

---

光大保德信量化核心证券投资基金  
**2009 年年度报告**  
2009 年 12 月 31 日

基金管理人：光大保德信基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一〇年三月二十九日

---

## §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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2010 年 3 月 26 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。

本报告中财务资料已经审计，安永华明会计师事务所为本基金财务出具了 2009 年度无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2009 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

---

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	7
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	14
§5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金运作合规守信、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 审计报告.....	14
6.1 管理层对财务报表的责任.....	15
6.2 注册会计师的责任.....	15
6.3 审计意见.....	15
§7 年度财务报表.....	15
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§8 投资组合报告.....	38
8.1 期末基金资产组合情况.....	38
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
8.3 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.....	39
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
8.6 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.....	44
8.7 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.....	44
8.8 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.....	44

---

8.9 投资组合报告附注.....	44
§9 基金份额持有人信息.....	45
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	45
§10 开放式基金份额变动.....	45
§11 重大事件揭示.....	45
11.1 基金份额持有人大会决议.....	45
11.2 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.....	45
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
11.4 基金投资策略的改变.....	45
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	46
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	49
§13 备查文件目录.....	49

## §2 基金简介

### 2.1 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	光大保德信量化股票
基金主代码	360001
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
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	15,243,723,121.55份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金追求长期持续稳定超出业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>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。在构建投资组合时综合考虑收益因素及风险因素，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。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。</p> <p>投资品种 基准比例</p> <p>股票 90%</p> <p>现金 10%</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	90%×新华富时中国 A200 指数+10%×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。

### 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	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	伍文静	张建春
	联系电话	021-33074700-3105	010-68560675
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	zjc@cebbank.com
客户服务电话		400-820-2888, 021-53524620	95595
传真		021-63351152	010-68560661
注册地址		上海市延安东路222号外滩中心46楼	北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
办公地址		上海市延安东路222号外滩中心46楼	北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦

邮政编码	200002	100045
法定代表人	林昌	唐双宁

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.epf.com.cn
基金年度报告备置地点	光大保德信基金管理有限公司、中国光大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
会计师事务所	安永华明会计师事务所	上海市长乐路989号世纪商贸广场23楼
注册登记机构	光大保德信基金管理有限公司	上海市延安东路外滩中心大厦46楼

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2009年	2008年	2007年
本期已实现收益	-1,043,807,658.95	-5,439,598,950.74	1,351,595,092.81
本期利润	7,798,666,505.60	-15,762,281,481.39	2,738,794,735.60
加权平均基金份额本期利润	0.4832	-0.9691	0.3650
本期加权平均净值利润率	58.38%	-104.21%	25.48%
本期基金份额净值增长率	90.61%	-64.75%	155.61%
3.1.2 期末数据和指标	2009年末	2008年末	2007年末
期末可供分配利润	1,962,963,282.73	2,628,782,203.03	10,217,813,321.96
期末可供分配基金份额利润	0.1288	0.1667	0.5379
期末基金资产净值	15,357,148,200.93	8,336,445,706.27	28,478,945,161.14
期末基金份额净值	1.0074	0.5285	1.4993
3.1.3 累计期末指标	2009年末	2008年末	2007年末
基金份额累计净值增长率	235.51%	76.02%	399.29%

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）若干比较数据已进行重述，以符合本年度列报要求。

（4）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
过去三个月	19.20%	1.66%	15.66%	1.58%	3.54%	0.08%
过去六个月	14.48%	1.97%	10.08%	1.91%	4.40%	0.06%
过去一年	90.61%	1.93%	80.20%	1.84%	10.41%	0.09%
过去三年	71.75%	2.40%	58.91%	2.25%	12.84%	0.15%
过去五年	254.78%	2.03%	214.62%	1.90%	40.16%	0.13%
自基金合同生效起至今	235.51%	1.97%	204.78%	1.86%	30.73%	0.11%

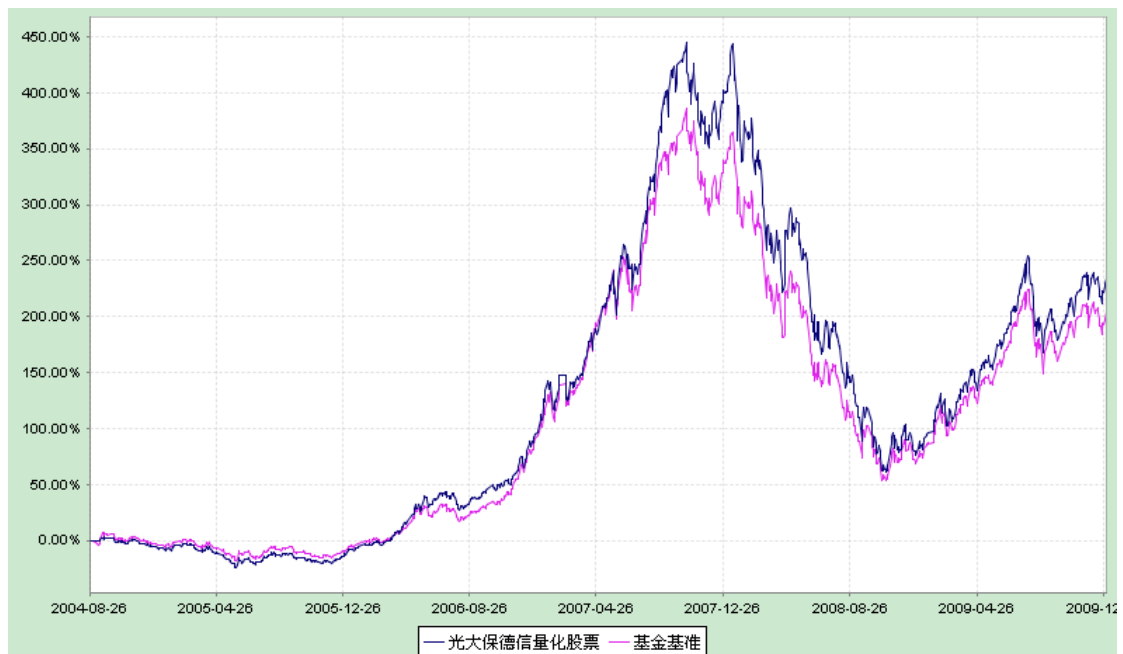
注：业绩比较基准收益率=90%×新华富时中国 A200 指数+10%×同业存款利率。新华富时中国 A200 指数是新华富时 A 股系列中的大盘可交易指数，包含按市值排名最大的 200 家 A 股公司，成份股采取分级靠档的加权方式，每年的 1 月、4 月、7 月、10 月进行成份股的审核。本基金每日对业绩比较基准进行再平衡，即每日均维持 90% 的新华富时中国 A200 指数比例及 10% 的同业存款比例。

