

光大保德信中小盘股票型证券投资基金

2010年半年度报告摘要

2010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:交通银行股份有限公司

报告期起止日期:2010年1月1日至2010年6月30日

1 重要提示及信息披露

本基金管理人的董事会及高级管理人员已履行勤勉尽责义务,并对基金的内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金报告期已经公开披露,并由基金托管人复核。

本基金的托管人——交通银行股份有限公司根据本基金合同的规定,于2010年8月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本基金管理人承诺遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及基金合同,在基金运营过程中,将严格履行诚信勤勉尽责的管理义务,但不保证基金一定盈利。

基金投资者欲了解有关本基金的详细情况,请仔细阅读刊登在《证券时报》上的《光大保德信中小盘股票型证券投资基金招募说明书》。

本基金报告期未向基金份额持有人进行利润分配。

本基金财务报告未经审计。

报告期期间:2010年1月1日至2010年6月30日。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称:光大保德信中小盘股票型证券投资基金

基金简称:光大中小盘

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

报告期末基金份额总额:841,649,535.93份

2.2 基金产品说明

投资目标:本基金通过深入挖掘具有成长特性或者潜力的中小盘上市公司的投资价值,以求获取基金资产的长期增长。

本基金将通过对宏观经济基本面及证券市场双方面的数据进行研究,结合对宏观经济的判断,在控制风险的前提下,精选具有成长特性的中小盘股票以求获得高成长带来的收益,其中基金投资的股票资产

/组合中至少80%投资于中小盘股票。

业绩比较基准:本基金业绩比较基准为75%*上证指数+25%*中信金债指数收益率。

风险收益特征:本基金为股票型基金,属证券投资基金中风险收益水平较高的基金品种,其风险收益和风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目 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 交通银行股份有限公司

姓名 伍文静 张晓东

信息披露负责人 021-33074700-3105 021-32169999

电子邮箱 epfservice@epf.com.cn zhanglei@bankcomm.com

客户服务电话 400-820-2888,021-53324620

传真 021-63551152 021-67201265

2.4 基金销售方式

采取基金年度报告书面形式的基金管理人:www.epf.com.cn

互联网网址:www.epf.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、交通银行股份有限公司的办公场所。

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标 报告期(2010年4月14日(基金合同生效日)至2010年6月30日)

本期实现收入 3,654,217.23

本期利润 -133,708,438.59

加权平均基金份额利润 -0.1515

本期基金份额净值 15.38%

3.1.2 期末数据和指标 报告期末(2010年6月30日)

期末基金份额净值 712,207,871.39

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

注:(1)本基金合同生效日为2010年4月14日,在本报告期内生效,基金合同生效未满一年。

(2)本期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)扣减相关费用后的余额,本期利润为本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)。

(3)所列基金业绩指标包括所有收入扣减或交易基金的各项费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.2.2 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比如图

(2010年4月14日至2010年6月30日)

注:1.本基金合同于2010年4月14日生效,截至报告期末基金合同生效未满一年。

2.根据基金合同的约定,本基金建仓期为2010年4月14日至2010年10月13日,本基金在报告期尚处建仓期内。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理的简介

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,由光大证券股份有限公司和美国保德信金融集团旗下的保德信投资管理有限公司共同发起设立,基金公司总部设在上海,注册资本为人民币1.6亿元人民币,两家股东分别持有49%和51%的股份,公司主要从事业务基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务(涉及行政许可的业务须经行政许可机关批准)。公司总部位于上海,注册资金为人民币1.6亿元人民币,两家股东分别持有49%和51%的股份,公司主要从事业务基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务(涉及行政许可的业务须经行政许可机关批准)。

4.2 基金管理人对报告期内基金运作的说明

为充分保障持有人利益,确保基金管理人能够得到公平的对等,本基金从研制定策、组织结构、工作流程、人员安排等各方面出发,建设成高效的公平执行机制。本期报告,本基金在各公司公平执行制度得到良好地贯彻执行,未发现存在违反公平交易原则的情况。

