光大保德信货币市场基金

2013 第二季度 报告

2013年6月30日

基金管理人:光大保德信基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年七月十八日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年7月17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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	光大保德信货币
基金主代码	360003
交易代码	360003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年6月9日
报告期末基金份额总额	462,377,838.90份
投资目标	本基金通过投资于高信用等级、高流动性的短期金融工具,为投资者提供流动性储备;并在保持基金资产本金安全和高流动性的前提下,获得稳健的超越业绩比较基准的当期收益。
投资策略	本基金按照自上而下的方法对基金资产进行动态的大类资产配置,类属资产配置和证券选择。一方面根据整体配置要求通过积极的投资策略主动寻找风险中蕴藏的投资机会,发掘价格被低估的且符合流动性要求的适合投资的品种;另一方面通过风险预算管理,平均剩余期限控制和个券信用等级限定等方式有效控制投资风险,从而在一定的风险限制范围内达到风险收益最佳配比。
业绩比较基准	税后活期存款利率。
风险收益特征	从长期平均值来看,本基金风险收益特征属于证券投资基金中的低风险品种,风险程度低于其他类型的基金品种。本基金按照风险收益配比原则对投资组合进行严格的风险管理,将风险水平控制在既定目标之内,在风险限制范围内追求收益最大化。
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)
1.本期已实现收益	4,260,505.50
2.本期利润	4,260,505.50
3.期末基金资产净值	462,377,838.90

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

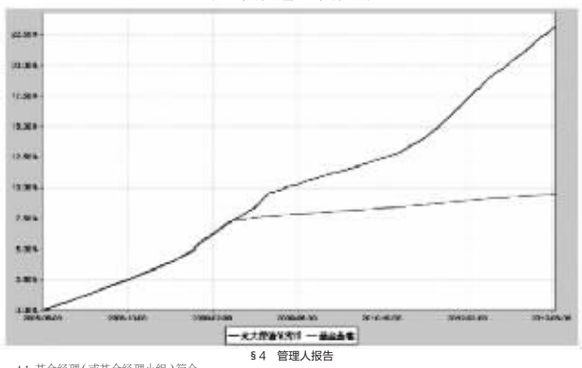
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8097%	0.0043%	0.0885%	0.0000%	0.7212%	0.0043%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

光大保德信货币市场基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2005年6月9日至2013年6月30日)



§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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
韩爱丽	基金经理	2012-3-1	-	6年	韩爱丽女士,复旦大学经济学硕士,CFA。2006年7月至2010年8月在上海浦东发展银行总行资金部从事固定收益交易、研究工作;2010年8月加盟光大保德信基金管理有限公司,任高级债券研究员,现任光大保德信货币市场基金基金经理、光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金基金经理、光大保德信盛双月理财债券型证券投资基金基金经理、光大保德信添天盈季度理财债券型证券投资基金基金经理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为充分保护持有人利益,确保本基金管理人旗下各基金在获得投研团队、交易团队支持等各方面得到公平对待,本基金管理人从投研制度设计、组织结构设计、工作流程制定、技术系统建设和完善、公平交易执行效果评估等各方面出发,建设形成了有效的公平交易执行体系。本报告期,本基金管理人各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,未发现存在违反公平交易原则的现象。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金与其他投资组合未发生交易所公开竞价同日反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

展望2013年3季度,无论从宏观还是从微观角度,内外需增长依然乏力,企业去库存压力仍然较大,工业企业利润累计增速还难见有明显改善,这预示着未来国内经济增速被弱的趋势仍然持续。长期来看,国内经济在实现漂沫落后产能,调整优化产业结构的过程中,以往依赖低附加值的传统商品出口、地产和基建投资推动的经济高速增长不可持续。通胀方面,总需求处于较弱的状态,短期资源品价格和人力成本不会大幅攀升,当前粮食价格也比较平稳,年内物价上涨的压力不大。资金面上,随着央行稳定市场情绪的若干政策出台,银行间资金紧张程度缓解,但前期套利资金回流缓慢,预计反应预期的资金价格的回落会先于反应实际头寸需求的资金量的缩减。货币基金在兼顾收益性、流动性的前提下,会适时调整信用债的投资,同时维持协议存款和逆回购的比例。操作上把平衡性作为第一位,谨慎投资,力求在投资标的种类、比例方面做到平衡和风险的可控。