#### 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

光大保德信量化核心证券投资基金

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

(2004 年 8 月 27 日至 2009 年 12 月 31 日)

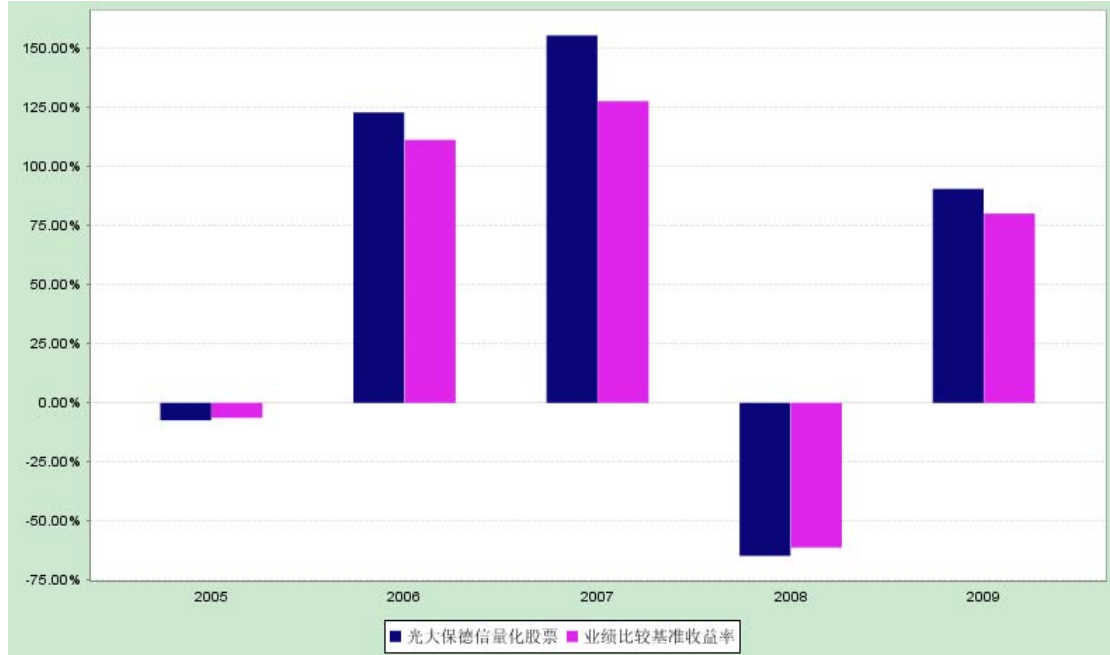


注：根据基金合同的规定，本基金建仓期为 2004 年 8 月 27 日至 2005 年 2 月 26 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

光大保德信量化核心证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2009年	-	-	-	-	
2008年	-	-	-	-	
2007年	1.000	198,131,157.67	239,587,002.71	437,718,160.38	
合计	1.000	198,131,157.67	239,587,002.71	437,718,160.38	

## §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 2009 年 12 月 31 日，光大保德信旗下管理着八只开放式基金，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和光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金。

#### 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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
袁宏隆	副总经理、首席投资总监兼本基金的基金经理	2007-06-26	-	24 年	袁宏隆先生，美国南卡罗莱纳国际商业研究硕士、台北淡江大学国际贸易学系学士，CFA，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，台湾获多利詹金宝投资顾问股份有限公司总经理，加拿大伦敦人寿保险公司权益证券投资部资深副总经理、常务董事，台北荷银证券投资信托股份有限公司执行副总裁、首席投资总监。

#### 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约定，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**

目前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“本基金”）、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“光大优势配置基金”）、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”）。本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；光大优势配置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的说明**

#### **4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

2009 年以来，中国股市出现了领先全球的复苏走势，甚至可以说是一次微型的牛市，因为全年的走势不仅是由政策和流动性推动，更重要的是，政策和流动性也推动了实体经济的 V 形复苏，所以，我们提到的复苏不仅仅是指的资本市场的复苏，也包涵更广义上的实体经济的复苏。所以整体估值水平也获得较大的提高，上证综指全年上涨幅度达到了 79.98%，而距 2008 年 10 月创出的历史低点 1664 点最大涨幅更是达到了 96.97%。

从 2008 年 11 月财政货币政策出台到目前，仅仅一年时间，A 股市场投资者对经济的预期就经历了“见底复苏——经济增长——二次探底——经济过热”四个阶段。浓缩型投资周期的特点显露无遗！

纵观全年，本基金在 2008 年末准确判断了宏观政策转向对经济和资本市场的刺激和推动作用，也抓住了主要宏观变量的分析脉络，在仓位配置和行业配置节奏上取得较好效果，全年获得较好的收益。

---

#### 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 90.61%，业绩比较基准收益率为 80.20%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

##### 1、宏观经济展望

在目前时点看 2010 年的经济和市场，我们认为重点关注的宏观变量应该是净出口，也就是外需。投资与消费两大要素在 2010 年的态势都相对清楚，市场一致预期 FAI 增速在 2010 年将显著下行，预计会从 2009 年的 34% 左右的增速下降到 24% 左右，不会给市场太大惊喜。而消费虽然在 2010 年还会保持较好增长，而且由于价格指数的转正，我们相信名义的消费增速会好于 2009 年显示持续增长的态势，但是如果考虑物价指数因素后的实际消费增速我们相信还是以平稳增长为主导态势，毕竟 2009 年 11 月的实际消费增速 17% 的表现已经是 10 年以来的月度最高值，所以消费在宏观的边际冲击也不会是主要变量。

