

光大保德信红利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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	14
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.....	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
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.....	32
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.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
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.....	38
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.....	39
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.....	39

7.9 投资组合报告附注.....	39
8 基金份额持有人信息.....	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	40
9 开放式基金份额变动.....	40
10 重大事件揭示.....	40
10.1 基金份额持有人大会决议.....	40
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.....	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	41
10.4 基金投资策略的改变.....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	41
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.....	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	41
10.8 其他重大事件.....	44
11 备查文件目录.....	45
11.1 备查文件目录.....	45
11.2 存放地点.....	46
11.3 查阅方式.....	46

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	光大保德信红利股票型证券投资基金
基金简称	光大保德信红利股票
基金主代码	360005
交易代码	360005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年3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	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,038,338,836.65份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对高分红类股票及其他具有投资价值的股票进行投资，为基金资产获取稳定的当期收益和长期增值。
投资策略	本基金为股票型投资基金，强调收益的当期实现与资产的长期增值。高分红类股票及其他具有投资价值的股票是本基金的主要投资对象。基金管理人将充分发挥自身的研究力量，利用公司研究开发的各种数量模型工具，采用科学的投资策略，发现和捕捉市场的机会，实现基金的投资目标。
业绩比较基准	$75\% \times \text{上证红利指数} + 20\% \times \text{天相国债全价指数} + 5\% \times \text{银行活期存款利率}$ 。
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中高风险品种。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	兴业银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	伍文静	张志永
	联系电话	021-33074700-3105	021-62677777
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		400-820-2888, 021-53524620	95561
传真		021-63351152	021-62159217
注册地址		上海市延安东路 222 号外滩 中心 46 楼	福州市湖东路 154 号
办公地址		上海市延安东路 222 号外滩 中心 46 楼	上海市江宁路 168 号兴业大 厦 20 层
邮政编码		200002	200041
法定代表人		林昌	高建平

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、兴业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	-139,636,174.26
本期利润	106,522,504.56
加权平均基金份额本期利润	0.1023
本期加权平均净值利润率	4.92%
本期基金份额净值增长率	5.17%
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	-418,709,973.89

期末可供分配基金份额利润	-0.4032
期末基金资产净值	2,186,943,117.42
期末基金份额净值	2.1062
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	174.42%

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

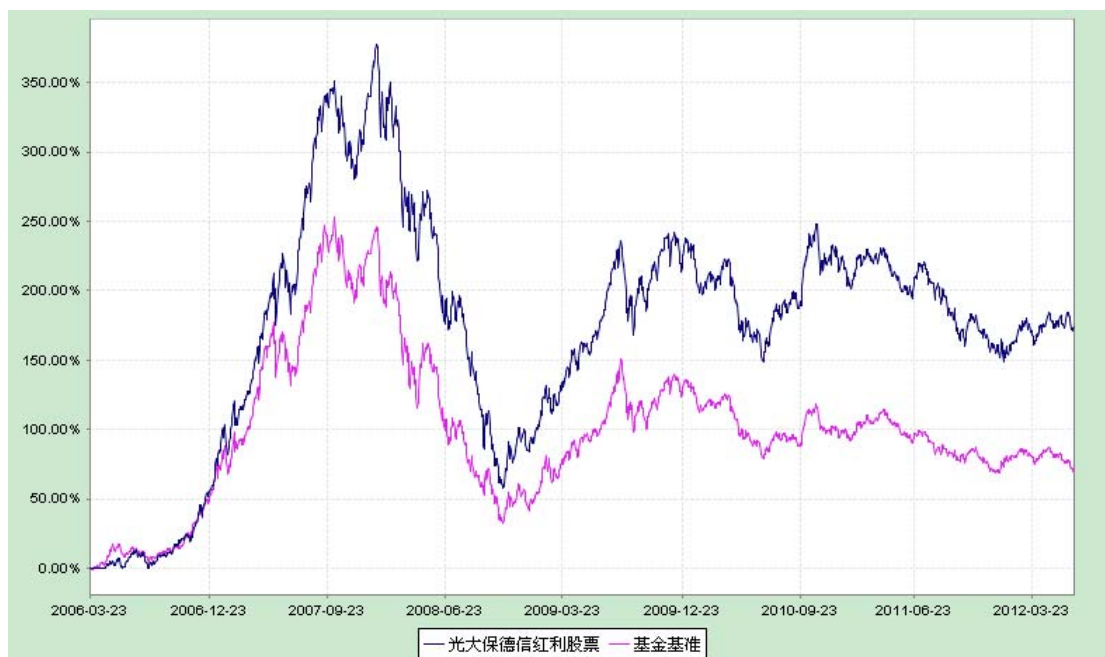
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.59%	1.01%	-5.25%	0.78%	2.66%	0.23%
过去三个月	4.13%	0.94%	-2.44%	0.77%	6.57%	0.17%
过去六个月	5.17%	1.12%	0.87%	0.87%	4.30%	0.25%
过去一年	-12.22%	1.13%	-12.25%	0.88%	0.03%	0.25%
过去三年	-4.00%	1.37%	-15.73%	1.13%	11.73%	0.24%
自基金合同生效起至今	174.42%	1.74%	72.23%	1.60%	102.19%	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

