

# 光大保德信优势配置股票型证券投资基金

## 2012 年半年度报告

### 2012 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：二〇一二年八月二十七日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2012 年 8 月 24 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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
7 投资组合报告.....	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
7.6 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.....	37
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	37
7.8 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.....	37

7.9 投资组合报告附注.....	37
8 基金份额持有人信息.....	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	38
9 开放式基金份额变动.....	38
10 重大事件揭示.....	39
10.1 基金份额持有人大会决议.....	39
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	39
10.4 基金投资策略的改变.....	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	39
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	39
10.8 其他重大事件.....	43
11 备查文件目录.....	44
11.1 备查文件目录.....	44
11.2 存放地点.....	44
11.3 查阅方式.....	44

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	光大保德信优势配置股票型证券投资基金
基金简称	光大保德信优势配置股票
基金主代码	360007
交易代码	360007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年8月24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
报告期末基金份额总额	13,482,525,145.21份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金追求投资回报的实现，在严格管理风险的基础上，根据证券市场的变化进行行业配置，通过科学投资争取为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的回报。
投资策略	本基金为追求绝对收益的基金，强调在敏锐把握证券市场和中国经济变化方向的基础上，适当配置资产在各类证券和行业之间的比重，通过收益管理和稳健的投资操作为基金份额持有人谋取超过业绩比较基准的稳定回报。在行业配置方面，本基金将主要投资于国家重点支柱型产业。在个股选择上，本基金将主要投资于目标行业内按总市值排名前三分之一的大盘绩优股。
业绩比较基准	75%×沪深300指数+25%×天相国债全价指数。
风险收益特征	本基金为主动操作的股票型证券投资基金，属于证券投资基金中的较高风险品种。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。

### 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	招商银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	伍文静	张燕
	联系电话	021-33074700-3105	0755-83199084
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话	400-820-2888, 021-53524620	95555	
传真	021-63351152	0755-83195201	
注册地址	上海市延安东路 222 号外滩中心 46 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
办公地址	上海市延安东路 222 号外滩中心 46 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
邮政编码	200002	518040	
法定代表人	林昌	傅育宁	

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.epf.com.cn
基金半年度报告备置地点	光大保德信基金管理有限公司、招商银行股份有限公司的办公场所。

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	光大保德信基金管理有限公司	上海市延安东路 222 号外滩中心大厦 46 层

## 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（2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-834,137,127.41
本期利润	204,087,885.96
加权平均基金份额本期利润	0.0149
本期加权平均净值利润率	2.35%
本期基金份额净值增长率	2.35%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012年6月30日)
期末可供分配利润	-5,013,290,218.41
期末可供分配基金份额利润	-0.3718
期末基金资产净值	8,469,234,926.80
期末基金份额净值	0.6282
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-37.18%

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) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中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

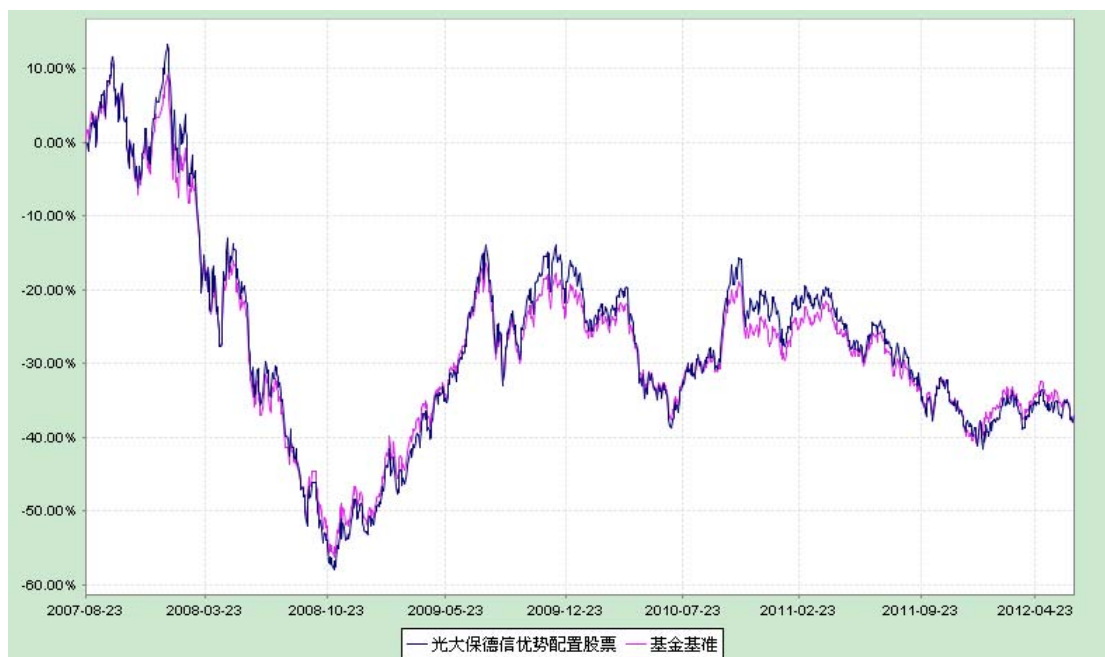
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.19%	1.03%	-4.80%	0.82%	1.61%	0.21%
过去三个月	2.36%	0.99%	0.52%	0.84%	1.84%	0.15%
过去六个月	2.35%	1.21%	4.32%	1.00%	-1.97%	0.21%
过去一年	-15.03%	1.18%	-13.45%	1.01%	-1.58%	0.17%
过去三年	-13.09%	1.36%	-13.99%	1.17%	0.90%	0.19%
自基金合同生效起至今	-37.18%	1.67%	-37.07%	1.53%	-0.11%	0.14%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计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

