

光大保德信优势配置股票型证券投资基金

2009 年半年度报告正文

2009 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：二〇〇九年八月二十八日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

本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。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。

本基金的托管人——招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2009 年 8 月 27 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。

本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。

本报告期间为 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日。本报告财务资料未经审计。

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.....	9
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.....	31
7.1	期末基金资产组合情况.....	31
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	31
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.....	32
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	34
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.....	36
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.....	36
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.....	36

7.9	投资组合报告附注.....	36
8	基金份额持有人信息.....	37
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	37
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	37
9	开放式基金份额变动.....	38
10	重大事件揭示.....	38
10.1	基金份额持有人大会决议.....	38
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.....	38
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	38
10.4	基金投资策略的改变.....	38
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况.....	38
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况.....	38
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.....	40
11	备查文件目录.....	42
11.1	备查文件目录.....	42
11.2	存放地点.....	42
11.3	查阅方式.....	42

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
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
报告期末基金份额总额	18,011,186,361.15份

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

		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	jiangran@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	秦晓

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

2.5 其他相关资料

项目	注册登记机构
名称	光大保德信基金管理有限公司
办公地址	上海市延安东路 222 号外滩中心 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（2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-1,978,784,462.24
本期利润	4,695,709,974.28
加权平均基金份额本期利润	0.2544
本期加权平均净值利润率	42.63%
本期基金份额净值增长率	54.28%
3.1.2 期末数据和指标	本期末（2009 年 6 月 30 日）

期末可供分配利润	-5,736,941,418.85
期末可供分配基金份额利润	-0.3185
期末基金资产净值	13,019,168,450.51
期末基金份额净值	0.7228
3.1.3 累计期末指标	报告期（基金合同生效日-2009年6月30日）
基金份额累计净值增长率	-27.72%

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

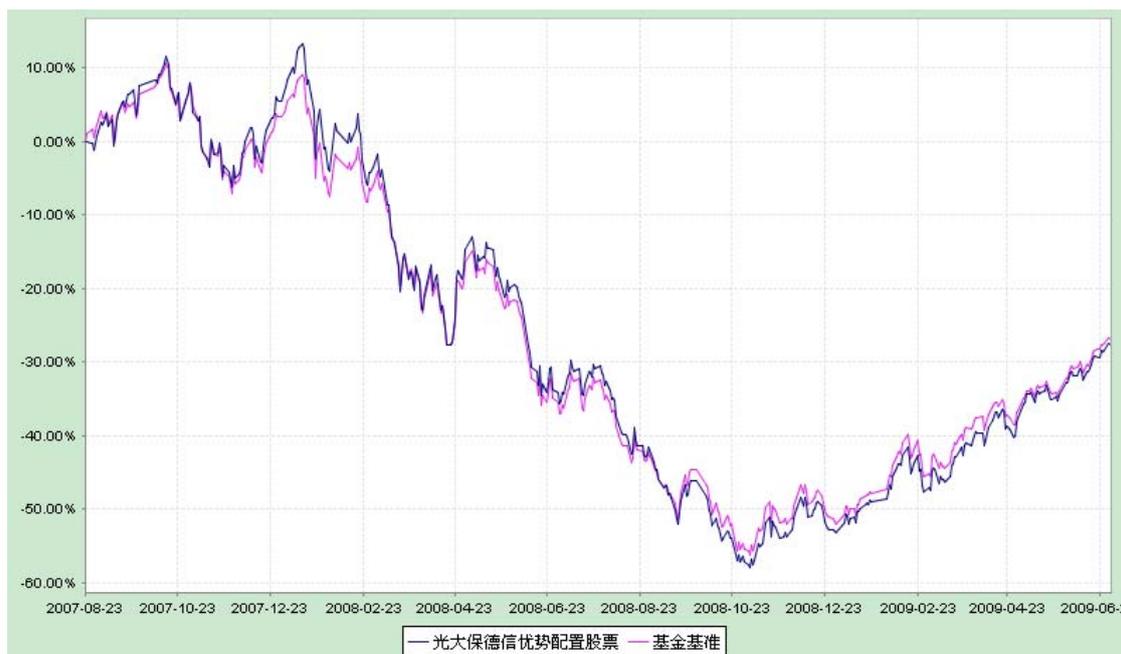
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	10.23%	0.96%	10.88%	0.91%	-0.65%	0.05%
过去三个月	21.70%	1.31%	19.38%	1.17%	2.32%	0.14%
过去六个月	54.28%	1.57%	52.38%	1.47%	1.90%	0.10%
过去一年	9.58%	1.95%	13.24%	1.93%	-3.66%	0.02%
自基金合同生效起至今	-27.72%	2.06%	-26.83%	1.96%	-0.89%	0.10%