光大保德信红利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

(2006年3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 2006 年 3 月 24 日至 2006 年 9 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		
于进杰	基金经理	2010-12-31	-	9 年	于进杰先生，CFA，经济学硕士，毕业于上海财经大学金融学专业。2004 年 7 月至 2006 年 6 月任职于友邦华泰基金管理有限公司，任研究员；2006 年 6 月加入光大保德信基金管理有限公司，历任投资部研究员，高级研究员；2007 年 12 月至 2009 年 9 月兼任光大保德信红利股票型基金基金经理助理，2009 年 10 月起担任光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任光大保德信红利股票型证券投资基金基金经理兼光大保德信行业轮动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。2012 年 2 月 6 日，因当日证券市场波动，本基金的现金资产占基金资产净值的比例低于基金合同规定的 5% 的下限。本基金管理人发现后积极采取措施，于法定期限内将上述投资比例调整到规定范围之内。除此之外，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，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

一季度初，在经济持续下滑、政策紧缩力度可能超预期等担忧之下，市场惯性下行，一月上旬创出本轮调整新低，之后在各种利空得到充分释放的背景之下，投资者开始预期宏观政策放松并开始憧憬经济见底回升，市场展开反弹并延续至二月底。一季度市场的上涨既包含了对经济是否见底的犹豫，也没有摆脱对宏观政策的猜测和博弈，进入三月份市场即开始了横盘震荡，随后在两会对地产调控的坚定态度面前再度选择了调整。沪深 300 指数从去年四季度末的 2345 点最低下跌至 1 月 6 日的 2254 点，跌幅 3.9%，一季度沪深 300 指数小幅上涨 4.7%，其中有色、采掘等强周期行业及房地产、家电等早周期行业表现较好，信息服务、医药等行业表现较差。

本基金在一季度操作中，在资产配置层面保持了仓位的相对稳定；结合市场变化，在行业配置层面相对增加了早周期行业的配置；在个股选择上坚持综合评估企业的盈利水平、成长性和估值水平。

三月底，在政策重申预调微调、新增信贷超预期、基建陆续复工的刺激下市场再次反弹，但五月初以来市场在疲弱的经济数据和迟迟不见效果的政策面前，逐渐强化了经济中期内下台阶和降杠杆、去产能的认识，对经济及盈利增长的预期不断下调，市场调整至今。二季度沪深 300 指数小幅上涨 0.27%，但沪深 300 指数从季度内高点 2717.83 点最低下跌至 6 月 29 日的 2417.49 点，跌幅达 11.05%，其中医药、食品饮料等稳定增长的消费类行业和公用事

业等防御性行业表现较好，而强周期行业表现较差。

本基金在二季度操作中，在资产配置层面保持了仓位的相对稳定；结合市场变化，在行业配置层面相对增加了消费类行业的配置；在个股选择上坚持综合评估企业的盈利水平、成长性和估值水平。

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 5.17%，业绩比较基准收益率为 0.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入三季度，导致需求可能不达预期的主要风险在于地产投资，我们判断虽然销售有所好转，但在开发商现金流依然偏紧的情况下，从一线开发商开始拿地到行业新开工重新增长尚需时日，而且自去年调控以来地产商普遍拿地很少，这会使得地产投资持续下行，除非销售明显回暖改善预期，地产开发商才会加快拿地和新开工。从前期地方政府与中央政府的博弈来看，佛山、芜湖、上海的放松政策均被叫停，中央政府对于地产调控的态度依然坚决，但同时对于首套、刚需的支持力度也在加大，近期地产销量持续回暖除了季节效应之外也反映了降价和房地产抵押贷款放松、降息等对销售的支持作用。我们判断地产政策全年大概率是中央明紧、地方暗松，地产投资增速全年大概率是持续下行。

在消费基本稳定、出口难有惊喜、地产投资下行的背景下，基建投资或许是宏观经济的重要稳定器。我们判断中央对于宏观经济下行的容忍度在提高，政府不会像过去那样一味追逐快速增长，而要兼顾结构调整，同时还要进行资源价格改革，这一切都要求经济增速适度放缓，所以今年基建投资的本质是托底经济增长，而非拉高经济增速，是为“稳中求进”。一季度 GDP 增速快速回落至 8.1%，二季度继续下行至 7.6%，这使得政策进一步放松的必要性上升，2011 年停建、缓建的项目加快开工、“十二五”项目提前动工等举措一方面可以稳定经济增长，另一方面也能防止成为“烂尾”工程造成信贷坏帐，从而降低金融风险。从近期上调年度铁路投资计划和地方平台债大量发行来看，基建投资加速已在途中。

通胀在 7-8 月可能出现同比低点，下半年将大体维持相对低位。值得注意的是年末通货膨胀依然面临回升压力：一是国内劳动力成本的刚性上涨；二是在潜在经济增速下降背景下，可能的政策刺激在带来经济回升的同时也将带来通胀回升；三是国内的资源价格改革可能带来投入成本和终端价格的上升。综上，年中依然存在通胀回落低于预期的风险，那将使得政