§5 投资组合报告

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	固定收益投资	219,919,613.87	39.20
	其中:债券	219,919,613.87	39.20
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	172,920,681.88	30.82
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	158,789,850.15	28.30
4	其他各项资产	9,377,577.75	1.67
5	合计	561,007,723.65	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	2.51	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	97,999,653.00	21.19
	其中:买断式回购融资	-	-

注:上表中,报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例(%)	原因	调整期
1	2013-06-25	22.04	因基金连续赎回导致被动超标	5个工作日
2	2013-06-26	30.51	因基金连续赎回导致被动超标	5个工作日
3	2013-06-27	20.84	因基金连续赎回导致被动超标	5个工作日
4	2013-06-28	21.20	因基金连续赎回导致被动超标	5个工作日

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	68
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	96
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	67

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

报告期内投资组合平均剩余期限未有违规超过180天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	68.51	21.19
	其中,剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	4.32	-
	其中,剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	20.52	-
	其中,剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	10.80	-
	其中,剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	15.14	-
	其中,剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	119.30	21.19

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	79,987,004.66	17.30
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	139,932,609.21	30.26
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	219,919,613.87	47.56
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1001060	10央行票据60	800,000	79,987,004.66	17.30
2	041351003	13皖国贸CP001	100,000	10,006,945.87	2.16
3	041360029	13亚泰CP001	100,000	10,000,789.92	2.16
4	041353027	13长源力CP001	100,000	10,000,731.02	2.16
5	041360031	13云峰CP001	100,000	10,000,386.92	2.16
6	041360026	13津钢管CP001	100,000	10,000,346.25	2.16
7	041260092	12云峰CP002	100,000	10,000,217.77	2.16
8	041261037	12中炬高新CP001	100,000	10,000,181.88	2.16
9	041356019	13西江CP001	100,000	10,000,138.68	2.16
10	041260042	12渝农投CP001	100,000	9,998,097.59	2.16

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.2104%
报告期内偏离度的最低值	-0.1781%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1493%

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

报告期末本基金未有资产支持证券交易情况。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

(1)、本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。(2)、为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离,从而对基金持有人的利益产生稀释和不公平的结果,基金管理人于每一估值日,采用市场利率或交易价格,对基金持有的估值对象进行重新评估,即"影子定价"。当基金资产净值与影子定价的偏离达到或超过基金资产净值的一定幅度时,或基金管理人认为发生了其他的重大偏离时,基金管理人可以与基金托管人商定后进行调整,使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值,确保以摊余成本法计算的基金资产净值不会对基金持有人造成实质性的损害。(3)、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值。(4)、如有新增事项或变更事项,按国家最新规定估值。

5.8.2 本报告期内不存在剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 本基金投资的前十名证券的发行主体除上述公司之外,本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.4 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	4,984,012.24
4	应收申购款	4,393,565.51
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	9,377,577.75

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	393,891,105.77
本报告期基金总申购份额	917,470,908.43
减:本报告期基金总赎回份额	848,984,175.30
本报告期期末基金份额总额	462,377,838.90

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立光大保德信货币市场基金的文件
2、光大保德信货币市场基金基金合同
3、光大保德信货币市场基金招募说明书
4、光大保德信货币市场基金托管协议
5、光大保德信货币市场基金法律意见书
6、光大保德信基金管理有限公司的业务资格批件、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、报告期内光大保德信货币市场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

7.2 存放地点

上海市延安东路222号外滩中心大厦46层本基金管理人办公地址。

7.3 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。 客户服务中心电话:4008-202-888,021-53524620。 公司网址:www.epf.com.cn。

