

光大保德信量化核心证券投资基金

2007年半年度报告（正文）

目录

一、	重要提示	1
二、	基金简介	1
	(一) 基金基本情况	1
	(二) 基金投资概况	1
	(三) 基金管理人	2
	(四) 基金托管人	3
	(五) 基金信息披露	3
	(六) 注册登记机构	3
三、	基金主要财务指标和基金净值表现	3
	(一) 主要财务指标	3
	(二) 基金净值表现	4
四、	基金管理人报告	5
	(一) 基金管理人简介	5
	(二) 基金经理简介	5
	(三) 基金运作的遵规守信情况说明	5
	(四) 基金投资策略和业绩表现说明	5
	(五) 宏观经济、证券市场、行业走势及投资管理展望	6
五、	基金托管人报告	6
六、	财务会计报告	7
	(一) 基金会计报表	7
	(二) 会计报表附注	10
七、	投资组合报告	17
	(一) 基金资产组合情况	17
	(二) 按行业分类的股票投资组合	17
	(三) 按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细	17

(四) 股票投资组合的重大变动	22
(五) 按券种分类的债券投资组合	26
(六) 按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细	27
(七) 投资组合报告附注	27
八、 基金份额持有人户数、持有人结构	28
九、 开放式基金份额变动	28
十、 重大事件揭示	28
十一、 备查文件目录	32

一、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——中国光大银行根据本基金合同规定,于 2006 年 8 月 20 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及其更新。

本报告期间为 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日。本报告财务资料未经审计。

二、基金简介

(一) 基金基本情况

基金名称: 光大保德信量化核心证券投资基金

基金简称: 量化核心

交易代码: 360001

基金运作方式: 契约型开放式

基金合同生效日: 2004 年 8 月 27 日

报告期末基金份额总额: 4,909,405,074.10 份

基金合同存续期: 不定期

(二) 基金投资概况

基金投资目标: 追求长期持续稳定超出业绩比较基准的投资回报。

基金投资策略: 本基金借鉴了外方股东保德信投资的量化投资管理理念和长期经验,结合中国市场现行特点加以改进,形成光大保德信独特的量化投资策略;正常市场情况下不作主动资产配置,采用自下而上与自上而下相结合的方式选择股票;并通过投资组合优化器构建并动态优化投资组合,确保投资组合

风险收益特征符合既定目标。

为了确保产品定位的清晰性，本基金在正常市场情况下不作主动资产配置，即股票/现金等各类资产持有比例保持相对固定。

投资品种	基准比例
股票	90%
现金	10%

由于持有股票资产的市值波动导致仓位变化，股票持有比例允许在一定范围（上下 5%）内浮动。

本基金通过光大保德信特有的以量化投资为核心的多重优化保障体系构建处于或接近有效边际曲线的投资组合。该体系在构建投资组合时综合考量收益因素及风险因素，一方面通过光大保德信独特的多因素数量模型对所有股票的预期收益率进行估算，个股预期收益率的高低直接决定投资组合是否持有该股票；另一方面投资团队从风险控制的角度出发，重点关注数据以外的信息，通过行业分析和个股分析对多因素数量模型形成有效补充，由此形成的行业评级和个股评级将决定行业及个股权重相对业绩基准的偏离范围；然后由投资组合优化器通过一定的量化技术综合考虑个股预期收益率，行业评级和个股评级等参数，根据预先设定的风险目标构建投资组合，并对投资组合进行动态持续优化，使投资组合风险收益特征符合既定目标。

业绩比较基准： $90\% \times \text{新华富时中国 A200 指数} + 10\% \times \text{同业存款利率}$

风险收益特征：本基金风险收益特征属于证券投资基金中风险程度中等偏高的品种，按照风险收益配比原则对投资组合进行严格的风险管理，在风险限制范围内追求收益最大化。

(三) 基金管理人

名称：光大保德信基金管理有限公司

注册地址：上海市延安东路 222 号外滩中心 46 层

办公地址：上海市延安东路 222 号外滩中心 46 层

邮政编码：200002

法定代表人：林昌

总经理：傅德修

信息披露负责人：伍文静
 联系电话：021-33074700-3105
 传真：021-63351152
 电子信箱：wuwj@epf.com.cn
 客户服务电话：021-53524620

(四) 基金托管人

名称：中国光大银行
 注册地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦
 办公地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦
 邮政编码：100045
 法定代表人：王明权
 信息披露负责人：张建春
 联系电话：010-68560675
 传真：010-68560661
 电子信箱：zjc@cebbank.com

(五) 基金信息披露

基金信息披露报纸：《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
 基金半年度报告（全文）查询网址：<http://www.epf.com.cn>
 基金半年度报告置备地点：光大保德信基金管理有限公司、中国光大银行

(六) 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

三、基金主要财务指标和基金净值表现

下述基金业绩指标不包括持有人申购、赎回基金等各项交易费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(一) 主要财务指标（未经审计）

财务指标	2007 年 1 月 1 日至 6 月 30 日
基金本期净收益	204,053,625.65

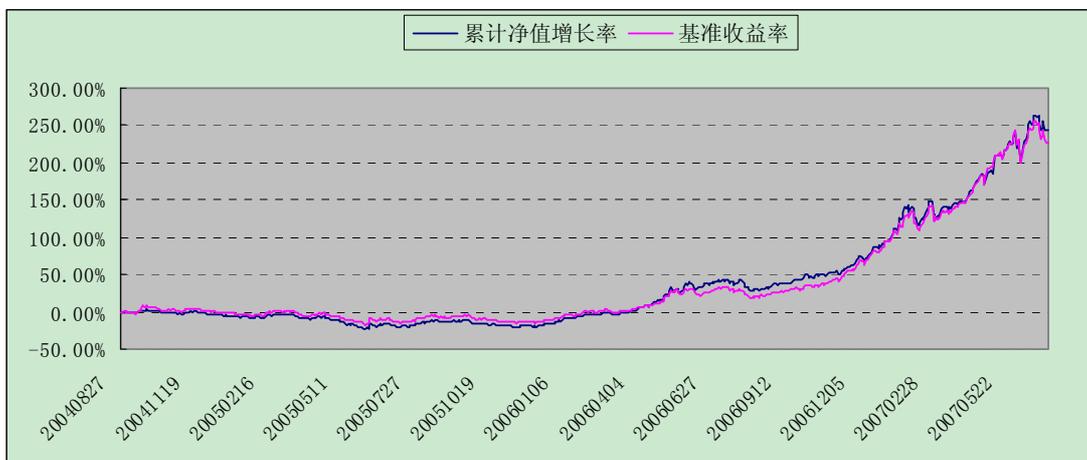
基金份额本期净收益	0.1342
期末可供分配基金收益	2,054,334,898.34
期末可供分配基金份额收益	0.4184
期末基金资产净值	5,463,115,646.25
期末基金份额净值	1.1128
基金加权平均净值收益率	10.8703%
本期基金份额净值增长率	75.8317%
基金份额累计净值增长率	243.4611%