策放松的空间收窄，对经济和市场构成压力。目前而言，我们判断货币政策将保持实际上的宽松，预期会通过继续下调存准率、降息以及放松商业银行贷存比限制等措施来鼓励信贷投放，从而带来以 M2 为表征的流动性的边际改善。

就外围环境而言，欧债危机并没有得到根本解决，未来依然存在变数，在相当长时间内，欧洲经济仍将处于低迷状态，对世界经济增长构成拖累。

总体而言，我们认为经济增速下降最快的阶段已经过去，在政策作用下，三季度经济基本面存在环比企稳的机会，流动性状况在边际上进一步改善，因此市场存在结构性的投资机会。当然，经济中的风险因素依然存在，例如终端需求较弱，企业库存偏高，盈利能力尚未见底等，在这些因素明朗之前，我们认为市场的持续上涨还将面临考验。另外，下半年也需要观察政策和制度风险：就政策而言，如果政府选择大幅放松，则通胀反弹和房价上涨的约束很快就会出现，届时政策的被迫收缩将再次成为经济和市场的下行压力；就制度而言，如果三季度发行制度改革导致供应量大增，可能带来估值中枢继续下移的风险。

行业配置方面，经济快速下行将催化政策调整，三季度应充分关注政策调整所带来的相关行业投资机会。经济增速的季度趋势在低点出现之后整体是向上的，我们将其定义为经济的短周期复苏，在此期间经济缓慢回升，通胀持续回落，加权贷款平均利率维持回落，三季度市场将可再次憧憬经济的短周期复苏，一些早周期性行业，如：房地产、汽车、金融服务等值得关注。同时应在供应增加、估值承压的背景下逐步增持在细分领域具有核心竞争力的优势成长股，中期内持续看好结构调整和消费升级所带来的消费类行业的成长机会。

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历，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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额

持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《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

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、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：光大保德信红利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	106,850,198.60	59,259,635.46
结算备付金		3,837,304.19	2,488,217.34
存出保证金		1,250,000.00	1,250,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	2,076,277,504.68	1,902,900,784.57
其中：股票投资		1,958,395,504.68	1,833,053,884.57
基金投资		-	-
债券投资		117,882,000.00	69,846,900.00
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	-	80,000,440.00

应收证券清算款		3,821,695.03	-
应收利息	6.4.7.5	1,900,625.40	702,220.84
应收股利		360.00	-
应收申购款		166,320.32	101,671.11
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,194,104,008.22	2,046,702,969.32
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		723,706.63	-
应付赎回款		602,843.84	460,100.92
应付管理人报酬		2,730,364.82	2,633,472.93
应付托管费		455,060.82	438,912.16
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,199,873.29	931,083.56
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	1,449,041.40	1,650,201.59
负债合计		7,160,890.80	6,113,771.16
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	1,038,338,836.65	1,018,927,325.83
未分配利润	6.4.7.10	1,148,604,280.77	1,021,661,872.33
所有者权益合计		2,186,943,117.42	2,040,589,198.16
负债和所有者权益总计		2,194,104,008.22	2,046,702,969.32

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.1062，基金份额总额 1,038,338,836.65 份。

6.2 利润表

会计主体：光大保德信红利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	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
一、收入		130,374,431.39	-34,469,400.84
1.利息收入		4,301,492.74	4,570,212.82
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,503,480.28	1,742,528.71
债券利息收入		1,539,912.09	1,264.10
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,258,100.37	2,826,420.01
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-120,159,742.86	120,518,724.90
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-137,488,222.59	104,657,667.88
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,219,407.57	707,688.60
资产支持证券投资收 益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.14	16,109,072.16	15,153,368.42
3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	6.4.7.15	246,158,678.82	-159,604,092.53
4.汇兑收益（损失以“-”号 填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填 列）	6.4.7.16	74,002.69	45,753.97
减：二、费用		23,851,926.83	29,850,686.88
1. 管理人报酬		16,106,909.56	18,816,726.77
2. 托管费		2,684,484.99	3,136,121.06
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.17	4,822,537.36	7,684,721.95
5. 利息支出		20,432.41	-
其中：卖出回购金融资产支出		20,432.41	-
6. 其他费用	6.4.7.18	217,562.51	213,117.10
三、利润总额（亏损总额以“-” 号填列）		106,522,504.56	-64,320,087.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		106,522,504.56	-64,320,087.72

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：光大保德信红利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）	1,018,927,325.83	1,021,661,872.33	2,040,589,198.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	106,522,504.56	106,522,504.56
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）	19,411,510.82	20,419,903.88	39,831,414.70
其中：1. 基金申购款	71,090,110.12	77,084,240.44	148,174,350.56
2. 基金赎回款	-51,678,599.30	-56,664,336.56	-108,342,935.86
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）	1,038,338,836.65	1,148,604,280.77	2,186,943,117.42
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）	1,085,570,055.08	1,589,585,751.13	2,675,155,806.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-64,320,087.72	-64,320,087.72
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）	-50,856,022.09	-77,336,069.13	-128,192,091.22
其中：1. 基金申购款	53,040,408.01	73,640,448.63	126,680,856.64
2. 基金赎回款	-103,896,430.10	-150,976,517.76	-254,872,947.86
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）	1,034,714,032.99	1,447,929,594.28	2,482,643,627.27