光大保德信基金管理有限公司
二〇一三年七月十八日

光大保德信量化核心证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013年6月30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:二〇一三年七月十八日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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2013年7月17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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	光大保德信量化股票
基金主代码	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	2004年8月27日
报告期末基金份额总额	10,577,639,827.19份
投资目标	本基金追求长期持续稳定超出业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金通过光大保德信特有的以量化投资为核心的多重优化保障体系构建处于或接近有效边际曲线的投资组合。在构建投资组合时综合考虑收益因素及风险因素,并通过投资组合优化器构建并动态优化投资组合,确保投资组合风险收益特征符合既定目标。本基金在正常市场情况下不作主动资产配置,即股票/现金等各类资产持有比例保持相对固定。投资品种基准比例:股票90% 现金10% 由于持有股票资产的市值波动导致仓位变化,股票持有比例允许在一定范围(上下5%)内浮动。
业绩比较基准	90%×富时中国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,按照风险收益配比原则对投资组合进行严格的风险管理,在风险限制范围内追求收益最大化。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)
1.本期已实现收益	272,805,436.04
2.本期利润	-566,282,595.44
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0527
4.期末基金资产净值	8,039,971,512.77
5.期末基金份额净值	0.7601

注: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。

上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。

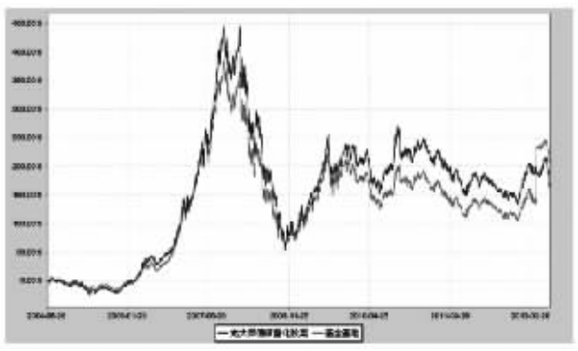
3.2 基金净值表现

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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.70%	1.42%	-9.84%	1.29%	3.13%	0.13%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2004年8月27日至2013年6月30日)



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配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

§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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
钱钧	权益投资总监、本基金基金经理	2010-12-7	-	14年	钱钧先生,硕士。毕业于南京大学国际工商管理学院,获工商管理硕士学位,曾在联合证券担任高级研究员,在西部证券担任投资经理助理等工作。2007年1月加入光大保德信基金管理有限公司任高级研究员,现任光大保德信权益投资总监、光大保德信量化核心证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为充分保护持有人利益,确保本基金管理人旗下各基金在获得投研团队、交易团队支持等各方面得到公平对待,本基金管理人从投研制度设计、组织结构设计、工作流程制定、技术系统建设和完善、公平交易执行效果评估等各方面出发,建设形成了有效的公平交易执行体系。本报告期,本基金管理人各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,未发现存在违反公平交易原则的现象。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金与其他投资组合未发生交易所公开竞价同日反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度,新的领导层对于宏观经济稳增长、调结构大政方针既定,投资者对于经济增长前景出现担忧,同时国际国内流动性出现收缩,A股在经历了4、5月的挣扎后终于在金融、地产、资源以及投资品等所谓的大盘蓝筹的带领下大幅下跌,但医药、TMT、环保、军工等中小板、创业板小市值公司则中国经济结构转型的背景下屡屡创出历史新高。

量化核心基金在二季度的操作表现不尽人意。首先,尽管我们已经在上一期的季报中提示1、宏观经济仍将延续弱复苏的格局,针对金融、地产、汽车以及国有企业的结构调整有可能使整体经济出现过冷局面;2、IPO的重启将使得A股市场总体上易跌难涨。但是由于当时在市场总体仍比较乐观的氛围下简单地认为上述因素已经被市场所反映了,因此在仓位配置上有所被动。其次,在结构上,尽管在一季度我们已经表示我们逢高减配了银行、券商等金融股,还针对有色煤炭等周期股做了部分减仓的动作,同时增持了军工、通信、环保节能等成长股,但遗憾的是,由于我们没能在新形势下及时把我们的投资决策系统由价值转变到成长上来,在具体操作中对所谓的大盘蓝筹保持了比较高的仓位,而对成长股采取了波段操作获取绝对收益的手段,因此,我们没能够进一步强化我们一季度就提出的结构转型,风格不能及时切换,二季度本基金与业内先进的差距有所拉大。

