



Disclosure 信息披露

2013年3月27日 星期三
zqsb@stcn.com (0755)83501750

B114

光大保德信量化核心证券投资基金

2012 年度报告摘要

2012年12月31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
报告送出日期:二〇一三年三月二十七日

基金管理人、基金托管人、基金销售机构在编制本报告过程中,因数据差异、误导性陈述或重大遗漏,并对内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字确认,并由董事长签发。

本报告期内,中国光大银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2013年3月26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。

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本金不受损失,投资者有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。
本报告期内,会计师事务所已经审计,安永华明会计师事务所为本基金财务出具了“2012年度无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。”

本报告自2012年1月1日起至12月31日止。

基金简介

2.1 基金基本情况	基金简介
基金名称	光大保德信量化核心基金
基金代码	360001
交易代码	360001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	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
基金合同存续期限	不定期

2.2 基金产品说明	基金产品说明
投资目标	本基金追求长期持续稳定增值业绩并控制投资风险
投资策略	本基金通过光大保德信特有的量化投资为核心的多策略资产配置体系构建于或能产生有效超额收益的投资组合,在构建投资组合时综合考虑收益因素及风险因素,并通过对投资组合进行动态调整,在控制投资组合风险的前提下,追求基金资产的长期增值。本基金在资产配置和仓位控制上,采取股票、债券、现金等多种资产配置,力求在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。
业绩比较基准	90%*中证中国A200指数+10%*同业存款利率
风险收益特征	本基金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,按照风险收益特征,对投资组合进行严格的风险管理,在风险控制范围内追求收益最大化。

2.3 基金管理人及基金托管人	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	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名: 陈文静 联系电话: 021-3307400-3105 电子邮箱: cpl@ebsc.com.cn	姓名: 石立平 联系电话: 010-63691611 电子邮箱: shilip@cebbank.com
客户服务电话	400-820-2888, 021-33524620	95595
客户服务热线	021-33531152	010-63691312

2.4 信息披露方式	信息披露方式
披露基金年度报告的官方网站	www.ebsc.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 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标	2012年	2011年	2010年
本期已实现收益	-1,038,116,350.60	-743,739,186.60	487,807,817.55
本期利润	678,089,286.98	-2,297,205,104.27	-282,883,434.43
加权平均基金份额本期利润	0.0887	-0.1878	-0.0196
本基金基金份额净值增长率	8.31%	-21.07%	-3.20%
3.2 基金净值表现	2012年	2011年	2010年
期末可供分配基金份额利润	-0.0456	0.0442	0.1053
期末基金单位净值	8.780,665,442.58	8.508,170,423.57	11,721,765,653.09
期末基金份额净值	0.7842	0.7242	0.9752

注: (1) 本期已实现收益指基金本期利润总额扣除公允价值变动收益,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) 所投资基金净值增长率超过或低于本基金业绩比较基准的费用,计入费用并导致收益水平降低若干百分点。

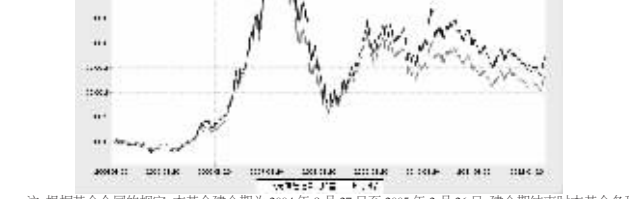
(3) 期末可供分配利润采用期末资产负债表未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 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	份额净值增长率(%)	业绩比较基准收益率(%)	超额收益(%)	①-③	②-④
过去三个月	10.98%	12.2%	9.87%	1.14%	1.11%
过去六个月	3.18%	1.13%	3.75%	1.00%	-0.57%
过去一年	8.31%	1.19%	10.71%	1.12%	-2.40%
过去三年	-17.24%	1.36%	-21.68%	1.23%	4.44%
过去五年	-44.39%	1.91%	-45.33%	1.76%	0.96%
自基金合同生效起至今	177.66%	1.77%	138.71%	1.66%	38.95%

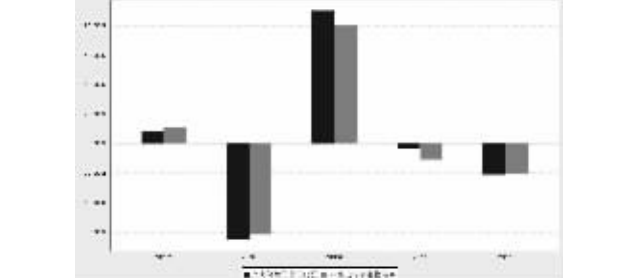
注:业绩比较基准收益率=90%*新华富时中国A200指数+10%*同业存款利率。新华富时中国A200指数是新华财富A股系列中的大盘可交易指数,包含按市值排名的最大的200 A股公司,成份股采取分级权重的方式,每半年于1月4月7月10月进行成份股的审核。本基金每日对业绩比较基准进行再平衡,即每日均维持90%的业绩比较基准权重。