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2009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 67%和 33%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 2006 年 6 月 30 日，光大保德信旗下管理着七只开放式基金，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和光大保德信增利收益债券型证券投资基金和光大保德信均衡精选股票型证券投资基金。

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期限	证券从业	说明
----	----	-------------	------	----

		任职日期	离任日期	年限	
高宏华	基金经理	2007-8-24	-	16 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 月在上海成久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 8 月至 2007 年 8 月任本公司投资部高级研究员，现任本基金基金经理。

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 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

截至 2009 年 6 月 30 日，本基金管理人旗下共有五只股票型基金，分别为光大保德信量

化核心证券投资基金（以下简称“光大量化核心基金”）、光大保德信红利股票型证券投资基金（以下简称“光大红利基金”）、光大保德信新增长股票型证券投资基金（以下简称“光大新增长基金”）、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”）、光大保德信均衡精选股票型证券投资基金（以下简称“光大均衡精选基金”）。光大量化核心基金采用数量化投资方法进行管理，对于具体投资对象特征没有规定；光大红利基金主要投资于高分红类股票，高分红类股票为实际或预期现金股息率（税后）大于当期活期存款利率（税后）的股票；光大新增长基金主要投资于符合新增长模式且具有长期发展潜力的上市公司，并强调公司发展的可持续性；本基金主要投资于国家重点支柱行业中按总市值排名前三分之一的大盘绩优股；光大均衡精选基金为策略驱动型基金，淡化股票投资风格，强化策略投资，主要投资于具备优良成长前景且估值水平相对合理或被低估的上市公司。本基金管理人认为，该五只基金虽然均为股票型基金，但是投资风格并不相似，因此其业绩并不具有可比性。

4.3.3 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。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

对于本次市场的回暖，我们认为其主要驱动因素是流动复苏、政策刺激和估值修复。回顾市场从去年 11 月，中央推出 4 万亿的经济刺激计划，极大的鼓舞了市场信心，大盘伴随着经济处于寻底阶段；进入今年一月，随着宽松货币政策及财政政策继续推出十大产业振兴规划，市场在充足流动性推动下逐级走高。虽然其中也有对于信贷和经济复苏程度的担心，市场走势出现犹豫，但随着经济数据环比不断向好的预期下，市场持续攀升。至 2009 年 A 股成为全球表现最抢眼的市场，上证综指累计涨幅达 62.53%；深成指今年以来的涨幅更是高达 78.35%，A 股市场远远跑赢了全球其他市场。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

就 2009 年下半年来看，流动性的基础仍然存在，政策推动和经济自我修复进程将可能进一步兑现，预期企业盈利将出现明显回暖。而作为全球经济的风向标的美国经济，其近期的各项如采购经理指数、消费者信心等先行指标已连续数月出现企稳迹象，虽然全球经济仍在下滑中，但趋势有所减缓。在此背景下，市场推动力将可能会出现转化，即由流动性复苏、

政策刺激和估值修复驱动行情转向基本面推动。

现阶段面临最大的问题就是经过连续二个季度大幅上涨后，市场短期自身有阶段性调整需求。投资者对经济复苏预期的过渡乐观、微观企业盈利能否跟上 A 股市场上涨步伐、政府对资产价格过快上涨的关注、大盘股的迅速发行对市场资金面的压力均构成市场的短期不确定因素。中报和三季度期间企业盈利数据的出台均会使投资者对经济复苏引致微观企业盈利有新的认识，从而影响投资者对大类资产配置思路的改变。

市场的主要矛盾在于回升的幅度和速度能否达到投资者预期，也就是说估值是不是需要阶段性休整以等待基本面的验证。A 股虽已处于泡沫边缘，从静态企业盈利情况来看，并不支持目前的估值，未来无非通过估值调整或者盈利预测上调来化解压力。由于目前流动性泛滥（不仅国内，还有很多前期聚集在美圆资产的避险资金进入新兴市场），估值大幅调整的可能性较小。未来盈利预测上调的可能性较大，从历史来看，企业盈利中泡沫的成分也可以很大。目前的市场可能只是刚刚进入估值的泡沫，还未进入盈利的泡沫阶段。

在资产配置方面我将保持谨慎乐观的仓位配置，并着眼用 2010 年业绩自下而上选择盈利预见性较高、估值还算合理的公司作为长期持有，同时关注货币过多下的资产价格泡沫的投资主题。

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、审计师和行业的意见，并必须获得估值委员会半数以上成员同意。

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、行业、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；投资部数量小组负责审核估值政策调整对投资业绩、投资决策、投资绩效和风险评估的影响；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：2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2009 年 6 月 30 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,476,090,478.95	1,347,531,055.06
结算备付金		3,738,363.99	10,879,653.05
存出保证金		2,333,979.62	760,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	11,313,572,499.04	7,133,538,563.51
其中：股票投资		11,293,522,499.04	6,569,346,563.51
债券投资		20,050,000.00	564,192,000.00
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	-	317,000,475.50
应收证券清算款		325,833,174.96	27,882.92
应收利息	6.4.7.5	374,738.88	13,632,176.53