光大保德信优势配置股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2007年8月24日至2012年6月30日)



注：根据基金合同的规定，本基金建仓期为 2007 年 8 月 24 日至 2008 年 2 月 23 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 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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创建，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 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（涉及行政许可的凭许可证经营），今后，将在法律法规允许的范围内为各类投资者提供更多资产管理服务。

截至 2012 年 6 月 30 日，光大保德信旗下管理着 12 只开放式基金，即光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信货币市场基金、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、光大保德信均衡精选股票型证券投资基金、光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信中小盘股票型证券投资基金、光大保德信信用添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和光大保德信添天利



季度开放短期理财债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
周炜炜	首席投资总 监兼本基金 基金经理	2011-03-26	-	10 年	周炜炜先生，CFA，伦敦商学院金融学硕士、香港大学商学院-复旦大学管理学院工商管理硕士。1998 年至 2000 年任职于德意志银行上海分行，任助理副总裁；2000 年至 2001 年任职于美国思腾思特管理咨询中国有限公司，任副总裁；2002 年至 2006 年任职于招商基金管理有限公司，历任招商先锋证券投资基金基金经理、基金管理部副总监；2006 年至 2010 年 10 月任职于交银施罗德基金管理有限公司，历任交银施罗德成长股票证券投资基金基金经理、权益投资部总经理、投资副总监；2010 年 11 月加入光大保德信基金管理有限公司，现任首席投资总监兼光大保德信优势配置股票型证券投资基金基金经理。

注：1、“任职日期”和“离任日期”分别为公司决定确定的聘任日期和解聘日期

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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规定，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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 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 管理人对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

在 2012 年上半年，本基金认为市场的系统性风险在 2011 年已较充分地释放，在市场调整过程中加大估值更加合理的成长性股票的投资，这部分投资在今年以来取得了良好的表现。但是，在一季度末，由于本基金认为二季度是经济开始触底反弹，同时通胀继续下行的阶段，所以在季度末增加了周期成长性行业的配置，以增加组合阶段性的弹性。而实际上，这些投资在二季度的效果不佳。

#### 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 2.35%，业绩比较基准收益率为 4.32%。

### 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 2012 年全年，本基金认为随着通胀也会从相对高位持续回落，货币政策在下半年还有继续放松的空间。而累计的微调的稳增长政策效应也会在下半年在边际上产生效果，通过投资的带动，使中国经济在下半年阶段性的寻底成功。非银行上市公司的盈利也会在今年四季度和明年一季度开始改善，从而成为继政策预期和流动性改善推动股市后，又一阶段性重要的股市推进器。更多的产业资本会根据实体经济的投资回报和股市的隐含回报率之间进行判断，使它们做出增大对股票投资的决定。除非发生债务通缩和银行危机，否则，市场的

整体估值水平继续下移的空间在缩小，长期的投资价值在逐步体现。

从更长远的角度看，本基金认为在中国经济增速趋缓但质量更加精细的环境中，投资者面对许多结构性的机会。如果过去十年，伴随着我国经济高速但粗放发展中，我们看到了许多上市公司随着行业的高速发展，由小变大的过程，但大量行业还是集中度非常分散，大公司还不是真正的强大。未来几年，我国经济降速转型过程中，我们可以看到许多公司由大变强的过程。我们已经看到，在经济剧烈波动的冲击下，一批优势企业在此轮经济危机调整和复苏过程中，持续扩大了其市场份额。我们有理由相信，在未来中国经济增速趋缓的过程中，这一批优势企业受益于其优于同业的竞争优势，成为行业的整合者，不断提高行业集中度，从而使得我国的各个行业的竞争效率提高，盈利能力也随之提高。相信经过未来几年的经济趋缓和行业整合的过程中，我们将迎来一批更高质量的具有全球竞争力的上市公司，这也是中国股市长期健康发展的基石。从战略导向上和财务指标看，这些公司通常都是能持续为股东创造价值的优质的成长企业，市场也会给他们更高的估值。本基金会在平衡权重价值类股票投资的基础上，自下而上不断挖掘上述这一批能持续为股东创造价值的优势成长企业，从而录得超越指数的回报。

当然，本基金密切关注国内政策的变化、全球其它经济体的复苏和货币政策的变化等，从而对组合的结构进行调整，以保证本基金组合在长时间内取得较好业绩。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》及监管机关有关规定和《光大保德信基金管理有限公司基金估值委员会工作制度》进行。日常估值由基金管理人和本基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计的财务核对同时进行。