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

光大保德信红利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[2005]206号文《关于同意光大保德信红利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募集，基金合同于2006年3月24日生效，首次设立募集规模为532,471,074.61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和注册登记人为光大保德信基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金为股票型基金，通过对高分红类股票及其他具有投资价值的股票投资进行投资，为基金资产获取稳定的当期收益和长期增值。本基金股票资产占基金净资产不少于60%，最高可达基金净资产90%，其余资产除应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在1年以内的政府债券外，还可投资于中国证监会认可的其他金融工具，包括债券、可转债、央行票据、回购、权证等。本基金的业绩比较基准为： $75\% \times \text{上证红利指数} + 20\% \times \text{天相国债全价指数} + 5\% \times \text{银行活期存款利率}$ 。

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 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年上半年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、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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	106,850,198.60
定期存款	-
其他存款	-
合计	106,850,198.60

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		1,999,330,197.91	1,958,395,504.68	-40,934,693.23
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	118,011,560.00	117,882,000.00	-129,560.00
	合计	118,011,560.00	117,882,000.00	-129,560.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,117,341,757.91	2,076,277,504.68	-41,064,253.23

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

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	52,203.01
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	1,554.12
应收债券利息	1,846,867.09
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	1.18
其他	-
合计	1,900,625.40

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

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	1,198,878.39
银行间市场应付交易费用	994.90
合计	1,199,873.29

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	1,250,000.00
应付赎回费	137.24
应付后端申购费	-
债券利息税	-
预提费用	198,904.16
银行手续费	-
合计	1,449,041.40

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	1,018,927,325.83	1,018,927,325.83
本期申购	71,090,110.12	71,090,110.12
本期赎回 (以“-”号填列)	-51,678,599.30	-51,678,599.30
本期末	1,038,338,836.65	1,038,338,836.65

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	-273,307,253.84	1,294,969,126.17	1,021,661,872.33
本期利润	-139,636,174.26	246,158,678.82	106,522,504.56
本期基金份额交易产生的变动数	-5,766,545.79	26,186,449.67	20,419,903.88
其中：基金申购款	-24,765,178.45	101,849,418.89	77,084,240.44
基金赎回款	18,998,632.66	-75,662,969.22	-56,664,336.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-418,709,973.89	1,567,314,254.66	1,148,604,280.77

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	1,477,076.70
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	20,401.29
其他	6,002.29
合计	1,503,480.28

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	1,573,518,881.76
减：卖出股票成本总额	1,711,007,104.35
买卖股票差价收入	-137,488,222.59

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	41,306,416.89
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	39,539,150.74
减：应收利息总额	547,858.58
债券投资收益	1,219,407.57

6.4.7.14 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	16,109,072.16
基金投资产生的股利收益	-
合计	16,109,072.16

6.4.7.15 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	246,158,678.82
——股票投资	246,557,617.59
——债券投资	-398,938.77
——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	246,158,678.82

6.4.7.16 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	35,937.24
印花税返还	36,390.61
转换费收入	1,674.84
合计	74,002.69

6.4.7.17 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	4,821,362.36
银行间市场交易费用	1,175.00
合计	4,822,537.36

6.4.7.18 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	49,726.04	
信息披露费	149,178.12	
账户维护费	12,000.00	
其他费用	6,658.35	
合计	217,562.51	

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(简称“光大保德信”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司(简称“兴业银行”)	基金托管人、基金代销机构
光大证券股份有限公司(简称“光大证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构

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		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	
	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	278,035,396.65	8.79%	898,692,979.95	17.26%

6.4.10.1.2 权证交易

本报告期和上年度可比期间均未与关联方进行权证交易。

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	15,705,582.00	76.27%	-	-

6.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期和上年度可比期间均未与关联方进行债券回购交易。

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	237,064.93	8.93%	67,118.83	5.60%
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	763,887.59	17.58%	244,684.14	18.84%

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	16,106,909.56	18,816,726.77
其中：支付销售机构的客户维护费	2,626,577.37	3,284,051.58

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 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，由基金管理人向基金托管人

发送基金管理费划付指令，由基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内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。

6.4.10.2.2 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	2,684,484.99	3,136,121.06

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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，由基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内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

本基金本报告期和 2011 年上半年度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
兴业银行	106,850,198.60	1,477,076.70	210,253,089.01	1,706,835.38

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在承销期内未参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金在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

本基金本期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金本报告期末未投资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