(二) 基金净值表现

1、 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.61%	2.58%	-1.64%	2.66%	6.25%	-0.08%
过去三个月	38.45%	2.25%	32.06%	2.19%	6.39%	0.06%
过去六个月	75.83%	2.26%	68.24%	2.22%	7.59%	0.04%
过去一年	143.08%	1.52%	146.88%	1.79%	-3.80%	0.04%
自基金合同生效起至今	243.46%	1.43%	225.37%	1.42%	18.09%	0.01%

2、 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



备注：根据本基金基金合同规定，本基金资产配置比例为股票 90%、现金

10%，由于持有股票资产的市值波动导致仓位变化，股票持有比例允许在一定范围（上下 5%）内浮动。报告期末本基金投资组合比例符合上述规定。

四、基金管理人报告

（一）基金管理人简介

光大保德信基金管理有限公司（以下简称“光大保德信”）成立于 2004 年 4 月，由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，两家股东分别持有 67% 和 33% 的股份。公司主要从事基金发起、设立和管理业务，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 2007 年 6 月 30 日止，光大保德信旗下管理着四只开放式基金，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以及光大保德信新增长股票型证券投资基金。

（二）基金经理简介

袁宏隆先生，美国南卡罗莱纳国际商务管理学硕士，台北淡江大学国际贸易学系学士。美国特许财务分析师，台湾证券投资分析人员资格。曾任国际证券投资信托股份有限公司投资研究部经理，获多利詹金宝投资顾问股份有限公司研究部总经理，加拿大伦敦人寿保险公司权益证券投资部资深副总经理，荷银证券投资信托股份有限公司执行副总经理、投资总监。现任光大保德信基金管理有限公司副总经理兼首席投资总监、本基金基金经理。

备注：经光大保德信基金管理有限公司四届二次董事会审议批准，由本公司副总经理兼首席投资总监袁宏隆先生担任光大保德信量化核心证券投资基金基金经理，常昊先生不再担任本基金基金经理。

（三）基金运作的合规守信情况说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的规定，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。

（四）基金投资策略和业绩表现说明

在上市公司业绩继续强劲增长以及流动性充裕的背景下，上半年股市延续了 2006 年的上涨趋势，但市场的振荡加剧，2007 上半年沪深 300 指数上涨 84.42%。本基金在 2007 年上半年的净值增长率为 75.83%，同期比较基准收益率为 68.24%，基金表现与基准相当。

就上半年的涨幅来看，年初行情延续 2006 年第四季火热行情，但业绩优良的蓝筹股在上半年表现平平，上证 50 指数仅上涨 61.52%，大幅落后沪深 300 指数。中小板块里具有资产注入和借壳上市题材的股票持续表现强劲，虽然股市在二月底起曾有短暂时间大幅度向下调整，但自四月以来 A 股市场已经进入了狂热爆发，三线股、垃圾股涨幅惊人，市场事实上已经出现了一定的结构性泡沫，股价操纵的迹象和市场投机气氛日益浓烈。5 月 29 日晚财政部宣布调高股票交易印花税从 0.1% 到 0.3%，由于印花税的调高打击了短线投机的力量并对大量的今年入市的新股民造成较大心理冲击，A 股指数出现了最大 20% 的跌幅，但是由于下跌之后的估值回归合理，新基金发行提供充裕流动性，市场得以回稳，蓝筹股走势回归强势，三线股和垃圾股股价迭创新低，结构性泡沫被刺破。

(五) 宏观经济、证券市场、行业走势及投资管理展望

展望 07 年下半年，由于市场结构的调整，投资机会再度浮现，市场风险意识的提升将有助于蓝筹，及有持续业绩成长公司的表现。我们认为市场去芜存菁后，寻找并长期持有具有良好成长性的公司才能够获得稳健回报。具有核心市场或产品竞争优势的公司仍然是基金的重点配置。目前，政策面上以负面消息居多且市场观望气氛浓厚，但 A 股市场基本面持续向好，盈利增长幅度预估继续提升，基金经理对后市仍看好。基金将依量化指标经定性深度研究后进行个股选择及调整权重以降低投资组合估值水平，同时不牺牲投资组合的盈利增长幅度。也会在分析公司基本面的同时，对于能直接受益于中国经济成长的产业，例如金融服务业，天然资源，电气设备，公共建设等产业以及人民币升值所带来资产重估增值的地产开发业等重点关注。

五、基金托管人报告

中国光大银行根据《证券投资基金法》及相关法规、《光大保德信量化核

心证券投资基金基金合同》和《光大保德信量化核心证券投资基金托管协议》，托管光大保德信量化核心证券投资基金（以下简称量化核心基金）。

2007 年上半年，中国光大银行在量化核心基金托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及相关实施准则、基金合同、托管协议和其他有关规定，依法安全保管了基金的全部资产，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为托管人所应尽的义务。

2007 年上半年，中国光大银行依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及相关实施准则、基金合同、托管协议和其他有关规定，对基金管理人——光大保德信基金管理有限公司进行了监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。

本托管人依法对基金管理人——光大保德信基金管理有限公司编制的“光大保德信量化核心证券投资基金 2007 年半年度报告”进行了审核，报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容是真实、准确和完整的。

中国光大银行

2007 年 8 月 20 日

六、财务会计报告

（未经审计，金额单位若非特别说明均为人民币元）

（一）基金会计报表

1、资产负债表

项目	附注	2007 年 6 月 30 日	2006 年 12 月 31 日
资产			
银行存款	16	1,221,389,251.86	37,149,852.81
清算备付金		27,709,098.93	830,061.52
交易保证金		1,250,000.00	1,500,000.00

