

光大保德信优势配置股票型证券投资基金

2012 第二季度报告

基金管理人:光大保德信基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年七月二十日

4.1 基金经理 或基金经理小组简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明. Lists fund managers like 周炜坤 and 周炜坤.

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
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...

4.3 公平交易专项说明
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...

4.3.2 异常交易行为的专项说明
本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金与其他投资组合未发生交易所公开竞价同日反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
二季度,本基金管理人认为市场系统性风险在2011年已经充分释放,在市场调整过程中加大估值更加合理的成长性股票的投资...

4.4.2 报告期内基金业绩表现说明
本基金本报告期基金份额净值增长率为2.36%,业绩比较基准收益率为0.52%。
本基金管理人认为,随着稳增长政策效应逐步显现,非银行上市公司的盈利也会在四季度开始改善,从而成为政策预期和流动性改善驱动下,下一阶段重要的股市领涨因素...

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望2012年下半年,本基金管理人认为通胀也会从相对高位持续回落,货币政策在下半年还有继续放松的空间,前期宽松的稳增长政策效应也会在下半年在实体经济上产生效果,通过投资带动,使中国经济在下半年阶段性的企稳企稳,非银行上市公司的盈利也会在四季度开始改善,从而成为政策预期和流动性改善驱动下,下一阶段重要的股市领涨因素...

4.6 投资组合报告
4.6.1 报告期末基金资产组合情况
序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.6.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table with columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.6.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.6.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细
序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.6.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.6.6 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

4.6.7 开放式基金份额变动
单位:份

Table with columns: 项目, 光大保德信优势配置股票基金, 光大保德信优势配置股票基金

4.6.8 本报告期末基金份额总额
13,482,525.14521份

4.6.9 本报告期末基金份额持有人户数
1,259,400户

4.6.10 本报告期末基金份额持有人户数
1,259,400户

4.6.11 本报告期末基金份额持有人户数
1,259,400户

4.6.12 本报告期末基金份额持有人户数
1,259,400户

4.6.13 本报告期末基金份额持有人户数
1,259,400户

4.6.14 本报告期末基金份额持有人户数
1,259,400户

4.6.15 本报告期末基金份额持有人户数
1,259,400户

4.6.16 本报告期末基金份额持有人户数
1,259,400户

4.6.17 本报告期末基金份额持有人户数
1,259,400户

4.6.18 本报告期末基金份额持有人户数
1,259,400户

4.6.19 本报告期末基金份额持有人户数
1,259,400户

4.6.20 本报告期末基金份额持有人户数
1,259,400户

4.6.21 本报告期末基金份额持有人户数
1,259,400户

4.6.22 本报告期末基金份额持有人户数
1,259,400户

4.6.23 本报告期末基金份额持有人户数
1,259,400户

4.6.24 本报告期末基金份额持有人户数
1,259,400户

4.6.25 本报告期末基金份额持有人户数
1,259,400户

4.6.26 本报告期末基金份额持有人户数
1,259,400户

4.6.27 本报告期末基金份额持有人户数
1,259,400户

4.6.28 本报告期末基金份额持有人户数
1,259,400户

4.6.29 本报告期末基金份额持有人户数
1,259,400户

4.6.30 本报告期末基金份额持有人户数
1,259,400户

4.6.31 本报告期末基金份额持有人户数
1,259,400户

4.6.32 本报告期末基金份额持有人户数
1,259,400户

4.6.33 本报告期末基金份额持有人户数
1,259,400户

4.6.34 本报告期末基金份额持有人户数
1,259,400户

4.6.35 本报告期末基金份额持有人户数
1,259,400户

4.6.36 本报告期末基金份额持有人户数
1,259,400户

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2012年4月1日至2012年6月30日)

1.本期已实现收益 -388,282.410.58
2.本期利润 202,227.265.68
3.加权平均基金份额本期利润 0.0149
4.期末基金资产净值 8,469,234,926.80
5.期末基金份额净值 0.6282

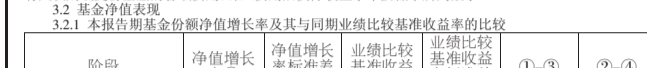
注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准差②, 业绩比较基准差③, 业绩比较基准差④, ①-③, ②-④

过去三个月 2.36% 0.99% 0.52% 0.84% 1.84% 0.15%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



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。

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2012年4月1日至2012年6月30日)

1.本期已实现收益 -388,282.410.58
2.本期利润 202,227.265.68
3.加权平均基金份额本期利润 0.0149
4.期末基金资产净值 8,469,234,926.80
5.期末基金份额净值 0.6282

注: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。上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。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准差②, 业绩比较基准差③, 业绩比较基准差④, ①-③, ②-④

过去三个月 2.36% 0.99% 0.52% 0.84% 1.84% 0.15%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



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。

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2012年4月1日至2012年6月30日)

1.本期已实现收益 -388,282.410.58
2.本期利润 202,227.265.68
3.加权平均基金份额本期利润 0.0149
4.期末基金资产净值 8,469,234,926.80
5.期末基金份额净值 0.6282