正如我们在一季报中所指出的,二季度市场已经表现出"反复且狂热地追求新经济、成长型公司,宁愿追逐短期的市场热点也坚决回避诸如银行、地产、汽车、有色、煤炭等产能过剩型的周期性产业"的特征,目前的市场估值差异已经达到甚至超越了历史峰值,这一局面在未来的一个季度甚至未来的几年中是否仍将持续?这是每一个投资者对必须面对的问题。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内份额净值增长率为-6.70%,业绩比较基准收益率为-9.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来1-2个季度,我们认为,宏观经济的弱势格局仍可能延续,但外围经济有可能改善;资金面上,随着美元走强,下半年资金稳中偏紧;新股发行将重新启动。在经济结构调整方面,国家鼓励电子、信息、交教、医药、环保、军工、新材料、新能源、重大技术装备等新兴产业的发展;鼓励消费;而在房地产、过剩产能整合、金融体制改革等方面也决策层也必将有所行动。

未来一个季度,在仓位配置上量化核心将投入更多精力争取有超额收益;同时在结构上,针对目前估值差异过高的情况将有针对性地对具体行业进行更加深入细致的梳理,力争在价值与成长中规避短期风险,同时又能在能承受的风险与估值的情况下骑上成长股的白马,争取在TMT、医药、文化传媒、节能环保、金融、地产、军工以及国企改制等板块上有所斩获,为投资者争取回报。

§5 投资组合报告

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	7,541,865,666.00	93.55
	其中:股票	7,541,865,666.00	93.55
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	447,407,758.43	5.55
6	其他各项资产	72,813,033.24	0.90
7	合计	8,062,086,457.67	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	66,269,977.19	0.82
B	采矿业	207,155,687.32	2.58
C	制造业	2,558,321,020.42	31.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	426,372,573.90	5.30
E	建筑业	75,803,420.58	0.94
F	批发和零售业	366,331,600.33	4.56
G	交通运输、仓储和邮政业	730,553,514.56	9.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	377,133,657.54	4.69
J	金融业	1,951,135,279.32	24.27
K	房地产业	616,519,703.28	7.67
L	租赁和商务服务业	17,933,659.70	0.22
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	93,179,396.86	1.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	48,936,175.00	0.61
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	6,220,000.00	0.08
	合计	7,541,865,666.00	93.80

5.3 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	601166	兴业银行	39,012,671	576,217,150.67	7.17
2	600221	海南航空	174,262,838	352,010,932.76	4.38
3	601601	中国太保	20,590,563	328,007,668.59	4.08
4	600000	浦发银行	35,911,589	297,347,956.92	3.70
5	600104	上汽集团	19,289,785	254,818,059.85	3.17
6	600009	上海机场	18,426,889	219,648,516.88	2.73
7	000616	亿城股份	66,380,374	189,184,065.90	2.35
8	000063	中兴通讯	10,828,907	138,068,564.25	1.72
9	300074	华平股份	6,933,953	125,504,549.30	1.56
10	600837	海通证券	12,229,474	114,712,466.12	1.43

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期内未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期内未持有债券。

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

报告期内本基金未投资资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 根据2013年4月23日海通证券股份有限公司《海通证券股份有限公司关于收到上海证监局行政监管措施决定书的公告》,海通证券股份有限公司收到中国证券监督管理委员会上海监管局《关于对海通证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》(沪证监决【2013】12号),中国证券监督管理委员会上海监管局决定根据《证券公司业务(产品)创新工作指引(试行)》的规定,就海通证券发行的"一海通财"系列产品系现行监管规则未予明确的创新型产品,未向中国证监会机构监管部履行创新产品方案报送义务,责令海通证券进行整改。海通证券公司已针对上述事件整改结束,本基金管理人认为海通证券股份有限公司负面事件影响已经基本消化。本基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

本基金投资的前十名证券的发行主体除上述公司之外,本期未出现被监管部门立案调查,并且未在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.9.2 本基金未投资超出基金合同规定的备选股票库。

5.9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,178,470.74
2	应收证券清算款	60,795,478.95
3	应收股利	8,452,921.54
4	应收利息	83,814.19
5	应收申购款	1,302,347.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	72,813,033.24