4.3 基金管理人对报告期内基金运作的说明

目前基金管理人共持有两只基金,分别为光大保德信量化核心证券投资基金(以下简称“光大量化”)、光大保德信中小盘股票型证券投资基金(以下简称“光大中小盘”),光大保德信优势策略股票型证券投资基金(以下简称“光大优势”)、光大保德信精选股票型证券投资基金(以下简称“光大精选”)、光大保德信灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“光大灵活配置”)、光大保德信货币市场基金(以下简称“光大货币”)。

4.4 基金管理人对报告期内基金运作的说明

为充分保障持有人利益,确保基金管理人能够得到公平的对等,本基金从研制定策、组织结构、工作流程、人员安排等各方面出发,建设成高效的公平执行机制。本期报告,本基金在各公司公平执行制度得到良好地贯彻执行,未发现存在违反公平交易原则的情况。

4.5 基金管理人对报告期内基金运作的说明

目前基金管理人共持有两只基金,分别为光大保德信量化核心证券投资基金(以下简称“光大量化”)、光大保德信中小盘股票型证券投资基金(以下简称“光大中小盘”),光大保德信优势策略股票型证券投资基金(以下简称“光大优势”)、光大保德信精选股票型证券投资基金(以下简称“光大精选”)、光大保德信灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“光大灵活配置”)、光大保德信货币市场基金(以下简称“光大货币”)。

4.6 基金管理人对报告期内基金运作的说明

目前基金管理人共持有两只基金,分别为光大保德信量化核心证券投资基金(以下简称“光大量化”)、光大保德信中小盘股票型证券投资基金(以下简称“光大中小盘”),光大保德信优势策略股票型证券投资基金(以下简称“光大优势”)、光大保德信精选股票型证券投资基金(以下简称“光大精选”)、光大保德信灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“光大灵活配置”)、光大保德信货币市场基金(以下简称“光大货币”)。

4.7 基金管理人对报告期内基金运作的说明

目前基金管理人共持有两只基金,分别为光大保德信量化核心证券投资基金(以下简称“光大量化”)、光大保德信中小盘股票型证券投资基金(以下简称“光大中小盘”),光大保德信优势策略股票型证券投资基金(以下简称“光大优势”)、光大保德信精选股票型证券投资基金(以下简称“光大精选”)、光大保德信灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“光大灵活配置”)、光大保德信货币市场基金(以下简称“光大货币”)。

4.8 基金管理人对报告期内基金运作的说明

目前基金管理人共持有两只基金,分别为光大保德信量化核心证券投资基金(以下简称“光大量化”)、光大保德信中小盘股票型证券投资基金(以下简称“光大中小盘”),光大保德信优势策略股票型证券投资基金(以下简称“光大优势”)、光大保德信精选股票型证券投资基金(以下简称“光大精选”)、光大保德信灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“光大灵活配置”)、光大保德信货币市场基金(以下简称“光大货币”)。

4.9 基金管理人对报告期内基金运作的说明

目前基金管理人共持有两只基金,分别为光大保德信量化核心证券投资基金(以下简称“光大量化”)、光大保德信中小盘股票型证券投资基金(以下简称“光大中小盘”),光大保德信优势策略股票型证券投资基金(以下简称“光大优势”)、光大保德信精选股票型证券投资基金(以下简称“光大精选”)、光大保德信灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“光大灵活配置”)、光大保德信货币市场基金(以下简称“光大货币”)。

4.10 基金管理人对报告期内基金运作的说明

目前基金管理人共持有两只基金,分别为光大保德信量化核心证券投资基金(以下简称“光大量化”)、光大保德信中小盘股票型证券投资基金(以下简称“光大中小盘”),光大保德信优势策略股票型证券投资基金(以下简称“光大优势”)、光大保德信精选股票型证券投资基金(以下简称“光大精选”)、光大保德信灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“光大灵活配置”)、光大保德信货币市场基金(以下简称“光大货币”)。