报告期内，公司设立由公司分管高管、监察稽核部、运营部、投资研究部（包括基金经理、研究团队、数量分析小组）、IT 部代表人员组成的估值委员会。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，选择基金估值模型及估值模型假设，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。基金估值政策的议定和修改采用集体决策机制，对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由公司估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行、审计师沟通后形成建议，经公司管理

层批准后由运营部具体执行。估值委员会向公司管理层提交推荐建议前，应审慎平衡托管行、审计师和基金同业的意见，并必须获得估值委员会三分之二以上成员同意。

公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和长期相关工作经验，并具有广泛的代表性，成员包括监察稽核代表 1 人、研究团队代表 1 人、基金经理代表 1 人、数量分析小组代表 1 人、基金会计代表 3 人、与估值相关的 IT 工程师 1 人、运营部主管 1 人、公司分管运营的高管 1 人。基金经理作为估值委员会成员参与讨论，仅享有一票表决权。

委员会对各相关部门和代表人员的分工如下：投资研究部和运营部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；运营部根据估值的专业技术对需要进行估值政策调整的品种提出初步意见提交估值委员会讨论，负责就估值政策调整的合规事宜与监察稽核部协商，负责执行基金估值政策进行日常估值业务并定期审核估值政策和程序的一致性，负责与托管行、审计师、基金同业、监管机关沟通估值调整事项；监察稽核部就估值程序的合法合规发表意见；投资研究部负责估值政策调整对投资业绩影响的评估，数量小组负责估值政策调整对投资绩效的评估；IT 部就估值政策调整的技术实现进行评估。

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值定价服务机构签约。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同以及基金实际运作情况，本基金本报告期内不进行利润分配。

## 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

# 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：光大保德信优势配置股票型证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	908,521,856.82	920,561,158.68
结算备付金		10,040,111.84	1,793,088.70
存出保证金		500,000.00	1,230,295.51
交易性金融资产	6.4.7.2	7,560,470,776.66	7,651,821,602.92
其中：股票投资		7,423,208,770.66	7,517,745,878.92
基金投资		-	-
债券投资		137,262,006.00	134,075,724.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		9,340,238.83	-
应收利息	6.4.7.5	775,810.29	441,627.61
应收股利		-	-
应收申购款		56,526.05	179,804.35
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		8,489,705,320.49	8,576,027,577.77
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2012 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2011 年 12 月 31 日</b>
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	46,230,269.26
应付赎回款		2,757,775.58	1,283,876.42
应付管理人报酬		10,599,299.68	11,047,370.37
应付托管费		1,766,549.94	1,841,228.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,637,674.94	1,393,680.31
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	709,093.55	920,318.86
负债合计		20,470,393.69	62,716,743.60
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	13,482,525,145.21	13,870,283,580.02
未分配利润	6.4.7.10	-5,013,290,218.41	-5,356,972,745.85
所有者权益合计		8,469,234,926.80	8,513,310,834.17
负债和所有者权益总计		8,489,705,320.49	8,576,027,577.77

注：报告截止日 2012 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.6282 元，基金份额总额 13,482,525,145.21 份。

## 6.2 利润表

会计主体：光大保德信优势配置股票型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>295,223,459.68</b>	<b>-426,095,468.06</b>
1.利息收入		3,920,365.68	5,999,875.75
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,063,839.97	4,714,699.02

债券利息收入		366,610.36	109,724.30
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		489,915.35	1,175,452.43
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-746,933,968.44	238,077,410.95
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-835,438,691.35	155,691,154.60
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-2,797,812.07	1,456,789.03
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	91,302,534.98	80,929,467.32
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,038,225,013.37	-670,205,875.57
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	12,049.07	33,120.81
<b>减：二、费用</b>		<b>91,135,573.72</b>	<b>120,461,430.94</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	64,760,537.67	82,616,913.19
2. 托管费	6.4.10.2.2	10,793,423.01	13,769,485.54
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	15,356,991.43	23,840,043.11
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	224,621.61	234,989.10
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>204,087,885.96</b>	<b>-546,556,899.00</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>204,087,885.96</b>	<b>-546,556,899.00</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：光大保德信优势配置股票型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益（基金净值）	13,870,283,580.02	-5,356,972,745.85	8,513,310,834.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	204,087,885.96	204,087,885.96
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-387,758,434.81	139,594,641.48	-248,163,793.33
其中：1. 基金申购款	24,967,629.10	-9,215,771.01	15,751,858.09
2. 基金赎回款	-412,726,063.91	148,810,412.49	-263,915,651.42
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	13,482,525,145.21	-5,013,290,218.41	8,469,234,926.80
项目	上年度可比期间		
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	14,942,253,528.18	-3,325,458,451.61	11,616,795,076.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-546,556,899.00	-546,556,899.00
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-689,980,061.54	156,760,829.89	-533,219,231.65
其中：1. 基金申购款	273,085,135.04	-56,866,370.45	216,218,764.59
2. 基金赎回款	-963,065,196.58	213,627,200.34	-749,437,996.24
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	14,252,273,466.64	-3,715,254,520.72	10,537,018,945.92