应收股利		1,450,933.48	-
应收申购款		825,703.98	297,544.20
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		13,124,219,872.90	8,823,667,350.77
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009 年 6 月 30 日	上年度末 2008 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		67,814,240.62	-
应付赎回款		14,289,808.94	2,038,902.16
应付管理人报酬		15,507,815.34	11,744,793.31
应付托管费		2,584,635.88	1,957,465.52
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,131,815.52	3,292,502.00
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	723,106.09	1,193,665.17
负债合计		105,051,422.39	20,227,328.16
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	18,011,186,361.15	18,789,195,415.79
未分配利润	6.4.7.10	-4,992,017,910.64	-9,985,755,393.18
所有者权益合计		13,019,168,450.51	8,803,440,022.61
负债和所有者权益总计		13,124,219,872.90	8,823,667,350.77

注：报告截止日 2009 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.7228 元，基金份额总额 18,011,186,361.15 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：2009 年 1 月 1 日 - 2009 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
		2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日	2008 年 1 月 1 日 - 2008 年 6 月 30 日

一、收入		4,810,827,426.22	-7,600,503,555.33
1.利息收入		16,219,534.93	13,026,210.45
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,240,647.89	11,875,889.30
债券利息收入		9,502,709.54	20,144.99
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,476,177.50	1,130,176.16
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,880,295,553.47	-803,195,957.42
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,944,818,769.63	-897,865,036.99
债券投资收益	6.4.7.13	-3,894,049.36	-350,583.33
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	5,628,569.19
股利收益	6.4.7.15	68,417,265.52	89,391,093.71
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	6,674,494,436.52	-6,813,747,406.87
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	409,008.24	3,413,598.51
二、费用（以“-”号填列）		-115,117,451.94	-192,273,282.47
1. 管理人报酬		-81,378,139.63	-128,440,398.91
2. 托管费		-13,563,023.29	-21,406,733.21
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	-19,864,152.05	-42,088,462.90
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	-312,136.97	-337,687.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,695,709,974.28	-7,792,776,837.80
所得税费用（以“-”号填列）		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,695,709,974.28	-7,792,776,837.80

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：2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2009 年 1 月 1 日 - 2009 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）	18,789,195,415.79	-9,985,755,393.18	8,803,440,022.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,695,709,974.28	4,695,709,974.28
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）	-778,009,054.64	298,027,508.26	-479,981,546.38
其中：1. 基金申购款	203,982,082.74	-80,438,578.26	123,543,504.48
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-981,991,137.38	378,466,086.52	-603,525,050.86
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）	18,011,186,361.15	-4,992,017,910.64	13,019,168,450.51
项目	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日 - 2008 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）	18,920,142,103.32	1,058,669,722.19	19,978,811,825.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-7,792,776,837.80	-7,792,776,837.80
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）	496,468,146.23	125,139,370.66	621,607,516.89
其中：1. 基金申购款	3,350,596,292.23	1,774,741.59	3,352,371,033.82
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-2,854,128,146.00	123,364,629.07	-2,730,763,516.93
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）	19,416,610,249.55	-6,608,967,744.95	12,807,642,504.60

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、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3号《半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》、关于发布《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〉(试行)》等问题的通知及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

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2009年6月30日的财务状况以及2009年上半年度的经营成果和净值变动情况。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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

本期本基金无差错更正事项。

6.4.6 税项

(1) 印花税

根据财政部、国家税务总局财税字[2007]84 号文《关于调整证券（股票）交易印花税率的通知》的规定，自 2007 年 5 月 30 日起，调整证券（股票）交易印花税率，由原先的 1‰调整为 3‰；

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 2009 年 6 月 30 日
活期存款	1,476,090,478.95
定期存款	-
其他存款	-
合计	1,476,090,478.95

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2009年6月30日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	11,553,657,525.86	11,293,522,499.04	-260,135,026.82
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	20,000,000.00	20,050,000.00
	合计	20,000,000.00	20,050,000.00
资产支持证券	-	-	-
其他	-	-	-
合计	11,573,657,525.86	11,313,572,499.04	-260,085,026.82

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 2009年6月30日
应收活期存款利息	357,897.72
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	1,308.40
应收债券利息	15,430.14
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	11.62
其他	91.00
合计	374,738.88

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 2009年6月30日
交易所市场应付交易费用	4,129,140.52
银行间市场应付交易费用	2,675.00
合计	4,131,815.52

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009年6月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	24,750.00
预提信息披露费	148,767.52
预提审计费	49,588.57
合计	723,106.09