相反的，由于净出口在 2009 年对于宏观整体是负贡献，2009 年的净出口负增长在 20% 左右，对 GDP 的负贡献预计也在 2.7 左右。而 2010 年，我们可以预见的是净出口不会再成为对宏观负贡献的因素，基于 2009 年的低基数效应，2010 年货物与服务净出口的相对贡献将归于正贡献，因此，净出口的恢复程度将成为在边际上对宏观贡献最大的变量，如果按照出口恢复 <2%、<15%、>15% 三种情景假设，我们将出口恢复划分为无法恢复、复苏、快速复苏三种情景，相应的，在无法恢复、复苏、快速复苏三种情景假设下，我们相信政府的刺激政策和货币政策会有不同的反应和表现，这样将导致资本市场会面临不同的变量冲击，也将导致我们在资本市场上的投资行为将依据不同的投资逻辑开展，因此，2010 年的市场投资最重要的是在整体大区间震荡的背景下如何选择投资方向。由于一切都只能拭目以待，所以投资上也只能相机抉择！

而更直观一点的眼光来观察的话，我们觉得 2009 年底政府对于房地产市场政策的变化已经属于政策“退出”的范畴，因此我们认为 2010 年对政策的研判也十分重要，2010 年恐怕将是一个政策博弈之年！

##### 2、证券市场展望

从目前市场的估值水平看，目前的沪深 300 指数对应 2009 年 PE21.6 倍，2010 年 PE16.8 倍，市场一致预期的净利润增长 2009 年在 22.22%，2010 年净利润增长 28.47%。我们对市场 2009 年的盈利预测与市场区别不大，我们认为在 22%—24% 之间的概率很大，而对于 2010 年的盈利预测增长目前略低于市场一致预期，在 25% 左右。但总体而言，A 股市场目前的估值水平基本合理，不便宜但是也不太贵。

---

此外，从常用的 A-H 股溢价指数来看，目前的 A-H 溢价水平在长期比较来看还是处于较低的水平，由于我们预期新兴市场整体仍旧面临资本流入的压力和资产价格泡沫的潜在压力，因此我们预期港股市场大幅下跌的概率和空间都很小，因此从 A-H 溢价指数看，目前 A 股指数的估值还是基本合理的，下行风险也不大。但是如果全球资金流向发生变化，资金外流出新兴市场将可能拖累港股市场资产价格下行，这也是整个新兴市场包括中国股市在 2010 年面临的潜在风险之一。

此外我们认为除了持续的首发大小非解禁压力之外，2010 年更多的压力恐怕来自于融资再融资的压力，我们初步给出了全年 5000-7000 亿的融资压力的测算与判断，所以可能的确给市场较大压力。而我们对 2010 年的流动性看法趋于谨慎，央行不可能无止尽无节制的投放货币信贷，从年末几个月的信贷增速来看，增速已经趋于平缓。由于 2009 年的高基数效应，我们分析，即使 2010 年新增信贷按照 7.5 万亿来推算，全年的信贷增速预计也就在 17.5%-18.5% 之间，相应的，M1、M2 都会渐次回落，M2 可能回落到 17% 左右。所以，我们认为，2010 年市场依靠主动信贷创造提供的内生流动性将趋于萎缩。

### 3、重点行业展望

2010 年预计“ $\beta$ ”贡献将小于“ $\alpha$ ”贡献，行业配置上，我们仍旧需要紧跟宏观变化，抓住主线政策，抓住美元走弱的阶段特点，适时由“资产+资源”主题切换中游行业；年初还可以捕捉送配主题和整体上市主题，整体上市我们认为有助于压低上市公司的高估值水平，这一点在美股 60-70 年代也发生过并一度成为市场主流风潮，对此我们不宜简单排斥；看好节能减排和低碳经济投资机会。从现在来看，由于货币政策的持续宽松，更重要的是美国货币政策的还将较长期宽松，我们面临的资产价格泡沫压力显而易见。货币政策转向将冲击盈利因素的贡献。

### 4、投资管理展望

总体而言，市场态势可能整体呈现“N”型走势，但前段的高点可能不会太高，因为流动性收缩将压制估值水平，而融资再融资的压力也将压制市场上涨空间，目前看上半年的融资压力还是比较大的。不过后期的转折仍可期待，而投资上我们需要特别关注外需的复苏程度，以应对市场新的动力、宏观上新的变量和政策变化，但如果外围二次探底的话，那么市场整体将更趋于平淡，全年维持大区间震荡态势，投资操作上需要谨慎。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在开展内部监察稽核工作时本着合规运作、防范风险、保障基金份额持有人利益的宗旨，由独立于各业务部门的督察长和监察稽核部对公司的经营管理、

---

基金的投资运作、基金的销售等公司所有业务及员工行为规范等方面进行定期和不定期检查，及时发现问题并督促相关部门进行整改，并定期制作监察稽核报告报中国证监会、董事会和公司管理层。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面：

督察长和监察稽核部督促、协助各业务部门按照法律法规和监管机构规定对相关制度的合法性、规范性和时效性完善各项内部管理制度和业务流程，明确风险控制职责并具体落实相应措施，提高全体员工的风险意识，有效保障基金份额持有人的利益。

督察长和监察稽核部针对各部门具体业务建立了相应的检查指标及检查重点，通过现场检查、电脑监控、人员询问、重点抽查等一系列方法，定期对公司和基金日常运作的各项业务进行合法合规检查，并对基金投资交易行为过程实施实时监控，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理，并按规定定期出具监察稽核报告报送监管机关、董事会和公司管理层。

根据中国证监会的规定，督察长和监察稽核部及时准确地向监管机关报送各项报告，并对公司所有对外信息，包括基金法定信息披露、基金产品宣传推介材料和媒体稿件等的合法合规情况进行事前审阅，确保其内容真实、准确、完整并符合中国证监会的相关规定。督察长和监察稽核部组织、协调各相关部门及时完成信息披露，确保公司的信息披露工作严格按照中国证监会规定的时间和方式进行。

在全公司范围内开展持续的学习和培训。督察长和监察稽核部先后组织了新员工入司培训，对相关人员进行法律法规的专项培训和年度监察培训，并组织员工开展学习、讨论，提高和加深了公司员工对基金法律法规的认识和理解，明确风险控制职责，树立全员内控意识。

根据董事会和管理层的要求，以及法规要求和公司业务发展的需要，督察长和监察稽核部以风险为导向，计划并实施了数个内部专项审计项目，及时发现潜在的问题和风险，促使公司规范运作，切实保障基金份额持有人的合法权益。