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：傅德修，主管会计工作负责人：梅雷军，会计机构负责人：王永

万



## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

光大保德信优势配置股票型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2007]223号文《关于同意光大保德信优势配置股票型证券投资基金募集的批复》的核准,由光大保德信基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行人募集,基金合同于2007年8月24日正式生效,首次设立募集规模为9,905,973,604.86份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为光大保德信基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金为股票型基金,投资范围包括国内依法发行、上市的股票、债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。股票资产占基金资产不少于60%,最高可达基金资产的90%,现金或者到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,权证不超过基金资产净值的3%。本基金的业绩比较基准为:75%\*沪深300指数+25%\*天相国债全价指数。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2012年06月30日的财务状况以及2012年上半年度的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3% 调整为 1%；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### 2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

##### 3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策

的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50% 计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
活期存款	908,521,856.82
定期存款	-
其他存款	-
合计	908,521,856.82

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2012年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		8,242,102,374.66	7,423,208,770.66	-818,893,604.00
债券	交易所市场	153,003,888.38	137,262,006.00	-15,741,882.38
	银行间市场	-	-	-
	合计	153,003,888.38	137,262,006.00	-15,741,882.38
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		8,395,106,263.04	7,560,470,776.66	-834,635,486.38

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末无衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.4 买入返售金融资产

###### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本期末无买入返售金融资产。

###### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应收活期存款利息	183,893.65
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	4,518.00
应收债券利息	587,397.96
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.68
其他	-
合计	775,810.29

#### 6.4.7.6 其他资产

本期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
交易所市场应付交易费用	4,637,674.94
银行间市场应付交易费用	-
合计	4,637,674.94

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	243.09
应付后端申购费	-
债券利息税	-
预提费用	208,850.46
银行手续费	-
合计	709,093.55

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,870,283,580.02	13,870,283,580.02
本期申购	24,967,629.10	24,967,629.10
本期赎回（以“-”号填列）	-412,726,063.91	-412,726,063.91
本期末	13,482,525,145.21	13,482,525,145.21

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,228,798,040.59	-1,128,174,705.26	-5,356,972,745.85
本期利润	-834,137,127.41	1,038,225,013.37	204,087,885.96
本期基金份额交易产生的变动数	131,735,061.17	7,859,580.31	139,594,641.48
其中：基金申购款	-8,315,698.09	-900,072.92	-9,215,771.01
基金赎回款	140,050,759.26	8,759,653.23	148,810,412.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,931,200,106.83	-82,090,111.58	-5,013,290,218.41

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
活期存款利息收入	3,007,610.48
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	55,513.06
其他	716.43
合计	3,063,839.97

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出股票成交总额	5,117,458,740.94
减：卖出股票成本总额	5,952,897,432.29
买卖股票差价收入	-835,438,691.35

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	21,566,983.00

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	24,297,901.92
减：应收利息总额	66,893.15
债券投资收益	-2,797,812.07

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	91,302,534.98
基金投资产生的股利收益	-
合计	91,302,534.98

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
1. 交易性金融资产	1,038,225,013.37
——股票投资	1,032,950,813.01
——债券投资	5,274,200.36
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	1,038,225,013.37

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	9,011.13
印花税返还	2,510.21
转换费收入	527.73
合计	12,049.07

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
----	----------------------------

交易所市场交易费用	15,356,991.43
银行间市场交易费用	-
合计	15,356,991.43

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
审计费用	59,672.34
信息披露费	149,178.12
账户维护费	9,000.00
其他费用	6,771.15
合计	224,621.61

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
光大保德信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
光大证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
光大证券	1,988,600,117.99	20.03%	1,015,455,424.15	6.50%

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度均未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
光大证券	43,826,983.00	100.00%	123,452,215.80	75.46%

### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
光大证券	1,697,463.09	20.27%	927,712.01	20.00%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
光大证券	863,137.56	6.59%	863,137.56	13.03%

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买（卖）证管费等）。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	64,760,537.67	82,616,913.19
其中：支付销售机构的客户维护费	19,815,122.24	25,484,913.38

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值



基金管理费每日计提, 逐日累计至每个月月末, 按月支付, 由基金管理人于次月首日起三个工作日内向基金托管人发送基金管理费划付指令, 基金托管人在收到计算结果当日完成复核, 并于当日从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等, 支付日期顺延。

#### 6.4.10.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012年1月1日至2012年6月30日	2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	10,793,423.01	13,769,485.54

注: 基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提, 逐日累计至每个月月末, 按月支付, 由基金管理人于次月首日起三个工作日内向基金托管人发送基金托管费划付指令, 基金托管人在收到计算结果当日完成复核, 并于当日从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等, 支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年同期均未通过关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方于本期期末和上年度可比期末均未投资本基金。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2012年1月1日至2012年6月30日		2011年1月1日至2011年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	908,521,856.82	3,007,610.48	1,012,883,543.91	4,592,384.04

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末(2012年6月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末未有因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