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日	
	基金份额（份）	帐面金额
上年度末	18,789,195,415.79	18,789,195,415.79
本期申购	203,982,082.74	203,982,082.74
本期赎回	-981,991,137.38	-981,991,137.38

本期末	18,011,186,361.15	18,011,186,361.15
-----	-------------------	-------------------

注：申购含转换入份额；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	-3,998,991,756.63	-5,986,763,636.55	-9,985,755,393.18
本期利润	-1,978,784,462.24	6,674,494,436.52	4,695,709,974.28
本期基金份额交易产生的变动数	240,834,800.02	57,192,708.24	298,027,508.26
其中：基金申购款	-62,625,902.41	-17,812,675.85	-80,438,578.26
基金赎回款	303,460,702.43	75,005,384.09	378,466,086.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,736,941,418.85	744,923,508.21	-4,992,017,910.64

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日
活期存款利息收入	5,172,727.95
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	66,247.61
其他	1,672.33
合计	5,240,647.89

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日
卖出股票成交总额	6,481,760,806.84
卖出股票成本总额	-8,426,579,576.47
买卖股票差价收入	-1,944,818,769.63

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交金额	1,098,080,512.74
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-1,074,211,833.33
应收利息总额	-27,762,728.77
债券投资收益	-3,894,049.36

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

本报告期无权证投资。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日
股票投资产生的股利收益	68,417,265.52
基金投资产生的股利收益	-
合计	68,417,265.52

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日
1. 交易性金融资产	6,674,494,436.52
——股票投资	6,680,090,283.19
——债券投资	-5,595,846.67
——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	6,674,494,436.52

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日
基金赎回费收入	359,744.33
其他收入转换费收入	24,884.15
其他收入	7,482.99
印花税返还	16,896.77
合计	409,008.24

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日
交易所市场交易费用	19,860,827.05
银行间市场交易费用	3,325.00

合计	19,864,152.05
----	---------------

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日	
	审计费用	49,588.57
信息披露费	148,767.52	
其他费用	50,390.88	
账户维护费	63,390.00	
交易费用	-	
合计	312,136.97	

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

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

本基金无需做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

无

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、基金代销机构
光大证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构

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 2009年1月1日 - 2009年6月30日		上年度可比期间 2008年1月1日 - 2008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	3,320,916,107.98	25.64%	2,291,034,752.38	19.51%

6.4.10.1.2 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日		上年度可比期间 2008年1月1日 - 2008年6月30日	
	成交金额	占当期权证成交 总额的比例	成交金额	占当期权证成交 总额的比例
光大证券	-	-	3,607,659.21	0.03%

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日		上年度可比期间 2008年1月1日 - 2008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	-	-	5,285,928.00	0.05%

6.4.10.1.4 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 2009年1月1日 - 2009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	2,822,765.22	25.99%	814,477.02	19.73%
关联方名称	上年度可比期间 2008年1月1日 - 2008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	1,947,379.60	19.87%	562,241.45	18.63%

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 2009年1月1日 - 2009年6月 30日	上年度可比期间 2008年1月1日 - 2008年6月30日
	当期应支付的管理费	81,378,139.63
其中：当期已支付	65,870,324.29	111,197,807.79

期末未支付	15,507,815.34	17,242,591.12
-------	---------------	---------------

注：(1) 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。

(2) 上述表格中“当期已支付”不包含当期已支付的上年应付管理费。

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
	2009年1月1日 - 2009年6月30日	2008年1月1日 - 2008年6月30日
当期应支付的托管费	13,563,023.29	21,406,733.21
其中：当期已支付	10,978,387.41	18,532,968.01
期末未支付	2,584,635.88	2,873,765.20

注：(1) 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。

(2) 上述表格中“当期已支付”不包含当期已支付的上年应付托管费。

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

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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	
	2009年1月1日 - 2009年6月30日		2008年1月1日 - 2008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	1,476,090,478.95	5,172,727.95	2,172,335,902.35	11,765,196.91
------	------------------	--------------	------------------	---------------

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金无需要披露在承销期内参与关联方承销证券的情况。

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（2009 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

本基金本报告期末无认购流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
000792	盐湖钾肥	2009-6-26	制定重大资产重组调整方案	55.14	2009-7-27	60.65	1,147,583	57,359,007.67	63,277,726.62