通过上述工作，在本报告期内，本基金管理人对本基金的管理始均按照法律法规、基金合同、招募说明书和公司制度进行，充分维护和保障了基金持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用资金资产，以风险控制为核心，进一步提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### **4.7 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、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。

#### **4.8 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。

---

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无

### §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

2009 年度，中国光大银行在光大保德信量化核心证券投资基金的托管过程中，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》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，依法安全托管了基金的全部资产，对光大保德信量化核心证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，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基金托管人所应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2009 年度，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》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人——光大保德信基金管理有限公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、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。该基金在运作中遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规的要求；各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际情况进行处理。

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

中国光大银行依法对基金管理人——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 2009 年年度报告”进行了复核，报告中相关财务指标、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是真实、准确。

### §6 审计报告

安永华明（2010）审字第 60467078\_B01 号

光大保德信量化核心证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的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”）

---

财务报表，包括 2009 年 12 月 31 日的资产负债表和 2009 年度利润表及所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

### 6.1 管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则的规定编制财务报表是光大量化核心基金的基金管理人光大保德信基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；（2）选择和运用恰当的会计政策；（3）作出合理的会计估计。

### 6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 审计意见

我们认为，光大量化核心基金财务报表已经按照企业会计准则的规定编制，在所有重大方面公允反映了光大量化核心基金 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 年度的经营成果和净值变动情况。

安永华明会计师事务所      中国注册会计师 徐 艳  
中国注册会计师 蒋燕华  
中国北京  
2010-03-26

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：光大保德信量化核心证券投资基金



报告截止日：2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	1,025,619,108.34	913,904,388.47
结算备付金		3,785,595.07	9,623,806.10
存出保证金		5,203,239.20	1,293,572.03
交易性金融资产	7.4.7.2	14,194,701,305.61	7,484,145,408.21
其中：股票投资		14,194,701,305.61	7,484,145,408.21
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	220,338.78	197,427.19
应收股利		-	-
应收申购款		181,843,071.71	1,216,792.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		15,411,372,658.71	8,410,381,394.75
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2009年12月31日</b>	<b>上年度末 2008年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	-
应付赎回款		26,136,144.33	54,305,822.52
应付管理人报酬		19,035,025.01	11,503,017.49
应付托管费		3,172,504.16	1,917,169.57
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	4,681,878.08	4,768,892.70
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,198,906.20	1,440,786.20
负债合计		54,224,457.78	73,935,688.48
<b>所有者权益：</b>			

实收基金	7.4.7.9	5,515,720,881.41	5,707,663,503.24
未分配利润	7.4.7.10	9,841,427,319.52	2,628,782,203.03
所有者权益合计		15,357,148,200.93	8,336,445,706.27
负债和所有者权益总计		15,411,372,658.71	8,410,381,394.75

注：报告截止日 2009 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0074 元，基金份额总额 15,243,723,121.55 份。

## 7.2 利润表

会计主体：光大保德信量化核心证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2009年1月1日至2009年12 月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12 月31日
<b>一、收入</b>		<b>8,078,065,356.38</b>	<b>-15,446,882,823.03</b>
1. 利息收入	7.4.7.11	7,388,950.87	11,828,562.81
其中：存款利息收入		7,388,950.87	11,828,562.81
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-778,639,821.76	-5,143,254,364.25
其中：股票投资收益	7.4.7.12.1	-897,503,354.83	-5,299,288,371.21
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	7.4.7.13	118,863,533.07	156,034,006.96
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	8,842,474,164.55	-10,322,682,530.65
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	6,842,062.72	7,225,509.06
<b>减：二、费用</b>		<b>279,398,850.78</b>	<b>315,398,658.36</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	198,395,082.62	229,127,065.66

2. 托管费	7. 4. 10. 2. 2	33,065,847.03	38,187,844.22
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7. 4. 7. 16	47,547,081.33	47,595,587.32
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7. 4. 7. 17	390,839.80	488,161.16
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>7,798,666,505.60</b>	<b>-15,762,281,481.39</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		<b>7,798,666,505.60</b>	<b>-15,762,281,481.39</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：光大保德信量化核心证券投资基金

本报告期：2009年1月1日至2009年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31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）	5,707,663,503.24	2,628,782,203.03	8,336,445,706.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,798,666,505.60	7,798,666,505.60
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）	-191,942,621.83	-586,021,389.11	-777,964,010.94
其中：1. 基金申购款	2,737,703,439.26	3,384,758,723.08	6,122,462,162.34
2. 基金赎回款	-2,929,646,061.09	-3,970,780,112.19	-6,900,426,173.28
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）	5,515,720,881.41	9,841,427,319.52	15,357,148,200.93
项目	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31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）	6,872,728,393.23	21,606,216,767.91	28,478,945,161.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-15,762,281,481.39	-15,762,281,481.39
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）	-1,165,064,889.99	-3,215,153,083.49	-4,380,217,973.48
其中：1. 基金申购款	932,598,187.84	816,867,879.44	1,749,466,067.28
2. 基金赎回款	-2,097,663,077.83	-4,032,020,962.93	-6,129,684,040.76
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）	-	-	-

号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	5,707,663,503.24	2,628,782,203.03	8,336,445,706.27

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码(序号)从 7.1 至 7.4, 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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(以下简称“中国证监会”)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股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括在国内依法公开发行上市的股票、法律法规及证监会允许基金投资的其他金融工具。其中股票投资对象重点为基本面良好且具有持续增长潜力, 股价处于合理区间的优质股票。本基金的资产配置基准比例为: 股票 90%, 浮动范围为 85%-95%; 现金 10%, 浮动范围为 5%-15%。本基金的业绩比较基准为 90%\*新华富时中国 A200 指数+10%\*同业存款利率。

2007 年 5 月 8 日, 本基金管理人光大保德信基金管理有限公司对本基金进行了基金份额拆分。拆分后基金份额面值为人民币 0.3618 元。

### 7.4.2 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。

---

### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2009 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。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资和衍生工具（主要系权证投资）；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或

---

金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (2) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

配股权证及由股权分置改革而被动获得的权证，在确认日记录所获分配的权证数量，该等权证初始成本为零；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (3) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