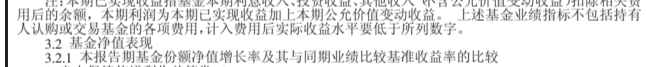
注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准差②, 业绩比较基准差③, 业绩比较基准差④, ①-③, ②-④

过去三个月 2.36% 0.99% 0.52% 0.84% 1.84% 0.15%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



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。

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2012年4月1日至2012年6月30日)

1.本期已实现收益 -388,282.410.58
2.本期利润 202,227.265.68
3.加权平均基金份额本期利润 0.0149
4.期末基金资产净值 8,469,234,926.80
5.期末基金份额净值 0.6282

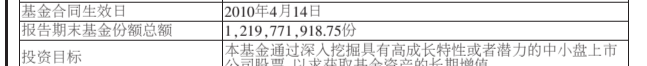
注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准差②, 业绩比较基准差③, 业绩比较基准差④, ①-③, ②-④

过去三个月 2.36% 0.99% 0.52% 0.84% 1.84% 0.15%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



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。

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2012年4月1日至2012年6月30日)

1.本期已实现收益 -388,282.410.58
2.本期利润 202,227.265.68
3.加权平均基金份额本期利润 0.0149
4.期末基金资产净值 8,469,234,926.80
5.期末基金份额净值 0.6282

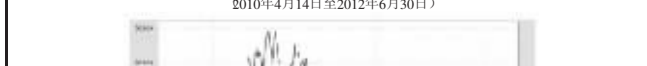
注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准差②, 业绩比较基准差③, 业绩比较基准差④, ①-③, ②-④

过去三个月 2.36% 0.99% 0.52% 0.84% 1.84% 0.15%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



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。

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2012年4月1日至2012年6月30日)

1.本期已实现收益 -388,282.410.58
2.本期利润 202,227.265.68
3.加权平均基金份额本期利润 0.0149
4.期末基金资产净值 8,469,234,926.80
5.期末基金份额净值 0.6282

注: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。上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。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准差②, 业绩比较基准差③, 业绩比较基准差④, ①-③, ②-④

过去三个月 2.36% 0.99% 0.52% 0.84% 1.84% 0.15%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



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。

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2012年4月1日至2012年6月30日)

1.本期已实现收益 -388,282.410.58
2.本期利润 202,227.265.68
3.加权平均基金份额本期利润 0.0149
4.期末基金资产净值 8,469,234,926.80
5.期末基金份额净值 0.6282

注: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。上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。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准差②, 业绩比较基准差③, 业绩比较基准差④, ①-③, ②-④

过去三个月 2.36% 0.99% 0.52% 0.84% 1.84% 0.15%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



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。

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2012年4月1日至2012年6月30日)

1.本期已实现收益 -388,282.410.58
2.本期利润 202,227.265.68
3.加权平均基金份额本期利润 0.0149
4.期末基金资产净值 8,469,234,926.80
5.期末基金份额净值 0.6282

注: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。上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。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准差②, 业绩比较基准差③, 业绩比较基准差④, ①-③, ②-④

过去三个月 2.36% 0.99% 0.52% 0.84% 1.84% 0.15%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



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。

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2012年4月1日至2012年6月30日)

1.本期已实现收益 -388,282.410.58
2.本期利润 202,227.265.68
3.加权平均基金份额本期利润 0.0149
4.期末基金资产净值 8,469,234,926.80
5.期末基金份额净值 0.6282

注: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。上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。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准差②, 业绩比较基准差③, 业绩比较基准差④, ①-③, ②-④

过去三个月 2.36% 0.99% 0.52% 0.84% 1.84% 0.15%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



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。

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2012年4月1日至2012年6月30日)

1.本期已实现收益 -388,282.410.58
2.本期利润 202,227.265.68
3.加权平均基金份额本期利润 0.0149
4.期末基金资产净值 8,469,234,926.80
5.期末基金份额净值 0.6282

注: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。上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。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准差②, 业绩比较基准差③, 业绩比较基准差④, ①-③, ②-④

过去三个月 2.36% 0.99% 0.52% 0.84% 1.84% 0.15%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



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。

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2012年4月1日至2012年6月30日)

1.本期已实现收益 -388,282.410.58
2.本期利润 202,227.265.68
3.加权平均基金份额本期利润 0.0149
4.期末基金资产净值 8,469,234,926.80
5.期末基金份额净值 0.6282

注: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。上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。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准差②, 业绩比较基准差③, 业绩比较基准差④, ①-③, ②-④

过去三个月 2.36% 0.99% 0.52% 0.84% 1.84% 0.15%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



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。

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2012年4月1日至2012年6月30日)

1.本期已实现收益 -388,282.410.58
2.本期利润 202,227.265.68
3.加权平均基金份额本期利润 0.0149
4.期末基金资产净值 8,469,234,926.80
5.期末基金份额净值 0.6282

注: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。上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。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准