项目	附注	2007 年 6 月 30 日	2006 年 12 月 31 日
应收证券清算款		-	261,732.95
应收股利		791,317.62	-
应收利息	4	243,630.37	9,157.14
应收申购款		68,840,382.54	43,382.52
其他应收款		-	-
股票投资市值	5	4,698,607,305.49	480,659,364.63
其中：股票投资成本		4,062,231,435.97	322,235,988.66
债券投资市值		-	-
其中：债券投资成本		-	-
权证投资市值	5	1,294,342.50	5,301,900.00
其中：权证投资成本		-	1,035,080.19
资产总计		6,020,125,329.31	525,755,451.57
负债及持有人权益			
负债			
应付证券清算款		527,683,902.17	6,127,650.19
应付赎回款		17,603,189.56	403,366.08
应付赎回费		62,633.00	414.91
应付管理人报酬		5,707,518.81	610,988.81
应付托管费		951,253.12	101,831.49
应付佣金	6	4,032,994.52	676,499.59
其他应付款	7	750,000.00	750,000.00-
预提费用	8	218,191.88	460,000.00-
负债合计		557,009,683.06	9,130,751.07
持有人权益			
实收基金	9	1,776,384,025.63	282,528,048.49
未实现利得/（损失）	10	1,632,396,722.28	52,867,048.95
累计基金净收益/（损失）		2,054,334,898.34	181,229,603.06
持有人权益合计		5,463,115,646.25	516,624,700.50

项目	附注	2007年6月30日	2006年12月31日
负债及持有人权益总计		6,020,125,329.31	525,755,451.57
每单位基金资产净值		1.1128	1.8286

2、经营业绩表

项目	附注	2007年1月1日至 6月30日止期间	2006年1月1日至 6月30日止期间
收入			
股票差价收入	11	196,679,325.35	-177,617,536.52
债券差价收入		.00	6,051,689.46
权证差价收入	12	6,020,557.17	-
债券利息收入		.00	1,621,156.53
存款利息收入		1,531,561.00	1,147,582.96
股利收入		14,455,179.38	24,397,474.03
买入返售证券收入			138,052.00
其他收入	13	752,703.22	436,404.10
收入合计		219,439,326.12	-143,825,177.44
费用			
基金管理人报酬	16	12,992,799.67	13,282,076.31
基金托管费	16	2,165,466.62	2,213,679.40
卖出回购证券支出			137,850.00
其他费用	14	227,434.18	195,648.43
其中：信息披露费		178,520.30	132,439.51
审计费用		39,671.58	49,588.57
帐户维护费		9,000	-
费用合计		15,385,700.47	15,829,254.14
基金净收益/（损失）		204,053,625.65	-159,654,431.58
加：未实现利得/（损失）		474,980,016.24	-80,826,178.92
基金经营业绩		679,033,641.89	-240,480,610.50

3、收益分配表

项目	附注	2007年1月1日至 6月30日止期间	2006年1月1日至 6月30日止期间
本期基金净收益/（损失）		204,053,625.65	-159,654,431.58
加：期初基金净收益/（损失）		181,229,603.06	-12,631,274.19
加：本期损益平准金		1,669,051,669.63	6,493,075.35
可供分配基金净收益		2,054,334,898.34	-165,792,630.42
减：本期已分配基金净收益	15	-	-
期末基金净收益/（损失）		2,054,334,898.34	-165,792,630.42

4、 基金净值变动表

项目	附注	2007年1月1日至 6月30日止期间	2006年1月1日至 6月30日止期间
期初基金净值		516,624,700.50	1,924,610,187.53
本期经营活动：			
基金净收益/（损失）		204,053,625.65	-159,654,431.58
未实现利得/（损失）		474,980,016.24	-80,826,178.92
经营活动产生的基金净值变动数		679,033,641.89	-240,480,610.50
本期基金单位交易：			
基金申购款		4,908,516,168.96	184,831,799.01
其中：红利再投资款			0.00
基金赎回款		-641,058,865.10	-307,590,008.76
基金单位交易产生的基金净值变动数		4,267,457,303.86	-122,758,209.75
本期向持有人分配收益：			
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数			-
期末基金净值		5,463,115,646.25	1,561,371,367.28

(二) 会计报表附注

1、 基金基本情况

光大保德信量化核心证券投资基金(以下简称“本基金”)，系经中国证券

监督管理委员会证监基金字[2004]85 号文《关于同意光大保德信量化核心证券投资基金设立的批复》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募集，基金合同于 2004 年 8 月 27 日正式生效，首次设立募集规模为 2,544,287,215.94 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，基金托管人为中国光大银行。

2、本基金本报告期内会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表一致，无会计政策、会计估计变更，以及重大会计差错更正的情况。

3、基金主要税项

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

(2) 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》，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。

(3) 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》，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。

4、应收利息

项目	2007 年 6 月 30 日
应收银行存款利息	231,818.45
应收清算备付金利息	11,424.69
应收申购款利息	387.23

项目	2007 年 6 月 30 日
合计	243,630.37

5、投资估值增值/（减值）

项目	2007 年 6 月 30 日		
	市值	成本	估值增值/（减值）
股票投资	4,698,607,305.49	4,062,231,435.97	636,375,869.52
债券投资	0	-	-
权证投资	1,294,342.50	-	1,294,342.50
合计	4,699,901,647.99	4,062,231,435.97	637,670,212.02

本基金自 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间所投资的股票中，因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价为人民币 552.55 元。此等现金对家于股权分置改革方案实施后的股票复牌日，冲减股票投资成本。

6、应付佣金

项目	2007 年 6 月 30 日
中国银河证券有限责任公司	380,234.54
申银万国证券股份有限公司	835,957.68
光大证券股份有限公司	1,598,622.85
中国国际金融有限公司	660,325.97
平安证券有限责任公司	557,853.48
合计	4,032,994.52

7、其他应付款

项目	2007 年 6 月 30 日
应付券商席位保证金	750,000.00
合计	750,000.00

8、预提费用

项目	2007 年 6 月 30 日
预提信息披露费	178,520.30
预提审计费	39,671.58
合计	218,191.88

9、实收基金

项目	2007 年 6 月 30 日
期初数	282,528,048.49
加：本期因申购的增加数	2,226,959,295.12
减：本期因赎回的减少数	-733,103,317.98
期末数	1,776,384,025.63