---

(4) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

**7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则**

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。存在活跃市场的金融资产或金融负债以活跃市场中的报价确定公允价值。不存在活跃市场的金融资产或金融负债采用估值技术确定公允价值。采用估值技术得出的结果反映估值日在公平交易中可能采用的交易价格。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。本基金以上述原则确定的公允价值进行估值，本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 股票投资

(1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价格；

(2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

C. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成

---

本时，按中国证监会相关规定处理。

## 2) 权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价格；

(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

## 3) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额



---

转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### **7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(3) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(4) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(5) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(6) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

(1) 基金收益分配的比例按有关规定制定；

(2) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，本基金默认的收益分配方式是现金分红。投资人可选择现金红利或按红利发放日经除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；

---

(3) 在符合基金分配条件的前提下，基金收益分配每年至少一次，但若基金成立不满 3 个月，收益可不分配，年度分配在基金会计年度结束后的 4 个月内完成；

(4) 基金当年收益须先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；

(5) 如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

(6) 每一基金份额享有同等收益分配权；

(7) 红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用由基金份额持有人自行承担；

(8) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；

(9) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### **7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计**

本年度本基金无其他重要的会计政策和会计估计。

#### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本年度本基金无会计政策变更。

##### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本年度本基金无会计估计变更。

##### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本年度本基金无差错更正事项。

#### **7.4.6 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
活期存款	1,025,619,108.34	913,904,388.47
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计	1,025,619,108.34	913,904,388.47

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		14,125,019,833.14	14,194,701,305.61	69,681,472.47
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		14,125,019,833.14	14,194,701,305.61	69,681,472.47
项目		上年度末 2008年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		16,256,938,100.29	7,484,145,408.21	-8,772,792,692.08
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		16,256,938,100.29	7,484,145,408.21	-8,772,792,692.08

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末和上年度末均无衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本期末和上年度末均无买入返售金融资产。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
应收活期存款利息	215,262.81	192,662.91
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	1,325.00	4,330.70
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	3,610.97	208.58
其他	140.00	225.00
合计	220,338.78	197,427.19

#### 7.4.7.6 其他资产

本期末和上年度末均无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
交易所市场应付交易费用	4,681,878.08	4,768,892.70
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	4,681,878.08	4,768,892.70

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
应付券商交易单元保证金	750,000.00	750,000.00
应付赎回费	48,906.20	200,786.20
预提审计费	100,000.00	150,000.00
预提信息披露费	300,000.00	340,000.00
合计	1,198,906.20	1,440,786.20

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	15,774,224,341.51	5,707,663,503.24
本期申购	7,566,187,516.15	2,737,703,439.26
本期赎回（以“-”号填列）	-8,096,688,736.11	-2,929,646,061.09
本期末	15,243,723,121.55	5,515,720,881.41

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 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	3,090,835,709.40	-462,053,506.37	2,628,782,203.03
本期利润	-1,043,807,658.95	8,842,474,164.55	7,798,666,505.60
本期基金份额交易产生的变动数	-84,064,767.72	-501,956,621.39	-586,021,389.11
其中：基金申购款	775,959,013.62	2,608,799,709.46	3,384,758,723.08
基金赎回款	-860,023,781.34	-3,110,756,330.85	-3,970,780,112.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,962,963,282.73	7,878,464,036.79	9,841,427,319.52

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31 日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31 日
活期存款利息收入	7,103,937.72	11,705,245.68
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	167,603.75	97,053.65
其他	117,409.40	26,263.48
合计	7,388,950.87	11,828,562.81

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 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日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
卖出股票成交总额	16,088,333,008.83	10,239,697,380.79
减：卖出股票成本总额	16,985,836,363.66	15,538,985,752.00
买卖股票差价收入	-897,503,354.83	-5,299,288,371.21

#### 7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31 日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31 日
股票投资产生的股利收益	118,863,533.07	156,034,006.96
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	118,863,533.07	156,034,006.96

#### 7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2009年1月1日至2009年12月31 日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31 日
1. 交易性金融资产	8,842,474,164.55	-10,322,682,530.65
——股票投资	8,842,474,164.55	-10,322,682,530.65
——债券投资	-	-
——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	8,842,474,164.55	-10,322,682,530.65

#### 7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日
基金赎回费收入	6,414,415.24	6,341,509.69
转换费收入	427,647.48	757,726.52
印花税返还	-	126,272.85
合计	6,842,062.72	7,225,509.06

#### 7.4.7.16 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日
交易所市场交易费用	47,547,081.33	47,595,587.32
银行间市场交易费用	-	-
合计	47,547,081.33	47,595,587.32

#### 7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日
审计费用	100,000.00	150,000.00
信息披露费	280,000.00	320,000.00
银行费用	-	-
其他费用	-	-
账户维护费	10,500.00	18,000.00
银行间债券账户维护费	-	-
其他	339.80	161.16
合计	390,839.80	488,161.16

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

本基金无或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金于资产负债表日之后、年度报告批准报出日之前批准、公告或实施的利润分配的情况如下：

序号	权益	除息日	每 10 份	现金形式	再投资形式	利润分配	备
----	----	-----	--------	------	-------	------	---

	登记日		基金份额分红数	发放总额	发放总额	合计	注
1	2010-01-04	2010-01-04	0.300	232,454,993.74	224,402,613.04	456,857,606.78	-

除以上情况外，无其他需要说明的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

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
中国光大银行股份有限公司	基金托管人、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
光大证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
光大阳光2号集合资产管理计划	基金管理人的股东所管理的集合理财产品

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年12月31日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31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	13,760,426,543.60	44.82%	6,274,294,138.32	36.52%

##### 7.4.10.1.2 权证交易

本期和上年度可比期间均未与关联方进行权证交易。

##### 7.4.10.1.3 债券交易

本期和上年度可比期间均未与关联方进行债券交易。

##### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本期和上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

##### 7.4.10.1.5 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日至2009年12月31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	11,494,781.43	44.75%	2,149,245.61	45.91%
关联方名称	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31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	5,188,274.46	36.01%	1,771,476.95	37.15%

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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31 日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	198,395,082.62	229,127,065.66
其中：支付销售机构的客户维护费	36,281,500.11	44,311,422.98

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

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,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个工作日内从基金财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。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31 日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	33,065,847.03	38,187,844.22

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,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个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期和上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金的基金管理人 2009 年度及 2008 年度均未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.4.2 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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2009年12月31日		上年度末 2008年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
阳光2号	-	-	16,933,107.54	0.11%