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600221	海南航空	347,844,000.00	4.33	非公开发行流通受限

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	10,918,683,913.14
本报告期基金总申购份额	46,295,707.23
减:本报告期基金总赎回份额	387,339,793.18
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	10,577,639,827.19

§7 影响投资者决策的其他重要信息

无

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准光大保德信量化核心证券投资基金设立的文件
2、光大保德信量化核心证券投资基金基金合同
3、光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书
4、光大保德信量化核心证券投资基金托管协议
5、光大保德信量化核心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、报告期内光大保德信量化核心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

8.2 存放地点

上海市延安东路222号外滩中心大厦46层本基金管理人办公地址。

8.3 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。 客户服务中心电话:4008-202-888,021-53524620。 公司网址:www.epf.com.cn。

光大保德信基金管理有限公司
二〇一三年七月十八日

光大保德信新增长股票型证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013年6月30日

基金管理人:光大保德信基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年七月十八日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年7月17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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	光大保德信新增长股票
基金主代码	360006
交易代码	360006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年9月14日
报告期末基金份额总额	778,214,842.17份
投资目标	本基金通过投资符合国家经济新增长模式且具有长期发展潜力的上市公司,为投资者获取稳定的收益。
投资策略	本基金为主动投资的股票型投资基金,强调投资于符合国家经济新增长模式且具有长期发展潜力的上市公司,追求长期投资回报。
业绩比较基准	75%×富时中国A200成长指数+20%×天相国债全价指数+5%×银行同业存款利率
风险收益特征	本基金为主动操作的股票型基金,属于证券投资基金中的高风险品种。本基金力争在科学的风险管理的前提下,谋求实现基金财产的安全和增值。
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)
1.本期已实现收益	41,215,418.41
2.本期利润	-34,202,924.71
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0430
4.期末基金资产净值	799,597,362.37
5.期末基金份额净值	1.0275

注: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。

上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。

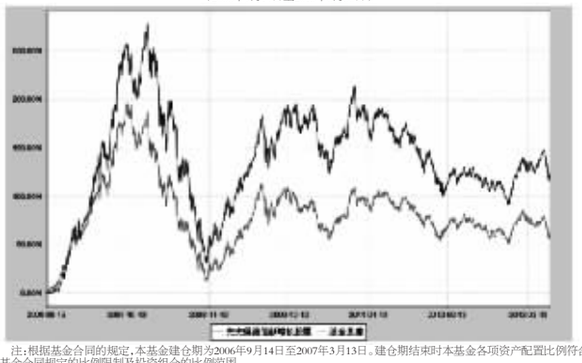
3.2 基金净值表现

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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.21%	1.11%	-6.81%	1.10%	2.60%	0.01%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

光大保德信新增长股票型证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2006年9月14日至2013年6月30日)



注:根据基金合同的规定,本基金建仓期为2006年9月14日至2007年3月13日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

§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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
高宏华	本基金基金经理	2010-12-31	2013-6-30	20年	高宏华女士,法国格勒诺布尔大学商学院工商管理硕士。1994年9月至1997年7月在鞍山证券上海总部任行业研究员;1997年至2001年在鞍山证券任投资经理;2001年5月至2004年6月在上海成大投资发展有限公司任投资部经理;2004年7月至2006年7月在长信基金管理有限公司任高级研究员及基金经理助理;2006年7月加入光大保德信基金管理有限公司,曾任投资部高级研究员、光大保德信优势配置股票型证券投资基金基金经理、光大保德信新增长股票型证券投资基金基金经理。
魏晓雪	基金经理	2013-2-28	-	6年	魏晓雪女士,毕业于浙江大学金融学专业。2006年10月至2009年9月在鹏元(北京)管理咨询有限公司上海分公司(原凯基管理咨询有限公司)担任研究员;2009年10月加入光大保德信基金管理有限公司,担任高级研究员。现任光大保德信行业轮动股票型证券投资基金基金经理兼光大保德信新增长股票型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为充分保护持有人利益,确保本基金管理人旗下各基金在获得投研团