10、(1)未实现利得/（损失）

项目	2007 年 6 月 30 日
期初数	52,867,048.95
未实现投资估值增值/（减值）(1)	637,670,212.02
本期因申购的未实现利得/（损失）平准金	1,286,237,232.89
本期因赎回的未实现利得/（损失）平准金	291,510,722.63
合计	1,632,396,722.28

(2)未实现投资估值增值/（减值）按投资类别分项列示如下：

项目	2007 年 6 月 30 日
股票投资	636,375,869.52
债券投资	0
权证投资	1,294,342.50
合计	637,670,212.02

11、股票差价收入

项目	2007 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间
卖出股票成交总额	741,513,549.93
减：卖出股票成本总额	544,211,254.05
应付佣金总额	622,970.53
股票差价收入	196,679,325.35

12、权证差价收入

项目	2007 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间
卖出权证成交总额	13,158,621.50

项目	2007 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间
减：卖出权证成本总额	7,138,064.33
减：应付佣金总额	0
权证差价收入	6,020,557.17

13、其他收入

项目	2007 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间
赎回费收入	751,098.61
转换费收入	1,604.61
合计	752,703.22

14、其他费用

项目	2007 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间
信息披露费	178,520.30
审计费	39,671.58
账户维护费	9,000
合计	227,191.88

15、本期已分配基金净收益

本报告期内本基金未分红。

16、重大关联方关系及关联交易

(1) 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、基金发起人 注册登记人、基金销售机构
中国光大银行	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
保德信投资管理有限公司	基金管理人的股东

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2) 通过关联方席位进行的交易

(a) 股票投资

	2007 年 1 月 1 日 至 6 月 30 日止期间		2006 年 1 月 1 日 至 6 月 30 日止期间	
	成交金额	占报告期总成交金额的比例	成交金额	占报告期总成交金额的比例
光大证券	1,990,513,648.73	39.70%	845,616,889.03	29.46%

(b) 权证投资

	2007 年 1 月 1 日 至 6 月 30 日止期间		2006 年 1 月 1 日 至 6 月 30 日止期间	
	成交金额	占报告期总成交金额的比例	成交金额	占报告期总成交金额的比例
光大证券	11,345,425.70	58.90%	6,795,150.16	38.65%

(c) 本基金无债券投资及债券回购交易。

(d) 佣金

	2007 年 1 月 1 日 至 6 月 30 日止期间		2006 年 1 月 1 日 至 6 月 30 日止期间	
	支付的佣金金额	占报告期佣金总量的比例	支付的佣金金额	占报告期佣金总量的比例
光大证券	1,598,622.85	39.64%	681,164.21	29.28%

注：(i)上述佣金已扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的由券商承担的证券结算风险基金。(ii)股票交易佣金为成交金额的 1‰扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、买（卖）证管费和证券结算风险基金等）；证券公司不向本基金收取国债现券及国债回购和企业债券的交易佣金，但交易的经手费和证管费由本基金交纳，其所计提的证券结算风险基金从支付给证券公司的股票交易佣金中扣除。佣金的比率是公允的，符合证监会有关规定。管理人因此从关联方获得的服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

(3) 基金管理人报酬

支付基金管理人光大保德信基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公

式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

项目	2007 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间	2006 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间
期初余额	610,988.81	1,648,436.15
本期计提	12,992,799.67	7,100,586.74
本期支付	7,896,269.67	8,047,445.72
期末余额	5,707,518.81	701,577.17

(4) 基金托管费

支付基金托管人中国光大银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

项目	2007 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间	2006 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间
期初余额	101,831.49	274,739.36
本期计提	2,165,466.62	1,183,431.16
本期支付	1,316,044.99	1,341,240.98
期末余额	951,253.12	116,929.54

(5) 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，并按银行间同业利率计息。由基金托管人保管的银行存款利息收入如下：

项目	2007 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间	2006 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间
银行存款产生的利息收入	1,454,900.84	342,104.86

本报告期末由基金托管人保管的银行存款余额为 1,221,389,251.86 元。

(6) 关联方持有基金份额

本基金的基金管理人、基金托管人、基金管理人主要股东及其控制的机构截至 2007 年 6 月 30 末均未持有本基金份额。

	2007 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间
期初持有基金份额	8,155,126.01

加：本期认购/申购	-
拆分增加	14,383,433.75
基金分红再投资	-
减：本期赎回	22,538,559.76
期末持有实收基金	0.00
占期末基金总份额的比例	0.00%
申购费率/赎回费率	0.50%

本基金的基金托管人、基金管理人主要股东及其控制的机构在本报告期末未持有本基金份额。

七、投资组合报告

(一) 基金资产组合情况

资产组合	期末市值（元）	占基金总资产的比例
股票	4,698,607,305.49	78.05%
权证	1,294,342.50	0.02%
债券	0	0
银行存款及清算备付金 合计	1,249,098,350.79	20.75%
其他资产	71,125,330.53	1.18%
资产总值	6,020,125,329.31	100.00%

(二) 按行业分类的股票投资组合

分类	股票市值（元）	占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	78,369,029.00	1.43%
B 采掘业	237,576,029.71	4.35%
C 制造业	2,417,176,151.14	44.24%
C0 食品、饮料	287,165,575.82	5.26%
C1 纺织、服装、皮毛	5,994,252.00	0.11%
C2 木材、家具	16,821,000.00	0.31%
C3 造纸、印刷	0.00	0.00%

分类	股票市值（元）	占基金资产净值比例
C4 石油、化学、塑胶、塑料	101,103,438.31	1.85%
C5 电子	58,447,375.11	1.07%
C6 金属、非金属	1,098,845,835.72	20.11%
C7 机械、设备、仪表	790,635,966.98	14.47%
C8 医药、生物制品	58,162,707.20	1.06%
C99 其他制造业	0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	21,556,345.31	0.39%
E 建筑业	73,523,899.30	1.35%
F 交通运输、仓储业	302,261,739.96	5.53%
G 信息技术业	281,431,258.39	5.15%
H 批发和零售贸易	35,749,397.14	0.65%
I 金融、保险业	842,123,186.87	15.41%
J 房地产业	232,838,636.95	4.26%
K 社会服务业	58,674,436.88	1.07%
L 传播与文化产业	28,798,000.00	0.53%
M 综合类	88,529,194.84	1.62%
合计	4,698,607,305.49	86.01%