报告期末本基金未有银行间市场债券正回购。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

报告期末本基金未有证券交易所债券正回购。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理体系包括三个层次：第一层次是基于自我评估和管理的业务/职能部门；第二层次是公司经营层的风险管理工作委员会；第三层次是董事会下设的风险管理委员会。

各业务/职能部门是公司风险管理工作最直接的实施者，负责根据公司风险管理政策和制度，制订本部门的风险管理计划、工作流程及相关管理责任，并报请风险管理工作委员会审议批准；对本部门的主要风险指标，以及相关的测量、管理方法提出建议，并及时更新，报请风险管理工作委员会审议批准；实施本部门的风险管理日常工作，定期进行自我评估，并向风险管理工作委员会报告评估情况。

风险管理工作委员会是公司经营层面负责风险管理的最高权力机构，根据公司董事会和风险管理委员会制订的风险管理政策和授权，负责公司日常的风险管理工作。

风险管理委员会是公司风险管理的最高权力机构，其机构组成、运行方式和相应职责应由董事会规定。

本基金管理人风险管理部门建立了对基金进行风险评估的数量化系统，可以从各个不同的层面对基金所承受的各类风险进行密切跟踪。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市

场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，本期末本基金的资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人风险管理部门从资产配置、行业配置、个股选择等层面制定相应的流动性指标，设定相应的预警阈值，并通过风险评估系统对这些流动性指标进行持续的监测、评估，根据评估结果及时提出流动性风险管理建议。

本基金管理人通过设定对单一证券的投资比例限制，建立相应的授权审批制度，在保护基金持有人利益最大化的前提下，有效管理基金因在单一证券投资比例过高所带来的个股流动性风险。

本基金管理人通过制定流通受限证券的投资流程及风险处置预案，有效管理基金投资流通受限证券所承受的流动性风险。

本基金管理人通过分析本基金持有人结构、密切跟踪监控基金申购赎回趋势，有效预测本基金的流动性需求。同时，本基金管理人通过进行基金变现能力测试得出基金在各市场情形下的变现能力，通过情景分析及压力测试，评估基金在极端情形下面临的流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险及其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金通过监控组合货币久期来管理基金面临的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012 年6月 30日	1个月以内	1-3 个月	3个月 -1年	1 - 5 年	5 年 以上	不计息	合计
资产							
银行存款	908,521,856.82	-	-	-	-	-	908,521,856.82
结算 备付 金	10,040,111.84	-	-	-	-	-	10,040,111.84
存出 保证 金	-	-	-	-	-	500,000.00	500,000.00

交易性金融资产	-	137,262,006.00	-	-	-	7,423,208,770.66	7,560,470,776.66
应收利息	-	-	-	-	-	775,810.29	775,810.29
应收申购款	988.14	-	-	-	-	55,537.91	56,526.05
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	9,340,238.83	9,340,238.83
资产总计	918,562,956.80	137,262,006.00	-	-	-	7,433,880,357.69	8,489,705,320.49
负债							
应付托管费	-	-	-	-	-	1,766,549.94	1,766,549.94
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,637,674.94	4,637,674.94
其他负债	-	-	-	-	-	709,093.55	709,093.55
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	10,599,299.68	10,599,299.68
应付	-	-	-	-	-	2,757,775.58	2,757,775.58

赎回款							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-	-	20,470,393.69	20,470,393.69
利率敏感程度缺口	918,562,956.80	137,262,006.00	-	-	-	7,413,409,964.00	8,469,234,926.80
上年度末 2011 年 12 月 31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	920,561,158.68	-	-	-	-	-	920,561,158.68
结算备付金	1,793,088.70	-	-	-	-	-	1,793,088.70
存出保证金	260,000.00	-	-	-	-	970,295.51	1,230,295.51
交易性金融资产	-	-	134,075,724.00	-	-	7,517,745,878.92	7,651,821,602.92
应收利息	-	-	-	-	-	441,627.61	441,627.61
应收申购	-	-	-	-	-	179,804.35	179,804.35

款							
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	922,614,247.38	-	134,075,724.00	-	-	7,519,337,606.39	8,576,027,577.77
负债							
应付托管费	-	-	-	-	-	1,841,228.38	1,841,228.38
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,393,680.31	1,393,680.31
其他负债	-	-	-	-	-	920,318.86	920,318.86
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	11,047,370.37	11,047,370.37
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,283,876.42	1,283,876.42
应付证券清算款	-	-	-	-	-	46,230,269.26	46,230,269.26
负债总计	-	-	-	-	-	62,716,743.60	62,716,743.60

利率 敏感 度缺 口	922,614,247.38	-	134,075,724.00	-	-	7,456,620,862.79	8,513,310,834.17
---------------------	----------------	---	----------------	---	---	------------------	------------------

注：上表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	资产净值变动与利率变动成负相关，相关系数为资产组合的货币久期		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币）	
		本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
	基准利率上升1%	减少约561.68万元	减少约615.41万元
	基准利率下降1%	增加约561.68万元	增加约615.41万元