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

本基金本报告期末无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

本基金本报告期末无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，除在附注 6.4.12.2 列示的部分基金资产流通暂时受限不能自由转让的情况外，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 2009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	1,476,090,478.95	-	-	-	-	-	1,476,090,478.95
结算备付金	3,738,363.99	-	-	-	-	-	3,738,363.99
存出保证金	260,000.00	-	-	-	-	2,073,979.62	2,333,979.62
交易性金融 资产	-	-	-	-	20,050,000.00	11,293,522,499.04	11,313,572,499.04
买入返售金 融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清 算款	-	-	-	-	-	325,833,174.96	325,833,174.96
应收利息	-	-	-	-	-	374,738.88	374,738.88
应收股利	-	-	-	-	-	1,450,933.48	1,450,933.48
应收申购款	825,703.98	-	-	-	-	-	825,703.98
资产总计	1,480,914,546.92	-	-	-	20,050,000.00	11,623,255,325.98	13,124,219,872.90
负债							
应付证券清 算款	-	-	-	-	-	67,814,240.62	67,814,240.62
应付赎回款	-	-	-	-	-	14,289,808.94	14,289,808.94
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	15,507,815.34	15,507,815.34
应付托管费	-	-	-	-	-	2,584,635.88	2,584,635.88
应付交易费 用	-	-	-	-	-	4,131,815.52	4,131,815.52
其他负债	-	-	-	-	-	723,106.09	723,106.09
负债总计	-	-	-	-	-	105,051,422.39	105,051,422.39
利率敏感 度缺口	1,480,914,546.92	-	-	-	20,050,000.00	11,518,203,903.59	13,019,168,450.51
上年度末 2008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	1,347,531,055.06	-	-	-	-	-	1,347,531,055.06
结算备付金	10,879,653.05	-	-	-	-	-	10,879,653.05
存出保证金	260,000.00	-	-	-	-	500,000.00	760,000.00
交易性金融	-	96,350,000.00	467,842,000.00	-	-	6,569,346,563.51	7,133,538,563.51

资产							
买入返售金融资产	317,000,475.50	-	-	-	-	-	317,000,475.50
应收证券清算款	-	-	-	-	-	27,882.92	27,882.92
应收利息	-	-	-	-	-	13,632,176.53	13,632,176.53
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	297,544.20	-	-	-	-	-	297,544.20
资产总计	1,675,968,727.81	96,350,000.00	467,842,000.00	-	-	6,583,506,622.96	8,823,667,350.77
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,038,902.16	2,038,902.16
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	11,744,793.31	11,744,793.31
应付托管费	-	-	-	-	-	1,957,465.52	1,957,465.52
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,292,502.00	3,292,502.00
其他负债	-	-	-	-	-	1,193,665.17	1,193,665.17
负债总计	-	-	-	-	-	20,227,328.16	20,227,328.16
利率敏感度缺口	1,675,968,727.81	96,350,000.00	467,842,000.00	-	-	6,563,279,294.80	8,803,440,022.61

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 2009年6月30日	上年度末 2008年12月31日
	1、基准利率上升1%	减少108.02万元	减少230.25万元
	2、基准利率下降1%	增加108.02万元	增加230.25万元

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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 2009年6月30日		上年度末 2008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	11,293,522,499.04	86.75	6,569,346,563.51	74.62
交易性金融资产-债券投资	20,050,000.00	0.15	564,192,000.00	6.41
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	11,313,572,499.04	86.90	7,133,538,563.51	81.03

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、本期末其他价格风险的敏感度分析假设基金未来业绩表现相对业绩基准的波动性与其今年以来的整体水平保持一致。		
	2、上年度末其他价格风险的敏感度分析假设基金未来业绩表现相对业绩基准的波动性与上年度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 2009年6月30日	上年度末 2008年12月31日
	1、业绩基准净值增加1%	增加13,648.86万元	增加9,056.04万元
	2、业绩基准净值减少1%	减少13,648.86万元	减少9,056.04万元

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	11,293,522,499.04	86.05
	其中：股票	11,293,522,499.04	86.05
2	固定收益投资	20,050,000.00	0.15
	其中：债券	20,050,000.00	0.15
	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	1,479,828,842.94	11.28
6	其他资产	330,818,530.92	2.52
7	合计	13,124,219,872.90	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	926,826,168.78	7.12
C	制造业	3,743,717,704.11	28.76
C0	食品、饮料	243,038,377.94	1.87
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	14,444,504.10	0.11
C4	石油、化学、塑胶、塑料	425,124,366.15	3.27
C5	电子	16,622,761.20	0.13
C6	金属、非金属	1,060,408,188.14	8.14
C7	机械、设备、仪表	1,563,193,872.09	12.01
C8	医药、生物制品	338,645,546.78	2.60
C99	其他制造业	82,240,087.71	0.63
D	电力、煤气及水的生产和供应业	123,062,600.32	0.95
E	建筑业	218,524,174.44	1.68

F	交通运输、仓储业	359,824,011.73	2.76
G	信息技术业	717,502,115.19	5.51
H	批发和零售贸易	616,518,931.46	4.74
I	金融、保险业	3,459,298,716.92	26.57
J	房地产业	822,767,709.34	6.32
K	社会服务业	207,344,274.91	1.59
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	98,136,091.84	0.75
	合计	11,293,522,499.04	86.75