(三) 按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细

序号	股票代码	股票名称	期末数量 (股)	期末市值（元）	市值占基金 资产净值比
1	000778	新兴铸管	21,600,000	295,704,000.00	5.41%
2	000651	格力电器	8,189,000	285,796,100.00	5.23%
3	600036	招商银行	9,296,623	228,510,993.34	4.18%
4	600030	中信证券	3,281,563	173,824,392.11	3.18%
5	601006	大秦铁路	9,720,164	147,163,282.96	2.69%
6	600973	宝胜股份	5,313,124	145,101,416.44	2.66%
7	601628	中国人寿	3,511,025	144,338,237.75	2.64%

序号	股票代码	股票名称	期末数量 (股)	期末市值(元)	市值占基金 资产净值比
8	600150	沪东重机	919,153	127,063,710.72	2.33%
9	600586	金晶科技	6,267,850	124,542,179.50	2.28%
10	600517	置信电气	3,500,000	120,715,000.00	2.21%
11	600016	民生银行	10,396,989	118,837,584.27	2.18%
12	000401	冀东水泥	7,800,000	107,328,000.00	1.96%
13	600028	中国石化	6,800,000	89,896,000.00	1.65%
14	000039	中集集团	2,800,000	82,096,000.00	1.50%
15	000709	唐钢股份	6,147,027	78,559,005.06	1.44%
16	000829	天音控股	2,339,374	78,369,029.00	1.43%
17	000895	双汇发展	1,312,371	75,986,280.90	1.39%
18	000024	招商地产	1,525,574	74,905,683.40	1.37%
19	000858	五粮液	2,372,200	74,629,412.00	1.37%
20	600970	中材国际	1,347,085	73,523,899.30	1.35%
21	000060	中金岭南	2,503,316	73,347,158.80	1.34%
22	000869	张裕A	1,117,160	68,682,996.80	1.26%
23	600067	冠城大通	3,146,464	67,806,299.20	1.24%
24	600000	浦发银行	1,844,000	67,471,960.00	1.24%
25	600050	中国联通	9,999,865	58,699,207.55	1.07%
26	002007	华兰生物	1,398,142	58,162,707.20	1.06%
27	600585	海螺水泥	964,209	56,849,762.64	1.04%
28	000908	S 天一科	3,019,767	52,332,562.11	0.96%
29	601398	工商银行	10,000,000	50,100,000.00	0.92%
30	600096	云天化	1,999,951	48,978,799.99	0.90%
31	601001	大同煤业	1,918,951	48,530,270.79	0.89%
32	600887	伊利股份	1,499,992	46,739,750.72	0.86%
33	000002	万科A	2,400,000	45,888,000.00	0.84%
34	000063	中兴通讯	831,036	45,208,358.40	0.83%

序号	股票代码	股票名称	期末数量 (股)	期末市值(元)	市值占基金 资产净值比
35	000717	韶钢松山	5,500,000	38,775,000.00	0.71%
36	000762	西藏矿业	2,488,650	38,325,210.00	0.70%
37	600009	上海机场	1,000,000	38,010,000.00	0.70%
38	000338	潍柴动力	453,100	35,568,350.00	0.65%
39	600048	保利地产	764,243	35,101,680.99	0.64%
40	600325	华发股份	1,155,917	35,058,962.61	0.64%
41	000507	粤富华	3,008,074	34,773,335.44	0.64%
42	000792	盐湖钾肥	780,264	34,628,116.32	0.63%
43	000069	华侨城A	861,100	34,271,780.00	0.63%
44	000062	深圳华强	3,305,996	33,555,859.40	0.61%
45	600019	宝钢股份	3,010,000	33,110,000.00	0.61%
46	600005	武钢股份	3,288,000	33,077,280.00	0.61%
47	600583	海油工程	906,590	32,818,558.00	0.60%
48	000652	泰达股份	1,122,175	31,735,109.00	0.58%
49	600736	苏州高新	2,325,505	30,208,309.95	0.55%
50	000831	关铝股份	1,858,380	30,087,172.20	0.55%
51	600037	歌华有线	1,100,000	28,798,000.00	0.53%
52	600591	上海航空	4,600,000	28,704,000.00	0.53%
53	000839	中信国安	1,009,117	28,255,276.00	0.52%
54	000960	锡业股份	854,304	27,773,423.04	0.51%
55	000937	金牛能源	1,661,027	26,509,990.92	0.49%
56	600029	南方航空	3,000,000	25,740,000.00	0.47%
57	600104	上海汽车	1,451,015	25,059,029.05	0.46%
58	600258	首旅股份	624,748	24,402,656.88	0.45%
59	600015	华夏银行	2,000,000	24,080,000.00	0.44%
60	000823	超声电子	2,783,587	24,022,355.81	0.44%
61	002028	思源电气	381,733	24,003,371.04	0.44%

序号	股票代码	股票名称	期末数量 (股)	期末市值(元)	市值占基金 资产净值比
62	600361	华联综超	799,906	22,149,397.14	0.41%
63	600761	安徽合力	770,000	21,945,000.00	0.40%
64	600879	火箭股份	810,876	21,561,192.84	0.39%
65	000531	穗恒运A	1,859,909	21,556,345.31	0.39%
66	000898	鞍钢股份	1,200,000	21,228,000.00	0.39%
67	600456	宝钛股份	480,000	20,500,800.00	0.38%
68	600529	山东药玻	1,600,000	20,208,000.00	0.37%
69	600415	小商品城	200,000	20,200,000.00	0.37%
70	600808	马钢股份	2,999,955	20,159,697.60	0.37%
71	000825	太钢不锈	999,948	20,058,956.88	0.37%
72	600026	中海发展	800,000	18,384,000.00	0.34%
73	600261	浙江阳光	1,084,715	17,811,020.30	0.33%
74	600978	宜华木业	540,000	16,821,000.00	0.31%
75	600423	柳化股份	931,128	16,527,522.00	0.30%
76	600519	贵州茅台	130,000	15,558,400.00	0.28%
77	600584	长电科技	1,297,400	15,192,554.00	0.28%
78	000001	深发展A	550,000	15,136,000.00	0.28%
79	600888	新疆众和	470,000	15,096,400.00	0.28%
80	601166	兴业银行	400,000	14,036,000.00	0.26%
81	000759	武汉中百	1,000,000	13,600,000.00	0.25%
82	600748	上实发展	600,000	11,676,000.00	0.21%
83	601111	中国国航	1,000,000	9,790,000.00	0.18%
84	600166	福田汽车	584,714	7,560,352.02	0.14%
85	600232	金鹰股份	681,165	5,994,252.00	0.11%
86	601318	中国平安	80,940	5,788,019.40	0.11%
87	000568	泸州老窖	132,274	5,568,735.40	0.10%
88	600718	东软股份	100,000	4,167,000.00	0.08%