4.11 基金管理人对报告期内基金运作的说明

目前基金管理人共持有两只基金,分别为光大保德信量化核心证券投资基金(以下简称“光大量化”)、光大保德信中小盘股票型证券投资基金(以下简称“光大中小盘”),光大保德信优势策略股票型证券投资基金(以下简称“光大优势”)、光大保德信精选股票型证券投资基金(以下简称“光大精选”)、光大保德信灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“光大灵活配置”)、光大保德信货币市场基金(以下简称“光大货币”)。

4.12 基金管理人对报告期内基金运作的说明

目前基金管理人共持有两只基金,分别为光大保德信量化核心证券投资基金(以下简称“光大量化”)、光大保德信中小盘股票型证券投资基金(以下简称“光大中小盘”),光大保德信优势策略股票型证券投资基金(以下简称“光大优势”)、光大保德信精选股票型证券投资基金(以下简称“光大精选”)、光大保德信灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“光大灵活配置”)、光大保德信货币市场基金(以下简称“光大货币”)。

4.13 基金管理人对报告期内基金运作的说明

目前基金管理人共持有两只基金,分别为光大保德信量化核心证券投资基金(以下简称“光大量化”)、光大保德信中小盘股票型证券投资基金(以下简称“光大中小盘”),光大保德信优势策略股票型证券投资基金(以下简称“光大优势”)、光大保德信精选股票型证券投资基金(以下简称“光大精选”)、光大保德信灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“光大灵活配置”)、光大保德信货币市场基金(以下简称“光大货币”)。

4.14 基金管理人对报告期内基金运作的说明

目前基金管理人共持有两只基金,分别为光大保德信量化核心证券投资基金(以下简称“光大量化”)、光大保德信中小盘股票型证券投资基金(以下简称“光大中小盘”),光大保德信优势策略股票型证券投资基金(以下简称“光大优势”)、光大保德信精选股票型证券投资基金(以下简称“光大精选”)、光大保德信灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“光大灵活配置”)、光大保德信货币市场基金(以下简称“光大货币”)。

4.15 基金管理人对报告期内基金运作的说明

目前基金管理人共持有两只基金,分别为光大保德信量化核心证券投资基金(以下简称“光大量化”)、光大保德信中小盘股票型证券投资基金(以下简称“光大中小盘”),光大保德信优势策略股票型证券投资基金(以下简称“光大优势”)、光大保德信精选股票型证券投资基金(以下简称“光大精选”)、光大保德信灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“光大灵活配置”)、光大保德信货币市场基金(以下简称“光大货币”)。

4.16 基金管理人对报告期内基金运作的说明

目前基金管理人共持有两只基金,分别为光大保德信量化核心证券投资基金(以下简称“光大量化”)、光大保德信中小盘股票型证券投资基金(以下简称“光大中小盘”),光大保德信优势策略股票型证券投资基金(以下简称“光大优势”)、光大保德信精选股票型证券投资基金(以下简称“光大精选”)、光大保德信灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“光大灵活配置”)、光大保德信货币市场基金(以下简称“光大货币”)。

4.17 基金管理人对报告期内基金运作的说明

目前基金管理人共持有两只基金,分别为光大保德信量化核心证券投资基金(以下简称“光大量化”)、光大保德信中小盘股票型证券投资基金(以下简称“光大中小盘”),光大保德信优势策略股票型证券投资基金(以下简称“光大优势”)、光大保德信精选股票型证券投资基金(以下简称“光大精选”)、光大保德信灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“光大灵活配置”)、光大保德信货币市场基金(以下简称“光大货币”)。