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	601166	兴业银行	19,016,210	705,691,553.10	5.42
2	600000	浦发银行	29,540,000	680,010,800.00	5.22
3	601318	中国平安	8,911,908	440,782,969.68	3.39
4	600030	中信证券	14,490,799	409,509,979.74	3.15
5	600016	民生银行	42,195,938	334,191,828.96	2.57
6	000001	深发展 A	13,485,000	294,242,700.00	2.26
7	600050	中国联通	41,976,859	287,961,252.74	2.21
8	601328	交通银行	31,351,596	282,477,879.96	2.17
9	000402	金融街	19,332,159	266,010,507.84	2.04
10	000933	神火股份	12,868,904	257,378,080.00	1.98
11	601088	中国神华	7,761,040	232,132,706.40	1.78
12	000063	中兴通讯	8,112,991	227,975,047.10	1.75
13	600582	天地科技	11,000,000	226,050,000.00	1.74
14	600028	中国石化	20,799,971	221,727,690.86	1.70
15	002024	苏宁电器	13,404,839	215,415,762.73	1.65
16	000667	名流置业	30,016,200	204,110,160.00	1.57
17	000898	鞍钢股份	14,111,629	186,132,386.51	1.43
18	600550	天威保变	5,094,175	181,760,164.00	1.40
19	600009	上海机场	11,225,823	172,428,641.28	1.32
20	000825	太钢不锈	22,000,000	168,960,000.00	1.30
21	600970	中材国际	5,717,802	167,074,174.44	1.28
22	600309	烟台万华	10,564,068	166,595,352.36	1.28
23	000069	华侨城 A	7,885,000	164,796,500.00	1.27
24	600739	辽宁成大	4,972,491	164,688,901.92	1.27
25	600089	特变电工	9,002,442	162,404,053.68	1.25

26	601628	中国人寿	5,827,286	160,541,729.30	1.23
27	000839	中信国安	10,426,133	153,681,200.42	1.18
28	000002	万 科 A	12,000,000	153,000,000.00	1.18
29	600104	上海汽车	10,000,000	149,500,000.00	1.15
30	600276	恒瑞医药	3,813,580	133,132,077.80	1.02
31	600123	兰花科创	3,771,900	133,034,913.00	1.02
32	600001	邯鄲钢铁	23,165,599	129,032,386.43	0.99
33	000024	招商地产	4,000,000	127,000,000.00	0.98
34	000539	粤电力 A	17,480,483	123,062,600.32	0.95
35	000858	五 粮 液	6,200,000	122,326,000.00	0.94
36	600867	通化东宝	10,407,453	121,663,125.57	0.93
37	600600	青岛啤酒	4,539,766	120,712,377.94	0.93
38	000960	锡业股份	5,305,885	120,337,471.80	0.92
39	600067	冠城大通	8,966,856	116,479,459.44	0.89
40	600837	海通证券	7,000,000	115,150,000.00	0.88
41	600031	XD 三一重	3,954,507	113,771,166.39	0.87
42	600720	祁连山	7,934,566	106,878,604.02	0.82
43	000680	山推股份	9,200,606	101,298,672.06	0.78
44	600331	宏达股份	6,177,734	98,164,193.26	0.75
45	000009	中国宝安	8,274,544	98,136,091.84	0.75
46	600875	东方电气	2,481,153	96,516,851.70	0.74
47	000338	潍柴动力	2,591,001	94,390,166.43	0.73
48	600631	百联股份	6,822,125	89,096,952.50	0.68
49	600569	安阳钢铁	19,394,560	86,111,846.40	0.66
50	601919	中国远洋	6,269,096	85,071,632.72	0.65
51	000912	泸 天 化	7,397,657	78,637,093.91	0.60
52	600026	中海发展	5,708,029	73,690,654.39	0.57
53	600736	苏州高新	11,586,450	72,647,041.50	0.56
54	600616	金枫酒业	4,000,000	69,000,000.00	0.53
55	600456	宝钛股份	3,000,000	68,700,000.00	0.53
56	000792	盐湖钾肥	1,147,583	63,277,726.62	0.49
57	000717	韶钢松山	11,286,698	54,176,150.40	0.42
58	601168	西部矿业	3,424,723	52,192,778.52	0.40
59	601186	中国铁建	5,000,000	51,450,000.00	0.40
60	600118	中国卫星	2,731,581	47,884,614.93	0.37
61	600521	华海药业	3,360,240	46,774,540.80	0.36
62	000651	格力电器	2,178,446	45,529,521.40	0.35
63	600879	火箭股份	3,285,795	45,113,965.35	0.35
64	600685	XD 广船国	2,000,749	44,556,680.23	0.34
65	600210	紫江企业	7,933,741	44,508,287.01	0.34
66	000527	美的电器	2,980,998	42,628,271.40	0.33