注：上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金管理人风险管理部门通过监控基金的大类资产配置比例，行业及个股集中度，行业配置相对业绩基准的偏离度，重仓行业及个股的业绩表现，研究深度等，评估并有效管理基金面临的的市场价格风险。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日		上年度末 2011年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例	公允价值	占基金资产 净值比例

		(%)		(%)
交易性金融资产-股票投资	7,423,208,770.66	87.65	7,517,745,878.92	88.31
交易性金融资产-债券投资	137,262,006.00	1.62	134,075,724.00	1.57
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	7,560,470,776.66	89.27	7,651,821,602.92	89.88

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金未来业绩表现相对业绩基准的波动性与本报告期的整体水平保持一致		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币）	
		本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
	业绩基准净值增加1%	增加约9,880.07万元	增加约9,428.57万元
	业绩基准净值减少1%	减少约9,880.07万元	减少约9,428.57万元

注：上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金无需要说明的其他事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	7,423,208,770.66	87.44
	其中：股票	7,423,208,770.66	87.44
2	固定收益投资	137,262,006.00	1.62
	其中：债券	137,262,006.00	1.62
	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	918,561,968.66	10.82
6	其他各项资产	10,672,575.17	0.13
7	合计	8,489,705,320.49	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	141,166,568.16	1.67
C	制造业	3,028,913,266.35	35.76
C0	食品、饮料	477,784,769.56	5.64
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	122,947,515.14	1.45
C5	电子	14,511,966.00	0.17
C6	金属、非金属	469,864,621.10	5.55
C7	机械、设备、仪表	1,184,024,268.75	13.98
C8	医药、生物制品	759,780,125.80	8.97
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	49,205,594.75	0.58
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	741,074,073.04	8.75
H	批发和零售贸易	762,376,099.62	9.00
I	金融、保险业	1,598,136,520.24	18.87
J	房地产业	572,838,720.20	6.76
K	社会服务业	434,608,818.38	5.13
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	94,889,109.92	1.12
	合计	7,423,208,770.66	87.65

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	600585	海螺水泥	30,065,818	445,575,422.76	5.26

2	601318	中国平安	9,429,658	431,312,556.92	5.09
3	600690	青岛海尔	31,852,221	373,308,030.12	4.41
4	600016	民生银行	62,000,000	371,380,000.00	4.39
5	000069	华侨城 A	54,149,870	345,476,170.60	4.08
6	600383	金地集团	53,244,559	345,024,742.32	4.07
7	601877	正泰电器	19,801,712	302,174,125.12	3.57
8	002024	苏宁电器	32,900,000	276,031,000.00	3.26
9	601601	中国太保	12,177,700	270,101,386.00	3.19
10	000895	双汇发展	4,244,267	262,635,241.96	3.10
11	000999	华润三九	11,916,218	260,369,363.30	3.07
12	000063	中兴通讯	18,299,940	255,467,162.40	3.02
13	600588	用友软件	16,196,156	247,153,340.56	2.92
14	600030	中信证券	15,999,749	202,076,829.87	2.39
15	600557	康缘药业	13,083,867	193,379,554.26	2.28
16	000963	华东医药	6,209,966	187,540,973.20	2.21
17	600827	友谊股份	15,526,587	175,605,698.97	2.07
18	601369	陕鼓动力	17,562,359	162,627,444.34	1.92
19	600050	中国联通	43,676,186	162,475,411.92	1.92
20	600325	华发股份	17,466,094	148,811,120.88	1.76
21	600000	浦发银行	15,359,631	124,873,800.03	1.47
22	600479	千金药业	10,014,134	119,168,194.60	1.41
23	600837	海通证券	10,999,834	105,928,401.42	1.25
24	000933	神火股份	11,201,645	102,159,002.40	1.21
25	600858	银座股份	8,374,874	98,656,015.72	1.16
26	600649	城投控股	13,142,536	94,889,109.92	1.12
27	600519	贵州茅台	390,180	93,311,547.00	1.10
28	601688	华泰证券	8,806,052	92,463,546.00	1.09
29	300257	开山股份	2,940,694	83,809,779.00	0.99
30	000651	格力电器	3,879,741	80,892,599.85	0.96
31	000527	美的电器	7,185,622	79,401,123.10	0.94
32	000926	福星股份	8,458,550	79,002,857.00	0.93
33	600118	中国卫星	5,737,974	72,241,092.66	0.85
34	002126	银轮股份	11,450,424	71,908,662.72	0.85
35	002385	大北农	3,225,969	62,583,798.60	0.74
36	600600	青岛啤酒	1,550,000	59,194,500.00	0.70
37	300119	瑞普生物	3,199,533	52,472,341.20	0.62
38	300012	华测检测	2,363,446	50,648,647.78	0.60
39	600352	浙江龙盛	8,812,494	50,495,590.62	0.60
40	600496	精工钢构	6,349,109	49,205,594.75	0.58
41	002497	雅化集团	3,379,708	45,592,260.92	0.54
42	600085	同仁堂	2,544,741	44,405,730.45	0.52