本基金本报告期末未投资交易所市场债券正回购。

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

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	106,850,198.60	-	-	-	-	-	106,850,198.60
结算备付 金	3,837,304.19	-	-	-	-	-	3,837,304.19
存出保证 金	-	-	-	-	-	1,250,000.00	1,250,000.00
交易性金 融资产	2,008,405,504.68	-	67,872,000.00	-	-	-	2,076,277,504.68
买入返售 金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	1,900,625.40	1,900,625.40
应收申购	497.02	-	-	-	-	165,823.30	166,320.32

款							
应收股利	-	-	-	-	-	360.00	360.00
应收证券 清算款	-	-	-	-	-	3,821,695.03	3,821,695.03
资产总计	2,119,093,504.49	-	67,872,000.00	-	-	7,138,503.73	2,194,104,008.22
负债							
应收证券 清算款	-	-	-	-	-	723,706.63	723,706.63
应付赎回 款	-	-	-	-	-	602,843.84	602,843.84
应付管理 人报酬	-	-	-	-	-	2,730,364.82	2,730,364.82
应付托管 费	-	-	-	-	-	455,060.82	455,060.82
应付交易 费用	-	-	-	-	-	1,199,873.29	1,199,873.29
其他负债	-	-	-	-	-	1,449,041.40	1,449,041.40
负债总计	-	-	-	-	-	7,160,890.80	7,160,890.80
利率敏感 度缺口	2,119,093,504.49	-	67,872,000.00	-	-	-22,387.07	2,186,943,117.42
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	59,259,635.46	-	-	-	-	-	59,259,635.46
结算备付 金	2,488,217.34	-	-	-	-	-	2,488,217.34
存出保证 金	-	-	-	-	-	1,250,000.00	1,250,000.00
交易性金 融资产	50,155,000.00	9,045,900.00	10,646,000.00	-	-	1,833,053,884.57	1,902,900,784.57
买入返售 金融资产	80,000,440.00	-	-	-	-	-	80,000,440.00

应收利息	-	-	-	-	-	702,220.84	702,220.84
应收申购款	-	-	-	-	-	101,671.11	101,671.11
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	191,903,292.80	9,045,900.00	10,646,000.00	-	-	1,835,107,776.52	2,046,702,969.32
负债							
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	460,100.92	460,100.92
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,633,472.93	2,633,472.93
应付托管费	-	-	-	-	-	438,912.16	438,912.16
应付交易费用	-	-	-	-	-	931,083.56	931,083.56
其他负债	-	-	-	-	-	1,650,201.59	1,650,201.59
负债总计	-	-	-	-	-	6,113,771.16	6,113,771.16
利率敏感度缺口	191,903,292.80	9,045,900.00	10,646,000.00	-	-	1,828,994,005.36	2,040,589,198.16

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30.76万元	减少约120.04万元
	基准利率下降1%	增加约30.76万元	增加约120.04万元

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

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	1,958,395,504.68	89.55	1,833,053,884.57	89.83
交易性金融资产-债券投资	117,882,000.00	5.39	69,846,900.00	3.42
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,076,277,504.68	94.94	1,902,900,784.57	93.25

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2,506.03万元	增加约2,243.30万元
	业绩基准净值减少1%	减少约2,506.03万元	减少约2,243.30万元

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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

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	1,958,395,504.68	89.26
	其中：股票	1,958,395,504.68	89.26
2	固定收益投资	117,882,000.00	5.37
	其中：债券	117,882,000.00	5.37
	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	110,687,502.79	5.04
6	其他各项资产	7,139,000.75	0.33
7	合计	2,194,104,008.22	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	30,856,394.55	1.41
B	采掘业	29,506,851.40	1.35
C	制造业	781,150,560.28	35.72
C0	食品、饮料	199,667,535.32	9.13
C1	纺织、服装、皮毛	62,408.00	0.00
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	352,550.00	0.02
C4	石油、化学、塑胶、塑料	6,230,361.84	0.28
C5	电子	1,070,186.00	0.05
C6	金属、非金属	89,710,642.96	4.10
C7	机械、设备、仪表	353,442,795.85	16.16
C8	医药、生物制品	130,614,080.31	5.97
C99	其他制造业	-	-

D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	19,426,485.89	0.89
G	信息技术业	140,147,397.55	6.41
H	批发和零售贸易	125,144,775.06	5.72
I	金融、保险业	374,737,212.58	17.14
J	房地产业	401,150,041.19	18.34
K	社会服务业	45,723,456.18	2.09
L	传播与文化产业	10,552,330.00	0.48
M	综合类	-	-
	合计	1,958,395,504.68	89.55