67	002140	东华科技	1,675,769	42,547,774.91	0.33
68	600202	哈空调	3,000,000	42,450,000.00	0.33
69	002182	云海金属	3,011,069	40,739,763.57	0.31
70	600019	宝钢股份	5,587,714	39,337,506.56	0.30
71	600208	新湖中宝	3,384,018	37,731,800.70	0.29
72	600535	天士力	2,262,099	37,075,802.61	0.28
73	601009	南京银行	2,039,982	36,699,276.18	0.28
74	000425	徐工科技	1,110,409	36,621,288.82	0.28
75	600697	欧亚集团	1,832,872	34,531,308.48	0.27
76	600856	长百集团	4,875,384	31,543,734.48	0.24
77	000012	南玻A	1,997,000	31,292,990.00	0.24
78	600348	国阳新能	1,000,000	30,360,000.00	0.23
79	600586	金晶科技	2,131,335	28,709,082.45	0.22
80	600717	天津港	2,360,518	28,633,083.34	0.22
81	002147	方圆支承	2,406,228	28,225,054.44	0.22
82	600183	生益科技	4,174,601	28,178,556.75	0.22
83	600527	江南高纤	3,000,000	18,450,000.00	0.14
84	000016	深康佳A	3,378,610	16,622,761.20	0.13
85	600966	博汇纸业	1,866,215	14,444,504.10	0.11
86	600827	友谊股份	939,545	12,242,271.35	0.09
87	000800	一汽轿车	500,000	7,720,000.00	0.06

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	601166	兴业银行	318,066,749.70	3.61
2	600837	海通证券	309,416,718.57	3.51
3	601318	中国平安	199,761,900.78	2.27
4	000001	深发展A	197,507,304.23	2.24
5	601088	中国神华	185,304,846.10	2.10
6	600739	辽宁成大	183,825,087.27	2.09
7	600016	民生银行	166,848,033.95	1.90
8	600582	天地科技	158,294,414.95	1.80
9	601186	中国铁建	145,982,239.94	1.66
10	000933	神火股份	143,523,054.87	1.63
11	000069	华侨城A	127,798,131.40	1.45
12	600970	中材国际	123,693,178.85	1.41

13	000858	五 粮 液	116,645,677.36	1.33
14	600875	东方电气	109,724,284.30	1.25
15	600348	国阳新能	107,104,867.86	1.22
16	000960	锡业股份	102,467,251.12	1.16
17	000402	金 融 街	100,677,701.50	1.14
18	600031	三一重工	98,802,931.13	1.12
19	601766	中国南车	96,485,920.40	1.10
20	600050	中国联通	93,352,068.50	1.06

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	600123	兰花科创	244,908,571.35	2.78
2	600837	海通证券	230,146,726.50	2.61
3	000839	中信国安	207,505,849.22	2.36
4	601398	工商银行	199,905,322.75	2.27
5	000002	万 科 A	183,004,082.83	2.08
6	601006	大秦铁路	171,459,273.36	1.95
7	000024	招商地产	166,408,802.38	1.89
8	000001	深发展 A	157,749,810.25	1.79
9	000063	中兴通讯	133,676,741.31	1.52
10	600268	国电南自	131,933,717.07	1.50
11	600348	国阳新能	126,304,513.32	1.43
12	600312	平高电气	123,191,619.30	1.40
13	601939	建设银行	120,397,805.47	1.37
14	600028	中国石化	115,868,572.82	1.32
15	600201	金宇集团	108,147,004.80	1.23
16	601766	中国南车	104,407,059.50	1.19
17	601186	中国铁建	99,223,889.56	1.13
18	002024	苏宁电器	95,608,006.44	1.09
19	601001	大同煤业	95,467,841.52	1.08
20	600060	海信电器	92,364,485.23	1.05

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	6,471,243,193.81
卖出股票的收入（成交）总额	6,481,760,806.84

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	20,050,000.00	0.15
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	20,050,000.00	0.15

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	0980110	09 远洋地产债	200,000	20,050,000.00	0.15

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其余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 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,333,979.62
2	应收证券清算款	325,833,174.96
3	应收股利	1,450,933.48
4	应收利息	374,738.88
5	应收申购款	825,703.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	330,818,530.92

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中不存在流通受限情况。

7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金无其他需要描述的内容。

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
855,233	21,059.98	131,358,240.40	0.73%	17,879,828,120.75	99.27%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

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开放式基金	1,798,825.06	0.01%

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007-08-24）基金份额总额	9,905,973,604.86
报告期期初基金份额总额	18,789,195,415.79
报告期期间基金总申购份额	203,982,082.74
报告期期间基金总赎回份额	-981,991,137.38
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	18,011,186,361.15