序号	股票代码	股票名称	期末数量 (股)	期末市值(元)	市值占基金 资产净值比
89	601919	中国远洋	149,800	2,735,348.00	0.05%
90	600123	兰花科创	50,000	1,496,000.00	0.03%
91	000528	柳工	50,000	1,225,000.00	0.02%
92	600331	宏达股份	20,000	969,000.00	0.02%
93	002137	实益达	15,500	731,445.00	0.01%
94	002139	拓邦电子	11,500	690,000.00	0.01%
95	000878	云南铜业	10,000	345,000.00	0.01%

(四) 股票投资组合的重大变动

1、 累计买入价值超过期初基金资产净值百分之二或累计买入价值前二十名的股票明细

股票代码	股票名称	买入累计金额(元)	占期初基金资产 净值比例
000778	新兴铸管	301,498,810.62	58.36%
000651	格力电器	221,003,385.61	42.78%
600036	招商银行	164,116,552.14	31.77%
600030	中信证券	162,801,967.76	31.51%
601628	中国人寿	137,514,425.60	26.62%
601006	大秦铁路	122,601,910.73	23.73%
000401	冀东水泥	112,343,335.93	21.75%
600016	民生银行	108,198,116.68	20.94%
600973	宝胜股份	91,695,627.24	17.75%
600586	金晶科技	90,953,552.76	17.61%
600028	中国石化	89,668,820.17	17.36%
600517	置信电气	86,809,219.07	16.80%
600150	中国船舶	84,497,355.81	16.36%
000709	唐钢股份	83,192,821.37	16.10%

股票代码	股票名称	买入累计金额（元）	占期初基金资产净值比例
000060	中金岭南	78,201,123.90	15.14%
600050	中国联通	67,355,289.46	13.04%
000869	张裕A	65,497,147.61	12.68%
600649	原水股份	65,264,229.63	12.63%
000829	天音控股	65,172,387.86	12.62%
000024	招商地产	63,457,699.35	12.28%
600970	中材国际	60,926,792.69	11.79%
000858	五粮液	59,170,912.38	11.45%
600067	冠城大通	59,100,163.11	11.44%
000062	深圳华强	56,656,572.94	10.97%
000908	S 天一科	56,331,895.37	10.90%
000762	西藏矿业	53,973,905.21	10.45%
600000	浦发银行	52,610,448.10	10.18%
000039	中集集团	52,471,149.70	10.16%
000839	中信国安	51,418,323.18	9.95%
601398	工商银行	51,076,087.68	9.89%
600591	上海航空	51,001,447.98	9.87%
600096	云天化	50,563,656.22	9.79%
000717	韶钢松山	47,812,183.36	9.25%
600325	华发股份	42,231,830.25	8.17%
600361	华联综超	41,783,824.73	8.09%
002007	华兰生物	41,704,697.81	8.07%
000652	泰达股份	40,529,891.67	7.85%
601001	大同煤业	39,957,441.45	7.73%
000507	粤富华	39,401,814.70	7.63%
600585	海螺水泥	38,736,691.59	7.50%

股票代码	股票名称	买入累计金额（元）	占期初基金资产净值比例
600009	上海机场	38,413,955.48	7.44%
000069	华侨城A	36,351,254.93	7.04%
600583	海油工程	34,845,038.09	6.74%
600887	伊利股份	34,472,202.25	6.67%
600005	武钢股份	34,235,563.99	6.63%
600019	宝钢股份	33,594,691.26	6.50%
600048	保利地产	31,722,754.51	6.14%
000831	关铝股份	30,274,849.11	5.86%
600736	苏州高新	29,990,375.09	5.81%
000792	盐湖钾肥	29,013,848.78	5.62%
000338	潍柴动力	28,391,336.94	5.50%
600258	首旅股份	28,126,688.76	5.44%
000960	锡业股份	28,000,542.03	5.42%
000063	中兴通讯	27,726,325.08	5.37%
600037	歌华有线	26,890,255.24	5.20%
600029	南方航空	26,712,535.50	5.17%
000937	金牛能源	26,164,263.35	5.06%
600015	华夏银行	24,856,151.99	4.81%
600529	山东药玻	24,747,651.23	4.79%
000823	超声电子	23,935,828.43	4.63%
000898	鞍钢股份	21,781,010.78	4.22%
000531	穗恒运A	21,467,258.63	4.16%
600322	天房发展	21,038,677.43	4.07%
600808	马钢股份	20,713,096.46	4.01%
000825	太钢不锈	20,649,680.32	4.00%
600104	上海汽车	20,525,040.26	3.97%

股票代码	股票名称	买入累计金额（元）	占期初基金资产净值比例
600584	长电科技	20,332,177.25	3.94%
600261	浙江阳光	19,613,709.76	3.80%
002028	思源电气	19,482,720.79	3.77%
600423	柳化股份	16,625,952.39	3.22%
000759	武汉中百	16,318,886.46	3.16%
600795	国电电力	15,554,728.29	3.01%
600210	紫江企业	15,503,535.63	3.00%
600978	宜华木业	15,110,366.30	2.92%
600748	上实发展	14,558,840.16	2.82%
000550	江铃汽车	14,456,631.28	2.80%
600166	福田汽车	14,320,355.15	2.77%
601166	兴业银行	12,113,364.98	2.34%
000002	万 科A	10,959,747.93	2.12%
600195	中牧股份	10,800,417.14	2.09%