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	600383	金地集团	20,518,109	132,957,346.32	6.08
2	000002	万科A	13,649,969	121,621,223.79	5.56
3	601318	中国平安	2,558,023	117,003,972.02	5.35
4	600690	青岛海尔	8,700,000	101,964,000.00	4.66
5	600519	贵州茅台	410,821	98,247,842.15	4.49
6	000651	格力电器	4,353,412	90,768,640.20	4.15
7	600585	海螺水泥	6,042,428	89,548,782.96	4.09
8	000895	双汇发展	1,403,333	86,838,246.04	3.97
9	601601	中国太保	3,883,221	86,129,841.78	3.94
10	600030	中信证券	4,899,328	61,878,512.64	2.83
11	000581	威孚高科	1,806,502	49,498,154.80	2.26
12	600325	华发股份	5,494,689	46,814,750.28	2.14
13	600588	用友软件	2,993,447	45,680,001.22	2.09
14	300168	万达信息	1,880,000	45,101,200.00	2.06
15	600079	人福医药	1,892,219	43,880,558.61	2.01
16	600016	民生银行	7,300,000	43,727,000.00	2.00
17	000616	亿城股份	11,330,316	41,468,956.56	1.90
18	600837	海通证券	4,160,928	40,069,736.64	1.83
19	000338	潍柴动力	1,209,053	35,896,783.57	1.64
20	600697	欧亚集团	1,450,000	33,161,500.00	1.52
21	601877	正泰电器	2,102,815	32,088,956.90	1.47
22	002069	獐子岛	1,479,923	30,856,394.55	1.41
23	000069	华侨城A	4,548,552	29,019,761.76	1.33

24	000963	华东医药	929,675	28,076,185.00	1.28
25	000926	福星股份	2,224,524	20,777,054.16	0.95
26	601006	大秦铁路	2,762,163	19,418,005.89	0.89
27	300119	瑞普生物	1,178,815	19,332,566.00	0.88
28	600104	上汽集团	1,340,000	19,148,600.00	0.88
29	600518	康美药业	1,224,339	18,879,307.38	0.86
30	600048	保利地产	1,659,612	18,820,000.08	0.86
31	600376	首开股份	1,411,000	18,681,640.00	0.85
32	600570	恒生电子	1,344,386	18,444,975.92	0.84
33	601088	中国神华	720,000	16,185,600.00	0.74
34	600594	益佰制药	786,160	15,565,968.00	0.71
35	002024	苏宁电器	1,850,000	15,521,500.00	0.71
36	600406	国电南瑞	785,011	14,671,855.59	0.67
37	600267	海正药业	800,355	13,990,205.40	0.64
38	601688	华泰证券	1,307,919	13,733,149.50	0.63
39	601699	潞安环能	600,000	12,444,000.00	0.57
40	600000	浦发银行	1,500,000	12,195,000.00	0.56
41	000538	云南白药	190,251	11,278,079.28	0.52
42	300027	华谊兄弟	665,000	10,526,950.00	0.48
43	002385	大北农	530,000	10,282,000.00	0.47
44	000028	国药一致	330,000	9,827,400.00	0.45
45	000430	张家界	1,032,427	9,766,759.42	0.45
46	002277	友阿股份	623,722	9,736,300.42	0.45
47	600859	王府井	346,259	9,473,646.24	0.43
48	601369	陕鼓动力	1,020,183	9,446,894.58	0.43
49	300010	立思辰	819,933	6,936,633.18	0.32
50	300020	银江股份	676,744	6,767,440.00	0.31
51	002422	科伦药业	129,574	6,045,922.84	0.28
52	002503	搜于特	258,593	5,895,920.40	0.27
53	600309	烟台万华	438,188	5,849,809.80	0.27
54	300257	开山股份	180,000	5,130,000.00	0.23
55	600729	重庆百货	180,000	5,079,600.00	0.23
56	300124	汇川技术	212,636	4,848,100.80	0.22
57	300012	华测检测	205,000	4,393,150.00	0.20
58	000858	五粮液	100,000	3,276,000.00	0.15
59	600827	友谊股份	280,000	3,166,800.00	0.14
60	600858	银座股份	198,000	2,332,440.00	0.11
61	300074	华平股份	100,000	1,930,000.00	0.09
62	000625	长安汽车	300,000	1,464,000.00	0.07
63	002430	杭氧股份	120,000	1,450,800.00	0.07
64	600329	中新药业	110,000	1,362,900.00	0.06

65	002400	省广股份	61,100	1,170,065.00	0.05
66	601010	文峰股份	60,000	892,200.00	0.04
67	600298	安琪酵母	35,533	874,467.13	0.04
68	000826	桑德环境	36,000	824,400.00	0.04
69	002415	海康威视	30,000	816,000.00	0.04
70	002251	步步高	20,000	488,000.00	0.02
71	002262	恩华药业	20,000	465,800.00	0.02
72	600546	山煤国际	20,295	424,571.40	0.02
73	300015	爱尔眼科	16,000	335,520.00	0.02
74	600694	大商股份	10,000	334,500.00	0.02
75	002249	大洋电机	30,000	279,000.00	0.01
76	002153	石基信息	10,000	256,500.00	0.01
77	000417	合肥百货	20,000	251,000.00	0.01
78	002152	广电运通	14,000	231,000.00	0.01
79	300123	太阳鸟	16,000	228,000.00	0.01
80	300005	探路者	13,000	227,760.00	0.01
81	300056	三维丝	18,000	223,200.00	0.01
82	000888	峨眉山 A	10,000	213,800.00	0.01
83	600188	兖州煤业	10,000	189,800.00	0.01
84	002522	浙江众成	10,294	181,792.04	0.01
85	600261	阳光照明	15,000	178,500.00	0.01
86	002303	美盈森	10,000	177,100.00	0.01
87	300043	星辉车模	10,000	170,300.00	0.01
88	002683	宏大爆破	10,000	162,600.00	0.01
89	002563	森马服饰	5,900	155,583.00	0.01
90	002111	威海广泰	18,000	153,000.00	0.01
91	600521	华海药业	10,000	151,100.00	0.01
92	002405	四维图新	12,606	150,515.64	0.01
93	600176	中国玻纤	15,000	147,450.00	0.01
94	002254	泰和新材	10,000	112,900.00	0.01
95	000527	美的电器	10,000	110,500.00	0.01
96	002232	启明信息	14,000	103,880.00	0.00
97	300154	瑞凌股份	10,000	100,900.00	0.00
98	000933	神火股份	10,000	91,200.00	0.00
99	600268	国电南自	10,000	89,300.00	0.00
100	002334	英威腾	5,000	78,400.00	0.00
101	600809	山西汾酒	2,000	75,380.00	0.00
102	002073	软控股份	8,000	67,040.00	0.00
103	600596	新安股份	10,000	61,900.00	0.00
104	002327	富安娜	1,200	54,588.00	0.00
105	002475	立讯精密	1,400	41,370.00	0.00