43	601088	中国神华	1,735,212	39,007,565.76	0.46
44	000888	峨眉山 A	1,800,000	38,484,000.00	0.45
45	600196	复星医药	3,399,898	35,052,948.38	0.41
46	002152	广电运通	1,812,273	29,902,504.50	0.35
47	000401	冀东水泥	1,727,539	24,289,198.34	0.29
48	000887	中鼎股份	2,759,240	23,425,947.60	0.28
49	601258	庞大集团	3,800,323	23,181,970.30	0.27
50	601607	上海医药	2,000,000	21,340,000.00	0.25
51	000989	九芝堂	1,230,981	19,941,892.20	0.24
52	002389	南洋科技	868,980	14,511,966.00	0.17
53	002603	以岭药业	286,143	7,883,239.65	0.09
54	600267	海正药业	329,912	5,766,861.76	0.07
55	600406	国电南瑞	199,950	3,737,065.50	0.04
56	603001	奥康国际	127,600	3,433,716.00	0.04
57	601010	文峰股份	91,489	1,360,441.43	0.02
58	600887	伊利股份	2,900	59,682.00	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600585	海螺水泥	372,151,668.97	4.37
2	601318	中国平安	210,950,514.34	2.48
3	600030	中信证券	208,731,078.92	2.45
4	600690	青岛海尔	207,936,474.06	2.44
5	601369	陕鼓动力	195,938,454.45	2.30
6	000933	神火股份	173,258,394.25	2.04
7	600325	华发股份	160,909,867.07	1.89
8	600176	中国玻纤	142,941,747.37	1.68
9	000401	冀东水泥	127,231,534.24	1.49
10	600383	金地集团	125,788,463.21	1.48
11	600649	城投控股	125,109,854.18	1.47
12	600028	中国石化	111,888,094.82	1.31
13	000926	福星股份	109,615,667.68	1.29
14	600050	中国联通	107,346,881.89	1.26
15	600837	海通证券	103,966,295.78	1.22
16	000728	国元证券	100,034,722.96	1.18
17	000069	华侨城 A	97,896,088.04	1.15

18	601688	华泰证券	96,880,605.57	1.14
19	000651	格力电器	96,667,580.13	1.14
20	000063	中兴通讯	92,604,083.58	1.09

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000002	万科A	291,020,412.14	3.42
2	601088	中国神华	289,398,342.56	3.40
3	600000	浦发银行	269,504,516.48	3.17
4	600376	首开股份	264,644,568.86	3.11
5	600050	中国联通	178,600,689.07	2.10
6	600015	华夏银行	171,487,292.92	2.01
7	600176	中国玻纤	144,561,687.11	1.70
8	000401	冀东水泥	144,340,578.02	1.70
9	600489	中金黄金	140,959,568.42	1.66
10	000063	中兴通讯	134,591,772.08	1.58
11	600028	中国石化	107,546,864.50	1.26
12	600519	贵州茅台	104,444,787.54	1.23
13	000728	国元证券	103,693,715.70	1.22
14	600511	国药股份	102,597,397.74	1.21
15	600697	欧亚集团	100,139,068.55	1.18
16	600694	大商股份	94,528,435.26	1.11
17	002065	东华软件	92,428,220.03	1.09
18	000887	中鼎股份	91,762,845.09	1.08
19	002281	光迅科技	85,263,794.68	1.00
20	000527	美的电器	83,649,787.98	0.98

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	4,825,409,511.02
卖出股票的收入（成交）总额	5,117,458,740.94

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-

2	央行票据	-	-
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	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	137,262,006.00	1.62
8	其他	-	-
9	合计	137,262,006.00	1.62

### 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113002	工行转债	1,259,400	137,262,006.00	1.62

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

### 7.8 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。

### 7.9 投资组合报告附注

7.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情况。

7.9.2 本报告期内基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

#### 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	500,000.00
2	应收证券清算款	9,340,238.83
3	应收股利	-
4	应收利息	775,810.29

5	应收申购款	56,526.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,672,575.17

#### 7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113002	工行转债	137,262,006.00	1.62

#### 7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金前十名股票中未存在流通受限情况。

### 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
670,574	20,105.95	298,566,096.72	2.21%	13,183,959,048.49	97.79%

#### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	18,689.59	0.00%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金的基金经理均未持有本基金的份额。

### 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007年8月24日）基金份额总额	9,905,973,604.86
本报告期期初基金份额总额	13,870,283,580.02

本报告期基金总申购份额	24,967,629.10
减：本报告期基金总赎回份额	412,726,063.91
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	13,482,525,145.21