注:光大阳光2号集合资产管理计划在本报告期内赎回本基金16,933,107.54份,赎回费65,725.86元,全部按照招募说明书公示费率收费。

#### 7.4.10.5 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 2009年1月1日至2009年12月31日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
光大银行	1,025,619,108.34	7,103,937.72	913,904,388.47	11,705,245.68

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金 2009 年度及 2008 年度均不存在在承销期内直接购入关联方所承销证券的情况。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金 2009 年度未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末(2009年12月31日)本基金持有的流通受限证券

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

截至本报告期末 2009 年 12 月 31 日止,本基金未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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	备注
000709	唐钢股份	2009-12-16	吸收合并	7.09	2010-01-25	6.60	14,937,478	105,906,719.02	105,906,719.02	-
600423	柳化股份	2009-11-27	重大事项公告	14.17	2010-01-04	13.61	12,820,105	167,805,601.33	181,660,887.85	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2009 年 12 月 31 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2009 年 12 月 31 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

#### **7.4.13.2 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同责任,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;本基金不能投资于债券资产,因此在债券资产投资方面不存在信用风险。

#### **7.4.13.3 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。

本基金所持证券在证券交易所上市,因此除 7.4.12 中所列示的因暂时停牌而流通受限的股票外,其他均能及时变现。

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。

#### **7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 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、存出保证金等。本基金通过监控组合货币久期来评估基金面临的利率风险。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2009年12 月31日	1个月以内	1-3 个月	6个月 以内	3个月 -1年	6个 月-1 年	1年 以内	1-5 年	5年 以上	不计息	合计
资产										
银行存款	1,025,619,108.34	-	-	-	-	-	-	-	-	1,025,619,108.34
结算备付金	3,785,595.07	-	-	-	-	-	-	-	-	3,785,595.07
存出保证金	400,000.00	-	-	-	-	-	-	-	4,803,239.20	5,203,239.20
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	14,194,701,305.61	14,194,701,305.61
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	220,338.78	220,338.78
应收申购款	181,843,071.71	-	-	-	-	-	-	-	-	181,843,071.71
资产总计	1,211,647,775.12	-	-	-	-	-	-	-	14,199,724,883.59	15,411,372,658.71
负债										
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	26,136,144.33	26,136,144.33
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	19,035,025.01	19,035,025.01
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	3,172,504.16	3,172,504.16
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	4,681,878.08	4,681,878.08
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	1,198,906.20	1,198,906.20
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	54,224,457.78	54,224,457.78
利率敏感度缺口	1,211,647,775.12	-	-	-	-	-	-	-	14,145,500,425.81	15,357,148,200.93
上年度末 2008年12 月31日	1个月以内	1-3 个月	6个月 以内	3个月 -1年	6个 月-1 年	1年 以内	1-5 年	5年 以上	不计息	合计
资产										

银行存款	913,904,388.47	-	-	-	-	-	-	-	-	913,904,388.47
结算备付金	9,623,806.10	-	-	-	-	-	-	-	-	9,623,806.10
存出保证金	500,000.00	-	-	-	-	-	-	-	793,572.03	1,293,572.03
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	7,484,145,408.21	7,484,145,408.21
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	197,427.19	197,427.19
应收申购款	1,216,792.75	-	-	-	-	-	-	-	-	1,216,792.75
资产总计	925,244,987.32	-	-	-	-	-	-	-	7,485,136,407.43	8,410,381,394.75
负债										
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	54,305,822.52	54,305,822.52
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	11,503,017.49	11,503,017.49
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	1,917,169.57	1,917,169.57
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	4,768,892.70	4,768,892.70
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	1,440,786.20	1,440,786.20
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	73,935,688.48	73,935,688.48
利率敏感度缺口	925,244,987.32	-	-	-	-	-	-	-	7,411,200,718.95	8,336,445,706.27

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本年末未持有债券，因此无重大利率风险。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 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的股票，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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31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	14,194,701,305.61	92.43	7,484,145,408.21	89.78
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	14,194,701,305.61	92.43	7,484,145,408.21	89.78

#### 7.4.13.4.3.2 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其过去一年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：人民币元）	
		本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
	业绩基准净值增加1%	增加15,920.22万元	增加8,973.30万元
业绩基准净值减少1%	减少15,920.22万元	减少8,973.30万元	

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。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金无其他说明事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	14,194,701,305.61	92.11
	其中：股票	14,194,701,305.61	92.11
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-

	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	1,029,404,703.41	6.68
6	其他各项资产	187,266,649.69	1.22
7	合计	15,411,372,658.71	100.00

### 8.2 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	793,953,381.89	5.17
C	制造业	5,540,671,180.99	36.08
C0	食品、饮料	177,281,467.70	1.15
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	88,640,041.20	0.58
C4	石油、化学、塑胶、塑料	1,316,551,018.67	8.57
C5	电子	182,962,204.75	1.19
C6	金属、非金属	2,129,392,881.23	13.87
C7	机械、设备、仪表	1,026,580,871.40	6.68
C8	医药、生物制品	619,262,696.04	4.03
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	62,999,414.10	0.41
F	交通运输、仓储业	1,293,755,558.05	8.42
G	信息技术业	275,634,578.18	1.79
H	批发和零售贸易	942,012,162.17	6.13
I	金融、保险业	5,200,765,636.73	33.87
J	房地产业	84,909,393.50	0.55
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	14,194,701,305.61	92.43