4.18 基金管理人对报告期内基金运作的说明

目前基金管理人共持有两只基金,分别为光大保德信量化核心证券投资基金(以下简称“光大量化”)、光大保德信中小盘股票型证券投资基金(以下简称“光大中小盘”),光大保德信优势策略股票型证券投资基金(以下简称“光大优势”)、光大保德信精选股票型证券投资基金(以下简称“光大精选”)、光大保德信灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“光大灵活配置”)、光大保德信货币市场基金(以下简称“光大货币”)。

4.19 基金管理人对报告期内基金运作的说明

目前基金管理人共持有两只基金,分别为光大保德信量化核心证券投资基金(以下简称“光大量化”)、光大保德信中小盘股票型证券投资基金(以下简称“光大中小盘”),光大保德信优势策略股票型证券投资基金(以下简称“光大优势”)、光大保德信精选股票型证券投资基金(以下简称“光大精选”)、光大保德信灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“光大灵活配置”)、光大保德信货币市场基金(以下简称“光大货币”)。

4.20 基金管理人对报告期内基金运作的说明

目前基金管理人共持有两只基金,分别为光大保德信量化核心证券投资基金(以下简称“光大量化”)、光大保德信中小盘股票型证券投资基金(以下简称“光大中小盘”),光大保德信优势策略股票型证券投资基金(以下简称“光大优势”)、光大保德信精选股票型证券投资基金(以下简称“光大精选”)、光大保德信灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“光大灵活配置”)、光大保德信货币市场基金(以下简称“光大货币”)。

4.21 基金管理人对报告期内基金运作的说明

目前基金管理人共持有两只基金,分别为光大保德信量化核心证券投资基金(以下简称“光大量化”)、光大保德信中小盘股票型证券投资基金(以下简称“光大中小盘”),光大保德信优势策略股票型证券投资基金(以下简称“光大优势”)、光大保德信精选股票型证券投资基金(以下简称“光大精选”)、光大保德信灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“光大灵活配置”)、光大保德信货币市场基金(以下简称“光大货币”)。

4.22 基金管理人对报告期内基金运作的说明

目前基金管理人共持有两只基金,分别为光大保德信量化核心证券投资基金(以下简称“光大量化”)、光大保德信中小盘股票型证券投资基金(以下简称“光大中小盘”),光大保德信优势策略股票型证券投资基金(以下简称“光大优势”)、光大保德信精选股票型证券投资基金(以下简称“光大精选”)、光大保德信灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“光大灵活配置”)、光大保德信货币市场基金(以下简称“光大货币”)。

4.23 基金管理人对报告期内基金运作的说明

目前基金管理人共持有两只基金,分别为光大保德信量化核心证券投资基金(以下简称“光大量化”)、光大保德信中小盘股票型证券投资基金(以下简称“光大中小盘”),光大保德信优势策略股票型证券投资基金(以下简称“光大优势”)、光大保德信精选股票型证券投资基金(以下简称“光大精选”)、光大保德信灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“光大灵活配置”)、光大保德信货币市场基金(以下简称“光大货币”)。

4.24 基金管理人对报告期内基金运作的说明

目前基金管理人共持有两只基金,分别为光大保德信量化核心证券投资基金(以下简称“光大量化”)、光大保德信中小盘股票型证券投资基金(以下简称“光大中小盘”),光大保德信优势策略股票型证券投资基金(以下简称“光大优势”)、光大保德信精选股票型证券投资基金(以下简称“光大精选”)、光大保德信灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“光大灵活配置”)、光大保德信货币市场基金(以下简称“光大货币”)。

4.25 基金管理人对报告期内基金运作的说明

目前基金管理人共持有两只基金,分别为光大保德信量化核心证券投资基金(以下简称“光大量化”)、光大保德信中小盘股票型证券投资基金(以下简称“光大中小盘”),光大保德信优势策略股票型证券投资基金(以下简称“光大优势”)、光大保德信精选股票型证券投资基金(以下简称“光大精选”)、光大保德信灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“光大灵活配置”)、光大保德信货币市场基金(以下简称“光大货币”)。