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 报告期内改聘会计师事务所情况

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监管部门稽查或处罚的情况

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

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易	
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中银国际	1	451,308,941.40	3.48%	-	-
中信证券	1	1,384,983,339.28	10.69%	-	-
国泰君安	1	2,861,655,373.69	22.09%	-	-
海通证券	1	486,337,295.59	3.75%	-	-
招商证券	1	530,126,715.05	4.09%	-	-
联合证券	1	262,045,734.98	2.02%	-	-
光大证券	1	3,320,916,107.98	25.64%	-	-
中金公司	1	882,614,313.40	6.81%	-	-
兴业证券	1	1,102,306,112.25	8.51%	-	-
国金证券	1	922,858,176.21	7.12%	-	-
华泰证券	1	747,851,890.82	5.77%	-	-
华弘证券	1	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-
合计	13	12,953,004,000.65	100.00%	-	-

券商名称	回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金	
	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	佣金	占当期佣金总量的比例
中银国际	-	-	-	-	383,612.53	3.53%
中信证券	-	-	-	-	1,177,236.76	10.84%
国泰君安	-	-	-	-	2,325,115.24	21.41%
海通证券	-	-	-	-	413,386.09	3.81%
招商证券	-	-	-	-	450,606.40	4.15%
联合证券	-	-	-	-	212,913.94	1.96%
光大证券	-	-	-	-	2,822,765.22	25.99%
中金公司	-	-	-	-	717,130.54	6.60%
兴业证券	-	-	-	-	936,959.97	8.63%
国金证券	-	-	-	-	784,425.84	7.22%
华泰证券	-	-	-	-	635,673.05	5.85%
华弘证券	-	-	-	-	-	-

广发证券	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	10,859,825.58	100.00%

注：

1、报告期内租用证券公司交易单元变更情况。

(1) 新增租用交易单元

本基金报告期内无新增租用交易单元情况。

(2) 停止租用：本基金报告期内终止租用山西证券交易单元。

2、专用交易单元的选择标准和程序

(1) 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：

a 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；

b 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

c 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；

d 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；

e 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；

f 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；

g 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。

(2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

a 投资研究团队按照（1）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；

b 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。

c 根据各成员评分，得出各证券经营机构的综合评分。

d 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。

e 董事会已做出决议，授权总经理依照公司对各券商的评价结果全权处理并决定公司旗下基金租用专用交易席位的事宜。

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	光大保德信基金管理有限公司关于在北京银行股份有限公司开办旗下基金转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2009-6-9
2	光大保德信基金管理有限公司关于在北京银行股份有限公司开办部分旗下基金定期定额申购业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2009-6-9
3	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金参与兴业银行基金定期定额申	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2009-6-6

	购费率优惠活动的公告		
4	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国信证券股份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》	2009-6-5
5	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华夏银行为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2009-5-22
6	光大保德信基金管理有限公司关于在光大证券股份有限公司开通旗下部分基金定期定额申购业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2009-5-8
7	光大保德信基金管理有限公司关于旗下基金在齐鲁证券有限公司开通基金定期定额申购和基金转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2009-5-8
8	光大保德信基金管理有限公司关于开通民生银行卡基金网上直销业务及申购费率优惠公告的更正公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2009-4-28
9	光大保德信基金管理有限公司关于开通民生银行卡基金网上直销业务及申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2009-4-25
10	光大保德信优势配置基金招募说明书（更新）摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2009-4-9
11	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司个人网上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》	2009-3-30
12	光大保德信基金管理有限公司关于更改纸质季度对账单寄送对象的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2009-3-16
13	关于光大保德信基金管理有限公司旗下部分基金新增齐鲁证券有限公司代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2009-3-13
14	光大保德信基金管理有限公司关于通过交通银行网上银行申购旗下部分基金申购费率优惠调整的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2009-2-25
15	光大保德信基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件或身份证明文件的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2009-2-12
16	光大保德信基金管理有限公司关于旗下基金新增宏源证券股份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》	2009-2-7
17	光大保德信基金管理有限公司关于开通招商银行“一卡通”基金网上直销业务及申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2009-2-6
18	光大保德信基金管理有限公司关于旗下	《中国证券报》、《上海证	2009-1-17

	基金新增深圳平安银行股份有限公司为代销机构的公告	券报》、《证券时报》	
19	光大保德信基金管理有限公司关于旗下基金新增安信证券股份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》	2009-1-14
20	光大保德信基金管理有限公司关于在上海浦东发展银行开展基金网上交易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》	2009-1-9
21	光大保德信基金管理有限公司关于恢复公司旗下部分基金持有的唐钢股份股票市价估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2009-1-5

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、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优势配置股票型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

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：400-820-2888 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
二〇〇九年八月二十八日