2、 累计卖出价值超过期初基金资产净值百分之二或累计卖出价值前二十名的股票明细

股票代码	股票名称	卖出累计金额（元）	占期初基金资产净值比例
600649	原水股份	73,727,098.21	14.27%
600322	天房发展	43,047,933.37	8.33%
000839	中信国安	41,367,778.75	8.01%
600361	华联综超	36,990,894.68	7.16%
002028	思源电气	35,142,442.36	6.80%
000652	泰达股份	30,005,540.16	5.81%
600195	中牧股份	27,358,307.19	5.30%
600973	宝胜股份	26,148,634.00	5.06%

股票代码	股票名称	卖出累计金额（元）	占期初基金资产净值比例
600895	张江高科	25,454,719.42	4.93%
600028	中国石化	21,906,193.55	4.24%
600005	武钢股份	21,490,186.02	4.16%
600210	紫江企业	18,871,750.85	3.65%
600591	上海航空	18,843,151.55	3.65%
000550	江铃汽车	18,211,807.96	3.53%
000062	深圳华强	17,543,869.08	3.40%
600795	国电电力	16,087,114.40	3.11%
000727	华东科技	15,241,727.11	2.95%
600859	王府井	13,021,927.24	2.52%
600887	伊利股份	12,844,937.13	2.49%
000778	新兴铸管	12,061,527.08	2.33%
600030	中信证券	11,244,459.79	2.18%
600258	首旅股份	10,770,961.73	2.08%
600208	中宝股份	10,532,714.35	2.04%
601006	大秦铁路	10,479,206.10	2.03%

3、报告期内买入股票成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票成本总额（元）	4,284,207,253.91
卖出股票收入总额（元）	741,513,549.93

(五) 按券种分类的债券投资组合

债券类别	债券市值（元）	占基金资产净值的比例
国家债券投资	-	-
央行票据投资	-	-
金融债券投资	-	-
企业债券投资	-	-
可转债投资	-	-

债券类别	债券市值（元）	占基金资产净值的比例
债券投资合计	-	-

(六) 按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	名称	市值（元）	占基金资产净值的比例
1	-	-	-
2	-	-	-
3	-	-	-
4	-	-	-
5	-	-	-
合计		-	-

(七) 投资组合报告附注

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。

2、 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、 其他资产构成：

分类	金额（元）
交易保证金	1,250,000.00
应收股利	791,317.62
应收利息	243,630.37
应收申购款	68,840,382.54
合计	71,125,330.53

4、 报告期末本基金无处于转股期的可转换债券。

5、 （1）报告期末投资的权证。

权证名称	代码	持有数量(份)	成本总额（元）	备注
深发 SFC1	031003	55000	0	因股权分置改革被动持有
深发 SFC2	031004	27500	0	因股权分置改革被动持有

(2) 报告期内投资的权证。

权证名称	代码	持有数量(份)	成本总额（元）	备注
------	----	---------	---------	----

权证名称	代码	持有数量(份)	成本总额(元)	备注
长电 CWB1	580007	800,000	4,577,238.10	报告期内已全部卖出

八、基金份额持有人户数、持有人结构

持有基金份额/比例				持有人户数	户均持有份额(份)
个人(份)	比例	机构(份)	比例		
4,073,729,647.05	82.98%	835,675,427.05	17.02%	131527	37,326.21

九、开放式基金份额变动

基金合同生效日的基金份额总额	2,544,287,215.94
本报告期初基金总份额	282,528,048.49
加：本期基金总申购份额	4,281,670,756.97
转换入基金总份额	986,827.26
基金拆分	905,472,174.81
减：本期基金总赎回份额	560,300,162.18
转换出基金总份额	952,571.25
本报告期末基金总份额	4,909,405,074.10

十、重大事件揭示

(一) 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。

(二) 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：

1. 经光大保德信基金管理有限公司三届六次董事会审议通过，同意由首席市场总监梅键先生、首席投资总监袁宏隆先生兼任公司副总经理。梅键、袁宏隆先生的副总经理任职资格已获中国证监会核准（《光大保德信基金管理有限公司关于梅键、袁宏隆先生兼任公司副总经理的公告》信息披露报纸：上海证券报、中国证券报、证券时报，披露日期：2007年2月9日）。

2. 经光大保德信基金管理有限公司(以下简称“公司”)三届九次董事会审议通过，同意梅键先生辞去公司副总经理兼首席市场总监的职务。（《光大保德信基金管理有限公司关于梅键辞去公司副总经理兼首席市场总监职务的公告》信息

披露报纸：上海证券报、中国证券报、证券时报，披露日期：2007 年 4 月 7 日）。

(三) 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。

(四) 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。

(五) 基金收益分配事项：

本报告期内本基金未分红。

(六) 基金改聘为其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。

(七) 基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情形：

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。

(八) 基金租用证券公司专用交易席位的有关情况：

1、 报告期内租用各证券公司席位进行的股票成交量统计

证券公司名称	租用席位数量	股票成交金额	占总成交额的比例	佣金	占佣金总量的比例
光大证券	2	1,990,513,648.73	39.70%	1,598,622.85	39.64%
申银万国	1	1,019,464,502.69	20.33%	835,957.68	20.73%
中金公司	1	805,277,232.09	16.06%	660,325.97	16.37%
平安证券	1	712,908,706.94	14.22%	557,853.48	13.83%
银河证券	1	485,918,387.57	9.69%	380,234.54	9.43%
合计	6	5,014,082,478.02	100.00%	4,032,994.52	100.00%

2、 报告期内租用各证券公司席位进行的债券和债券回购成交量统计：

无。

3、 报告期内租用证券公司席位的变更情况：

无

(九) 其他在报告期内发生的重大事件（披露在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和本基金管理人公司网站上）：

1、 2007 年 1 月 5 日，基金管理人刊登《关于 2006 年 12 月 31 日我司所管理的

基金基金资产净值、基金份额净值等事项的说明》。

2、2007 年 1 月 19 日，基金管理人刊登《光大保德信基金管理有限公司关于旗下基金申购费率优惠活动的公告》，在 2007 年 1 月 22 日至 2007 年 2 月 15 日正常交易日，通过招商银行、光大银行、兴业银行购买本基金的投资者（仅适用于前端收费），享受正常申购费率 6 折的优惠。

3、2007 年 1 月 20 日，基金管理人刊登《光大保德信基金管理有限公司关于旗下光大保德信量化核心证券投资基金重新开放大额申购及转入业务的公告》，自 2007 年 1 月 22 日起恢复光大保德信量化核心证券投资基金的正常申购及转入业务。