### 8.3 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	601601	中国太保	26,064,969	667,784,505.78	4.35



2	000060	中金岭南	23,075,697	643,811,946.30	4.19
3	600016	民生银行	78,626,141	621,932,775.31	4.05
4	600497	驰宏锌锗	19,994,240	528,847,648.00	3.44
5	600009	上海机场	27,345,996	476,367,250.32	3.10
6	600029	南方航空	78,033,155	472,880,919.30	3.08
7	600036	招商银行	24,853,420	448,604,231.00	2.92
8	000001	深发展 A	17,926,380	436,865,880.60	2.84
9	000792	盐湖钾肥	7,566,158	431,195,344.42	2.81
10	601939	建设银行	68,137,014	421,768,116.66	2.75
11	600331	宏达股份	22,378,961	404,611,614.88	2.63
12	600030	中信证券	12,637,315	401,487,497.55	2.61
13	601398	工商银行	73,744,012	401,167,425.28	2.61
14	002024	苏宁电器	18,999,824	394,816,342.72	2.57
15	600015	华夏银行	29,015,592	360,373,652.64	2.35
16	601628	中国人寿	10,859,383	344,133,847.27	2.24
17	000960	锡业股份	10,928,819	337,044,777.96	2.19
18	600000	浦发银行	13,615,474	295,319,631.06	1.92
19	601318	中国平安	4,875,708	268,602,753.72	1.75
20	600690	青岛海尔	10,642,706	263,832,681.74	1.72
21	600019	宝钢股份	26,909,787	259,948,542.42	1.69
22	600050	中国联通	35,436,842	258,334,578.18	1.68
23	601328	交通银行	25,139,584	235,055,110.40	1.53
24	600361	华联综超	23,360,730	223,562,186.10	1.46
25	600423	柳化股份	12,820,105	181,660,887.85	1.18
26	000825	太钢不锈	18,196,984	173,599,227.36	1.13
27	601988	中国银行	39,999,959	173,199,822.47	1.13
28	000425	徐工机械	4,474,841	157,156,415.92	1.02
29	600720	祁连山	8,265,434	142,992,008.20	0.93
30	000501	鄂武商 A	9,289,825	138,046,799.50	0.90
31	600005	武钢股份	16,287,813	134,863,091.64	0.88
32	600096	云天化	5,553,460	133,671,782.20	0.87
33	600123	兰花科创	2,999,856	131,213,701.44	0.85
34	600261	浙江阳光	7,000,000	129,430,000.00	0.84
35	600521	华海药业	4,950,242	128,706,292.00	0.84
36	601919	中国远洋	8,971,492	124,703,738.80	0.81
37	601166	兴业银行	3,087,829	124,470,386.99	0.81
38	000680	山推股份	9,799,893	124,066,645.38	0.81
39	600176	中国玻纤	5,858,903	109,444,308.04	0.71
40	000709	唐钢股份	14,937,478	105,906,719.02	0.69
41	600062	双鹤药业	4,092,038	96,367,494.90	0.63
42	000338	潍柴动力	1,425,489	91,915,530.72	0.60

43	000895	双汇发展	1,713,437	90,983,504.70	0.59
44	000927	一汽夏利	7,584,647	90,257,299.30	0.59
45	000488	晨鸣纸业	10,355,145	88,640,041.20	0.58
46	600801	华新水泥	3,690,970	87,660,537.50	0.57
47	000402	金融街	6,999,950	84,909,393.50	0.55
48	000513	丽珠集团	2,143,749	84,871,022.91	0.55
49	000717	韶钢松山	12,594,527	84,257,385.63	0.55
50	000898	鞍钢股份	5,131,882	82,110,112.00	0.53
51	600741	华域汽车	6,993,444	80,984,081.52	0.53
52	000157	中联重科	3,099,863	80,627,436.63	0.53
53	000999	三九医药	3,999,949	79,838,982.04	0.52
54	000401	冀东水泥	3,999,924	77,198,533.20	0.50
55	600825	新华传媒	5,998,920	70,607,288.40	0.46
56	601001	大同煤业	1,544,255	69,476,032.45	0.45
57	600535	天士力	2,999,833	67,196,259.20	0.44
58	000528	柳工	2,999,926	65,188,391.98	0.42
59	601666	平煤股份	2,000,000	64,000,000.00	0.42
60	601390	中国中铁	9,999,907	62,999,414.10	0.41
61	600664	哈药股份	3,303,725	61,019,800.75	0.40
62	000900	现代投资	1,999,994	59,979,820.06	0.39
63	000564	西安民生	7,999,938	58,879,543.68	0.38
64	600026	中海发展	4,011,234	57,561,207.90	0.37
65	000417	合肥百货	3,824,131	56,100,001.77	0.37
66	000912	泸天化	5,299,913	55,967,081.28	0.36
67	000869	张裕A	718,751	54,639,451.02	0.36
68	000016	深康佳A	6,961,275	53,532,204.75	0.35
69	000089	深圳机场	6,000,357	45,062,681.07	0.29
70	600713	南京医药	4,634,957	44,773,684.62	0.29
71	600031	三一重工	1,149,241	42,303,561.21	0.28
72	000028	一致药业	1,329,457	36,799,369.76	0.24
73	000858	五粮液	999,953	31,658,511.98	0.21
74	600761	安徽合力	2,128,700	30,248,827.00	0.20
75	600012	皖通高速	4,999,990	29,699,940.60	0.19
76	600035	楚天高速	5,000,000	27,500,000.00	0.18
77	600201	金宇集团	2,021,539	19,689,789.86	0.13
78	600122	宏图高科	1,000,000	17,300,000.00	0.11
79	000937	金牛能源	10,000	416,000.00	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	000002	万 科 A	1,109,548,911.22	13.31
2	600331	宏达股份	895,553,699.88	10.74
3	600030	中信证券	878,710,403.93	10.54
4	601601	中国太保	672,080,732.62	8.06
5	000060	中金岭南	558,955,776.69	6.70
6	600050	中国联通	540,574,323.16	6.48
7	600029	南方航空	519,752,806.31	6.23
8	000960	锡业股份	489,905,153.86	5.88
9	000402	金 融 街	475,570,385.48	5.70
10	000792	盐湖钾肥	467,061,680.21	5.60
11	601318	中国平安	461,778,522.56	5.54
12	600497	驰宏锌锗	451,557,822.75	5.42
13	601398	工商银行	431,016,404.76	5.17
14	002024	苏宁电器	291,407,336.54	3.50
15	600016	民生银行	276,138,625.15	3.31
16	601919	中国远洋	230,744,185.25	2.77
17	601328	交通银行	229,346,302.27	2.75
18	600361	华联综超	221,107,293.15	2.65
19	000937	冀中能源	212,111,769.19	2.54
20	600585	海螺水泥	207,607,781.35	2.49
21	600096	云天化	202,318,524.13	2.43
22	600816	安信信托	199,265,625.03	2.39
23	600690	青岛海尔	190,658,445.91	2.29
24	600036	招商银行	186,273,194.29	2.23
25	601939	建设银行	186,062,954.40	2.23
26	601988	中国银行	182,750,452.31	2.19
27	600720	祁连山	172,744,818.15	2.07