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金在本报告期内的投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券股份有限公司	1	1,988,600,117.99	20.03%	1,697,463.09	20.27%	-
东方证券股份有限公司	2	1,836,804,844.63	18.50%	1,539,077.10	18.38%	-
安信证券股份有限公司	1	1,048,636,394.79	10.56%	891,337.56	10.64%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	797,165,386.67	8.03%	654,512.00	7.81%	-
中信证券股份有限公司	1	678,023,300.44	6.83%	578,772.97	6.91%	-
中金公司	1	555,525,643.96	5.59%	458,963.41	5.48%	-
兴业证券股份有限公司	1	543,911,921.72	5.48%	465,019.56	5.55%	-
国金证券有限责任公司	2	456,112,826.77	4.59%	373,091.81	4.45%	-
瑞银证券股份有限公司	1	449,593,764.90	4.53%	384,204.00	4.59%	-
东兴证券	1	415,923,650.75	4.19%	353,535.41	4.22%	-
招商证券股份有限公司	1	362,813,077.91	3.65%	311,217.09	3.72%	-
申银万国证券股份有限公司	1	256,639,134.02	2.58%	210,699.35	2.52%	-
华泰证券股份有限公司	3	249,768,108.39	2.52%	212,238.81	2.53%	-
中国银河证券股份有限公司	1	115,048,786.96	1.16%	97,792.82	1.17%	-
国信证券有限责任公司	1	75,679,815.95	0.76%	64,712.50	0.77%	-
中信建投证券有限责任公司	2	63,007,008.88	0.63%	51,194.21	0.61%	-
海通证券股份有限公司	1	36,984,467.23	0.37%	31,436.38	0.38%	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证	1	-	-	-	-	-



券有限公司						
-------	--	--	--	--	--	--

注：（1）报告期内租用证券公司交易单元变更情况

报告期内停止租用中邮证券。

（2）选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

基金管理人选择证券经营机构，并选用其交易单元供本基金买卖证券专用，应本着安全、高效、低成本，能够为本基金提供高质量增值研究服务的原则，对该证券经营机构的经营情况、治理情况、研究实力等进行综合考量。

基本选择标准如下：

实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；

财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

经营行为规范，近两年未发生重大违规行为而受到证监会处罚；

内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求，并能为本基金提供全面的信息服务；

研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务；

对于某一领域的研究实力超群，或是能够提供全方面，高质量的服务。

（3）选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

投资研究团队按照（2）中列出的有关经营情况、治理情况的选择标准，对备选的证券经营机构进行初步筛选；

对通过初选的各证券经营机构，投资研究团队各成员在其分管行业或领域的范围内，对该机构所提供的研究报告和信息资讯进行评分。

根据各成员评分，得出各证券经营机构的综合评分。

投资研究团队根据各机构的得分排名，拟定要选用其专用交易单元的证券经营机构，并报本管理人董事会批准。

经董事会批准后，由本管理人交易部门、运营部门配合完成专用交易单元的具体租用事宜。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期	成交金额	占当期回	成交金额	占当期

		债券成交总额的比例		购成交总额的比例		权证成交总额的比例
光大证券股份有限公司	43,826,983.00	100.00%	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券有限公司	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下部分基金继续参与中信银行股份有限公司网上银行、移动银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012-06-29
2	关于旗下部分基金继续参与交通银行股份有限公司网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012-06-18
3	关于旗下部分基金参与深圳众禄基金销售有限公司基金申购、基金定期定额投资申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012-06-14
4	关于旗下基金新增深圳众禄基金销售有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012-06-05
5	关于旗下部分基金新增中国农业银行股份有限公司为代销机构并同时开通基金定期定额申购及基金转换业务的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012-05-23
6	关于旗下基金新增上海天天基金销售有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012-05-23
7	关于旗下基金新增上海好买基金销售有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012-05-19
8	关于旗下部分基金参与中国邮政储蓄银行股份有限公司个人手机银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012-04-27
9	光大保德信优势配置股票型证券投资基金 2012年第1季度报告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012-04-21
10	光大保德信优势配置股票型证券投资基金招募说明书（更新）	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012-04-07
11	光大保德信优势配置股票型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012-04-07
12	关于旗下部分基金新增洛阳银行股份有限公司为代销机构同时开通基金定期定额投资及基金转换业务的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012-03-30
13	关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012-03-30
14	光大保德信优势配置股票型证券投资基金	《中国证券报》、	2012-03-29

	2011年年度报告	《上海证券报》、 《证券时报》	
15	光大保德信优势配置股票型证券投资基金 2011年年度报告摘要	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012-03-29
16	关于光大保德信基金管理有限公司旗下基金 通过网上直销进行基金定期定额投资业务 的费率优惠公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012-03-15
17	光大保德信优势配置股票型证券投资基金 2011年第4季度报告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012-01-19

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、 中国证监会批准光大保德信优势配置股票型证券投资基金设立的文件
- 2、 光大保德信优势配置股票型证券投资基金基金合同
- 3、 光大保德信优势配置股票型证券投资基金招募说明书
- 4、 光大保德信优势配置股票型证券投资基金托管协议
- 5、 光大保德信优势配置股票型证券投资基金法律意见书
- 6、 光大保德信优势配置股票型证券投资基金财务报表及报表附注
- 7、 基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
- 8、 基金托管人业务资格批件和营业执照
- 9、 中国证监会要求的其他文件

### 11.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网网站 [www.epf.com.cn](http://www.epf.com.cn)，光大保德信基金管理有限公司客服电话：4008-202-888 或 021-53524620。

### 11.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

光大保德信基金管理有限公司  
二〇一二年八月二十七日