106	000423	东阿阿胶	1,000	40,010.00	0.00
107	600600	青岛啤酒	1,000	38,190.00	0.00
108	002236	大华股份	1,000	30,700.00	0.00
109	002230	科大讯飞	1,500	29,550.00	0.00
110	601933	永辉超市	1,000	27,100.00	0.00
111	300229	拓尔思	1,870	25,806.00	0.00
112	300133	华策影视	2,000	25,380.00	0.00
113	002007	华兰生物	1,000	24,580.00	0.00
114	002559	亚威股份	1,000	23,930.00	0.00
115	002281	光迅科技	1,000	22,400.00	0.00
116	600742	一汽富维	1,000	19,550.00	0.00
117	002223	鱼跃医疗	1,300	19,305.00	0.00
118	600062	华润双鹤	1,000	19,080.00	0.00
119	002273	水晶光电	1,000	18,690.00	0.00
120	600785	新华百货	1,000	18,320.00	0.00
121	002311	海大集团	1,000	17,860.00	0.00
122	000848	承德露露	1,000	17,550.00	0.00
123	000989	九芝堂	1,000	16,200.00	0.00
124	002014	永新股份	1,000	15,470.00	0.00
125	002436	兴森科技	1,000	15,110.00	0.00
126	600557	康缘药业	1,000	14,780.00	0.00
127	000063	中兴通讯	1,000	13,960.00	0.00
128	000823	超声电子	1,000	13,950.00	0.00
129	000988	华工科技	1,000	13,770.00	0.00
130	002419	天虹商场	1,000	13,220.00	0.00
131	300003	乐普医疗	1,000	13,210.00	0.00
132	002129	中环股份	1,000	12,850.00	0.00
133	002369	卓翼科技	1,000	12,680.00	0.00
134	002126	银轮股份	2,000	12,560.00	0.00
135	600479	千金药业	1,000	11,900.00	0.00
136	002123	荣信股份	1,000	11,370.00	0.00
137	600157	永泰能源	1,000	9,080.00	0.00
138	002244	滨江集团	1,000	9,070.00	0.00
139	000887	中鼎股份	1,000	8,490.00	0.00
140	600125	铁龙物流	1,000	8,480.00	0.00
141	002486	嘉麟杰	1,000	7,820.00	0.00
142	600660	福耀玻璃	1,000	7,820.00	0.00
143	002138	顺络电子	600	6,846.00	0.00
144	600581	八一钢铁	1,000	6,590.00	0.00
145	002228	合兴包装	1,000	5,150.00	0.00
146	002030	达安基因	120	922.80	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	601318	中国平安	105,739,356.00	5.18
2	600585	海螺水泥	96,275,865.20	4.72
3	600383	金地集团	77,708,273.20	3.81
4	601601	中国太保	65,073,990.78	3.19
5	600030	中信证券	64,187,881.32	3.15
6	601328	交通银行	61,163,020.69	3.00
7	600519	贵州茅台	56,409,015.37	2.76
8	000858	五粮液	56,317,039.73	2.76
9	000651	格力电器	53,410,545.87	2.62
10	600325	华发股份	50,103,263.80	2.46
11	000581	威孚高科	45,875,403.78	2.25
12	000338	潍柴动力	42,661,189.47	2.09
13	600104	上汽集团	41,801,676.94	2.05
14	600837	海通证券	41,469,030.90	2.03
15	000616	亿城股份	41,403,537.07	2.03
16	600079	人福医药	39,007,659.65	1.91
17	600188	兖州煤业	31,977,196.62	1.57
18	002069	獐子岛	31,975,465.09	1.57
19	000895	双汇发展	29,932,819.64	1.47
20	000002	万科A	29,605,881.00	1.45

