动混合型证券投资基金设立的文件
2. 光大保德信行业轮动混合型证券投资基金基金合同
3. 光大保德信行业轮动混合型证券投资基金招募说明书
4. 光大保德信行业轮动混合型证券投资基金托管协议
5. 光大保德信行业轮动混合型证券投资基金法律意见书
6. 基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
7. 基金托管人业务资格批件和营业执照
8. 报告期末光大保德信行业轮动混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告
9. 中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点
上海市浦东新区中山二路68号外滩金融中心1幢B33楼6层至10层基金管理人办公地址。

9.3 查阅方式
投资者对于本基金管理人公开披露的信息，投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人。 客户服务中心电话：4008-202-388、021-60292888。 公司网址：www.epfcm.com。

光大保德信基金管理有限公司
二〇一六年四月二十二日

光大保德信耀钱包货币市场基金

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：二〇一六年四月二十二日

§1 重要提示

基金管理人及基金托管人承诺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责任。
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2016年4月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
基金的过往业绩并不预示其未来业绩表现。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。
本报告自财务资料截止日2016年3月31日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	光大保德信耀钱包货币
基金代码	001973
交易代码	001973E
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年1月14日
报告期末基金份额总额	426,631,026.39份
投资目标	本基金力争保持基金资产的高流动性和安全性，追求高于业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金综合考虑各类货币市场工具的投资和流动性，在保证基金资产安全性的基础上，力争为投资人创造稳定收益。同时，本基金将根据市场利率的变化，合理配置货币市场工具，力争实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	1. 人民币定期存款利率 2. 人民币活期存款利率 3. 人民币通知存款利率 4. 人民币协定存款利率 5. 人民币大额存单利率 6. 人民币理财产品收益率 7. 人民币债券回购利率 8. 人民币同业拆借利率 9. 人民币银行承兑汇票利率 10. 人民币商业承兑汇票利率 11. 人民币信用证贴现利率 12. 人民币信用证承兑利率 13. 人民币信用证承兑利率 14. 人民币信用证承兑利率 15. 人民币信用证承兑利率 16. 人民币信用证承兑利率 17. 人民币信用证承兑利率 18. 人民币信用证承兑利率 19. 人民币信用证承兑利率 20. 人民币信用证承兑利率

§3 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	制造业	-	-
C	金融业	-	-
D	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	-	-
J	房地产业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	教育、文化、体育和娱乐业	-	-
P	教育、文化、体育和娱乐业	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		-	-

§4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

§5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

§6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

§7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

§8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

§9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名货币市场基金投资明细

本基金本报告期末未持有货币市场基金。

§10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有衍生品。

§11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

本基金本报告期末未持有其他资产。

§12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

本基金本报告期末未持有其他资产。

§13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

本基金本报告期末未持有其他资产。

§14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

本基金本报告期末未持有其他资产。

§15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

本基金本报告期末未持有其他资产。

§16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

本基金本报告期末未持有其他资产。

§17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

本基金本报告期末未持有其他资产。

§18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

本基金本报告期末未持有其他资产。

§19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细