4、2007 年 3 月 7 日，基金管理人刊登《光大保德信基金管理有限公司关于变更公司住所的公告》，光大保德信基金管理有限公司住所变更为：上海市延安东路 222 号外滩中心大厦 46 层。

5、2007 年 3 月 8 日，基金管理人刊登《光大保德信基金管理有限公司关于开通中国建设银行龙卡（借记卡）基金网上交易的公告》，本公司与中国建设银行股份有限公司合作，面向持有中国建设银行龙卡借记卡的个人投资者推出了基金网上交易业务。

6、2007 年 4 月 13 日，基金管理人刊登《光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书（更新）摘要》。

7、2007 年 4 月 23 日，基金管理人刊登《关于光大保德信基金管理有限公司旗下开放式基金在广发证券股份有限公司开展网上交易费率优惠活动的公告》，凡通过广发证券网上交易系统申购本公司旗下所有开放式基金，原来申购费率高于 0.6% 的，最低优惠至 0.6%，且不低于原费率的四折；原申购费率低于 0.6% 的，则按原费率执行。

8、2007 年 4 月 25 日，基金管理人刊登《关于修改光大保德信量化核心证券投资基金基金合同的公告》，将本基金的基金合同第六部分“基金的基本情况”中的第（四）条每份基金份额面值条款“每份基金份额面值人民币 1.00 元”，修改为“每份基金份额初始面值为人民币 1.00 元”。

9、2007 年 4 月 25 日，基金管理人刊登《光大保德信基金管理有限公司关于对光大保德信量化核心证券投资基金实施基金份额拆分和限量销售的公告》，公司

定于 2007 年 5 月 8 日实施基金份额拆分，拆分当天将基金面值将为 1 元，同时开展基金限量销售，销售限额为 40 亿元。

10、2007 年 4 月 27 日，基金管理人刊登《光大保德信基金管理有限公司关于变更公司董事的公告》，经光大保德信基金管理有限公司（以下简称“公司”）2007 年度股东会审议，决定任命新一届董事会成员。新一届董事会成员为：林昌、克里斯托弗·库珀（Christopher Cooper）、傅德修、沈诗光、俞忠华、夏小华（独立董事）、金德环（独立董事）、陈继忠（独立董事）。

11、2007 年 4 月 30 日，基金管理人刊登《关于光大保德信基金管理有限公司旗下开放式基金在中国光大银行开展网上交易费率优惠活动的公告》，活动期间凡通过光大银行网上交易系统申购本公司旗下所有股票型开放式基金的投资者，均享受申购费率优惠。

12、2007 年 5 月 9 日，基金管理人刊登《光大保德信量化核心证券投资基金基金份额拆分比例公告》，根据基金管理人 2007 年 4 月 25 日公告的基金份额拆分比例计算公式，计算所得基金份额拆分比例为 2.763729186（保留到小数点后 9 位，第 9 位以后舍去），本基金管理人按照该拆分比例对基金份额进行了拆分。

13、2007 年 5 月 12 日，基金管理人刊登《关于光大保德信量化核心证券投资基金暂停申购业务及提前结束持续营销活动的公告》。

14、2007 年 5 月 14 日，基金管理人刊登《光大保德信量化核心证券投资基金持续营销限量申购确认比例的公告》，对于 2007 年 5 月 11 日的申购申请本公司按照比例确认，申购申请确认比例为 44.42%（含申购费）。

15、2007 年 5 月 26 日，基金管理人刊登《光大保德信基金管理有限公司关于赎回旗下量化核心证券投资基金的公告》，本公司于 2007 年 6 月 1 日通过代销机构赎回光大保德信量化核心证券投资基金（基金代码：360001）22,538,559.76 份，赎回费率为 0.5%。本公司持有该基金已经超过证监会所规定的期限。

16、2007 年 6 月 1 日，基金管理人刊登《光大保德信基金管理有限公司关于调整旗下基金申购费用、申购份额计算方法以及修改基金合同、招募说明书相关条款的公告》，对收取前端申购费用情况下的申购费用及申购份额、转换补差费用及转换入份额的计算方法统一调整为“外扣法”，并对基金合同、招募说明书中涉及上述内容的条款进行修改。

17、2007 年 6 月 5 日，基金管理人刊登《光大保德信量化核心证券投资基金开放申购和转换业务的公告》。

(十) 报告期后至半年报披露日期间发生的重大事件：

1、2007 年 7 月 23 日，基金管理人刊登《关于光大保德信基金管理有限公司旗下部分基金新增中信银行为代销机构的公告》，自公告日起，中信银行开始代理光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信红利股票型证券投资基金及光大保德信新增长股票型证券投资基金。

2、2007 年 7 月 27 日，基金管理人刊登《光大保德信基金管理有限公司关于增加直销资金账户的公告》，自公告日起，基金管理人分别在中国工商银行和中国建设银行增开直销资金帐户。

3、2007 年 8 月 1 日，基金管理人刊登《关于光大保德信基金管理有限公司旗下开放式基金在兴业证券股份有限公司开展网上交易费率优惠活动的公告》，凡通过兴业证券网上交易系统申购本公司旗下所有开放式基金，原来申购费率高于 0.6% 的，最低优惠至 0.6%，且不低于原费率的四折；原申购费率低于 0.6% 的，则按原费率执行。

(十一) 本报告期内其他重大事项：

1. 截至 2007 年 6 月 30 日，光大保德信基金管理有限公司基金从业人员持有“光大保德信量化核心证券投资基金”基金份额的总量为 0 份。

十一、 备查文件目录

(一) 本基金备查文件目录

- 1、 中国证监会批准光大保德信量化核心证券投资基金设立的文件
- 2、 光大保德信量化核心证券投资基金基金合同
- 3、 光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书
- 4、 光大保德信量化核心证券投资基金托管协议
- 5、 光大保德信量化核心证券投资基金法律意见书
- 6、 基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
- 7、 基金托管人业务资格批件和营业执照
- 8、 报告期内光大保德信量化核心证券投资基金在指定报刊上披露的各项公

告

9、 中国证监会要求的其他文件

(二) 存放地点及查阅方式

1、 查阅地址：中国上海市延安东路 222 号外滩中心大厦 46 层

2、 网址：<http://www.epf.com.cn>

光大保德信基金管理有限公司

2007 年 8 月 27 日