7.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	148,631,459.61	7.28
2	600000	浦发银行	106,110,165.34	5.20
3	000063	中兴通讯	70,692,299.53	3.46
4	600015	华夏银行	68,338,177.87	3.35
5	601328	交通银行	61,043,158.70	2.99
6	600742	一汽富维	57,232,587.26	2.80
7	000858	五粮液	54,601,593.47	2.68
8	601088	中国神华	46,382,932.47	2.27
9	000002	万科A	45,960,501.11	2.25

10	000401	冀东水泥	43,567,396.39	2.14
11	002096	南岭民爆	36,077,752.52	1.77
12	600157	永泰能源	34,379,501.56	1.68
13	600585	海螺水泥	32,892,269.17	1.61
14	600188	兖州煤业	30,224,010.95	1.48
15	000895	双汇发展	28,622,017.93	1.40
16	601009	南京银行	28,384,253.04	1.39
17	600048	保利地产	26,654,724.43	1.31
18	002415	海康威视	25,656,030.72	1.26
19	000568	泸州老窖	25,139,862.77	1.23
20	600104	上汽集团	24,322,870.01	1.19

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	1,589,791,106.87
卖出股票的收入（成交）总额	1,573,518,881.76

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	67,872,000.00	3.10
3	金融债券	50,010,000.00	2.29
	其中：政策性金融债	50,010,000.00	2.29
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	117,882,000.00	5.39

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	1101094	11 央行票据 94	700,000	67,872,000.00	3.10
2	110239	11 国开 39	500,000	50,010,000.00	2.29

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

本报告期末本基金未投资资产支持证券。

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

本报告期末本基金未投资权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 本基金本报告期内投资的前十名证券发行主体本期没有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。

7.9.2 本报告期内本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	1,250,000.00
2	应收证券清算款	3,821,695.03
3	应收股利	360.00
4	应收利息	1,900,625.40
5	应收申购款	166,320.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,139,000.75

7.9.4 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。

7.9.5 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不存在流通受限的情况。

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
87,009	11,933.69	117,769,940.18	11.34%	920,568,896.47	88.66%

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	559,632.19	0.05%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金的份额总量的数量区间为 10 万份至 50 万份（含）；本基金的基金经理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(2006年3月24日)基金份额总额	532,471,074.61
本报告期期初基金份额总额	1,018,927,325.83
本报告期基金总申购份额	71,090,110.12
减：本报告期基金总赎回份额	51,678,599.30
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,038,338,836.65

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,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

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金未有改聘为其审计的会计师事务所的情况。

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，本基金的基金管理人和基金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	
申银万国证券股份有限公司	1	806,595,187.61	25.51%	689,226.95	25.97%	-
东方证券股份有限公司	1	722,290,416.75	22.84%	586,888.23	22.11%	-
中信建投证券有限责任公司	1	489,190,120.75	15.47%	417,310.73	15.72%	-
华创证券有限责任公司	2	350,795,590.88	11.09%	291,363.44	10.98%	-
光大证券股份有限公司	1	278,035,396.65	8.79%	237,064.93	8.93%	-

国信证券有 限责任公司	1	257,773,426.22	8.15%	219,106.54	8.26%	-
中银国际证 券有限责任 公司	1	194,039,374.47	6.14%	159,722.55	6.02%	-
国元证券股 份有限公司	1	37,634,203.94	1.19%	31,989.23	1.21%	-
平安证券有 限责任公司	1	14,084,761.99	0.45%	11,443.84	0.43%	-
西部证券股 份有限公司	1	11,987,923.81	0.38%	9,740.26	0.37%	-
齐鲁证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-

注：（1）报告期内租用证券公司交易单元变更情况

报告期内本基金未新增租用交易单元。

报告期内本基金未撤销租用交易单元。

（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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申银万国证券股份有限公司	3,226,801.50	15.67%	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券有限责任公司	-	-	60,000,000.00	100.00%	-	-
华创证券有限责任公司	1,658,790.00	8.06%	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	15,705,582.00	76.27%	-	-	-	-
国信证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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
6	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
7	关于旗下部分基金参与中国光大银行股份有限公司电子渠道定投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》	2012-05-07
8	光大保德信红利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》	2012-05-07
9	光大保德信红利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》	2012-05-07
10	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
11	光大保德信红利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》、	2012-04-21

		《证券时报》	
12	关于旗下光大保德信红利股票型证券投资基金2011年年度报告的更正公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012-03-31
13	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
14	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
15	光大保德信红利股票型证券投资基金2011年年度报告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012-03-29
16	光大保德信红利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
17	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
18	关于在中国银行股份有限公司开通旗下部分基金定期定额申购业务、网上银行申购业务以及相关费率优惠的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012-03-15
19	光大保德信红利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红利股票型证券投资基金设立的文件
- 2、 光大保德信红利股票型证券投资基金基金合同
- 3、 光大保德信红利股票型证券投资基金招募说明书
- 4、 光大保德信红利股票型证券投资基金托管协议
- 5、 光大保德信红利股票型证券投资基金法律意见书
- 6、 光大保德信红利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，光大保德信基金管理有限公司客服电话：4008-202-888

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