#### 8.4.2 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	000002	万 科 A	1,684,243,120.98	20.20
2	600050	中国联通	907,015,221.88	10.88
3	600030	中信证券	808,874,481.10	9.70
4	600331	宏达股份	755,007,820.17	9.06
5	000937	冀中能源	628,173,065.04	7.54
6	000960	锡业股份	602,494,006.59	7.23
7	600028	中国石化	589,298,668.06	7.07

8	000060	中金岭南	572,735,832.38	6.87
9	601398	工商银行	544,136,784.98	6.53
10	600997	开滦股份	534,290,640.17	6.41
11	000402	金融街	529,720,778.18	6.35
12	601628	中国人寿	418,166,169.20	5.02
13	601318	中国平安	405,880,432.25	4.87
14	000024	招商地产	330,829,605.88	3.97
15	000858	五粮液	317,387,140.90	3.81
16	600674	川投能源	297,052,240.87	3.56
17	601328	交通银行	291,663,559.03	3.50
18	601601	中国太保	286,167,208.63	3.43
19	601166	兴业银行	272,981,691.43	3.27
20	000001	深发展A	245,379,767.88	2.94
21	600312	平高电气	244,909,514.57	2.94
22	600585	海螺水泥	243,112,002.42	2.92
23	601939	建设银行	223,556,366.79	2.68
24	601919	中国远洋	218,573,875.31	2.62
25	600383	金地集团	208,814,810.50	2.50
26	600690	青岛海尔	207,175,362.10	2.49
27	600591	*ST上航	195,135,156.94	2.34
28	600816	安信信托	188,191,907.57	2.26
29	000667	名流置业	169,442,556.31	2.03

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	14,853,918,096.51
卖出股票的收入（成交）总额	16,088,333,008.83

注：8.4.1项“买入金额”、8.4.2项“卖出金额”及8.4.3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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-

7	其他	-	-
8	合计	-	-

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 投资组合报告附注

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

**8.9.2** 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。

#### 8.9.3 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	5,203,239.20
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	220,338.78
5	应收申购款	181,843,071.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	187,266,649.69

#### 8.9.4 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。

#### 8.9.5 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。

#### 8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告期内本基金未投资控股股东主承销的证券，未从二级市场投资分离交易可转债附送的权证，投资流通受限证券未违反相关法规或本基金管理公司的规定。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
772,743	19,726.77	1,522,811,438.17	9.99%	13,720,911,683.38	90.01%

### 9.2 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	3,079,435.08	0.0202%

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2004年8月27日)基金份额总额	2,544,287,215.94
本报告期期初基金份额总额	15,774,224,341.51
本报告期期间基金总申购份额	7,566,187,516.15
减：本报告期期间基金总赎回份额	8,096,688,736.11
本报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	15,243,723,121.55

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所情况。报告年度应支付给聘任安永华明会计师事务所的报酬为 10 万元,目前该审计机构已提供审计服务的连续年限为 5

年。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券	2	13,760,426,543.60	44.82%	11,494,781.43	44.75%	-
中金公司	1	2,086,248,619.09	6.80%	1,773,304.94	6.90%	-
中银国际	1	2,589,841,132.36	8.44%	2,201,358.58	8.57%	-
申银万国	1	1,135,612,232.71	3.70%	965,266.73	3.76%	-
平安证券	1	1,673,530,739.19	5.45%	1,359,755.93	5.29%	-
银河证券	2	5,329,121,773.63	17.36%	4,387,432.16	17.08%	-
安信证券	1	1,243,144,071.00	4.05%	1,056,669.52	4.11%	-
高华证券	1	899,208,811.66	2.93%	764,320.93	2.98%	-
中信建投	1	1,699,596,997.75	5.54%	1,444,648.69	5.62%	-
民族证券	1	282,448,477.21	0.92%	240,080.33	0.93%	-

#### (1) 新增租用交易单元

本报告期内本基金新增租用 2 个交易单元，分别是中信建投和民族证券。

(2) 停止租用：本基金报告期内无停止租用交易单元情况。

(3) 专用交易单元的选择标准和程序

#### A. 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。

#### B. 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 A 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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本报告期内本基金未通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

### 11.8 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旗下光大保德信量化核心证券投资基金的分红预告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2009-12-29
2	光大保德信基金管理有限公司关于旗下基金新增广发华福证券有限责任公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2009-12-25
3	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金在广东发展银行股份有限公司开展网上银行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》	2009-12-16
4	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国建设银行网上银行等电子渠道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》	2009-12-08
5	光大保德信基金管理有限公司关于旗下基金新增信达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》	2009-11-19
6	光大保德信量化核心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》	2009-09-30
7	光大保德信基金管理有限公司关于旗下基金参与创业板投资及相关风险揭示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2009-09-25
8	光大保德信基金管理有限公司关于在山西证券股份有限公司开办旗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》	2009-09-25
9	光大保德信基金管理有限公司关于旗下基金新增天相投资顾问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》	2009-08-29
10	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中信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》	2009-07-29



11	光大保德信基金管理有限公司关于调整通过中国光大银行定期定额投资旗下基金最低扣款金额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2009-07-08
12	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》	2009-06-09
13	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》	2009-06-09
14	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》	2009-06-06
15	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》	2009-06-05
16	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》	2009-05-22
17	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》	2009-05-08
18	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》	2009-05-08
19	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》	2009-04-28
20	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》	2009-04-25
21	光大保德信量化核心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》	2009-04-10
22	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》	2009-03-30
23	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》	2009-03-16
24	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》	2009-03-13
25	光大保德信基金管理有限公司关于通过交	《中国证券报》、《上	2009-02-25

	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	海证券报》、《证券时报》	
26	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》	2009-02-12
27	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》	2009-02-07
28	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》	2009-02-06
29	光大保德信基金管理有限公司关于旗下基金新增深圳平安银行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》	2009-01-17
30	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》	2009-01-14
31	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》	2009-01-09
32	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》	2009-01-05

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

无

## §13 备查文件目录

### 13.1 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、 光大保德信量化核心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

---

### **13.2 存放地点**

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网网站 [www.epf.com.cn](http://www.epf.com.cn)，光大保德信基金管理有限公司客服电话：400-820-2888 或 021-53524620。

### **13.3 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

二〇一〇年三月二十九日