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩表现与同期业绩比较基准收益变动的比较



注:根据基金合同的规定,本基金建仓期为2004年8月27日至2005年2月26日,建仓期结束时本基金各项资产净值比例符合基金合同规定的比例限制及投资组合限制。

3.2.3 过去五年基金业绩表现与同期业绩比较基准收益变动的比较



注:本基金基金合同于2004年8月27日生效,合同生效当年净值收益率按实际存续期间计算,未按整个自然年度计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2010	0.600	441,717,148.08	417,664,461.32	859,381,609.40	-
2011	-	-	-	-	-
2012	-	-	-	-	-
合计	0.600	441,717,148.08	417,664,461.32	859,381,609.40	-

4 管理人报告

4.1 基金管理人及其管理情况

光大保德信基金管理有限公司(以下简称“光大保德信”)成立于2004年4月,由中国光大集团控股的光大证券股份有限公司和德意志银行(中国)有限公司共同发起设立,总部设在上海,注册资本人民币16亿元人民币,两家股东分别持有55%和45%的股份,公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务(涉及行政许可的许可件经营),今后,将在法律法规允许的范围内为各类投资者提供资产管理服务。

截至2012年12月31日,光大保德信资产管理(上海)有限公司,即光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信红利股票型证券投资基金、光大保德信新增长期股票型证券投资基金、光大保德信优势配置股票型证券投资基金、光大保德信增利收益债券型证券投资基金、光大保德信均衡配置股票型证券投资基金、光大保德信增利收益债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、光大保德信添天季定期开放短期债券型证券投资基金、光大保德信添盈天季定期开放债券型证券投资基金和光大保德信添盈天季定期开放债券型证券投资基金。

4.1.3 基金管理人及其管理情况

4.1.3 基金管理人及其管理情况

4.1.3 基金管理人及其管理情况

4.1.3 基金管理人及其管理情况

4.1.3 基金管理人及其管理情况

4.1.3 基金管理人及其管理情况

4.1.3 基金管理人及其管理情况

4.1.3 基金管理人及其管理情况

4.1.3 基金管理人及其管理情况

4.1.3 基金管理人及其管理情况

4.1.3 基金管理人及其管理情况

4.1.3 基金管理人及其管理情况

4.1.3 基金管理人及其管理情况

4.1.3 基金管理人及其管理情况

4.1.3 基金管理人及其管理情况

4.1.3 基金管理人及其管理情况

4.1.3 基金管理人及其管理情况

4.1.3 基金管理人及其管理情况

4.1.3 基金管理人及其管理情况

4.1.3 基金管理人及其管理情况

4.1.3 基金管理人及其管理情况

4.1.3 基金管理人及其管理情况

4.1.3 基金管理人及其管理情况

4.1.3 基金管理人及其管理情况

4.1.3 基金管理人及其管理情况

4.1.3 基金管理人及其管理情况

4.1.3 基金管理人及其管理情况

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

资产: 2012年12月31日

负债: 2012年12月31日

所有者权益: 2012年12月31日

序号	股票名称	数量(股)	公允价值	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	600000 浦发银行	43,598,313	432,495,264.96	4.93
2	603118 中国平安	8,768,657	397,132,475.53	4.52
3	600016 民生银行	49,531,108	389,134,508.88	4.43
4	600221 海南航空	87,156,635	360,662,566.05	4.10
5	000001 平安银行	21,415,282	343,072,817.64	3.91
6	601601 中国铁建	12,004,338	270,097,605.00	3.08
7	600009 上海机场	18,892,061	235,395,486.06	2.68
8	600016 亿联网络	49,677,995	203,079,779.50	2.32
9	000046 荣泰股份	11,993,321	200,165,279.49	2.28
10	000043 中航地产	16,564,811	161,506,007.28	1.84

8.3 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	公允价值占基金资产净值比例
1	600000	浦发银行	43,598,313	432,495,264.96	4.93
2	603118	中国平安	8,768,657	397,132,475.53	4.52
3	600016	民生银行	49,531,108	389,134,508.88	4.43
4	600221	海南航空	87,156,635	360,662,566.05	4.10
5	000001	平安银行	21,415,282	343,072,817.64	3.91
6	601601	中国铁建	12,004,338	270,097,605.00	3.08
7	600009	上海机场	18,892,061	235,395,486.06	2.68
8	600016	亿联网络	49,677,995	203,079,779.50	2.32
9	000166	兴业银行	11,993,321	200,165,279.49	2.28
10	000043	中航地产	16,564,811	161,506,907.25	1.84