

# 光大保德信优势配置股票型证券投资基金

## [2015] 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:招商银行股份有限公司  
报告送出日期:二〇一五年七月二十日

§ 1 重要提示

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、完整性和及时性承担个别连带责任。

基金托管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、完整性和及时性承担个别连带责任。

基金合同由基金管理人和基金托管人订立，基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。

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。

本报告期内基金资产净值经审计。

报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

### § 2 基金产品概况

|            |                   |
|------------|-------------------|
| 基金简称       | 光大保德信优势配置股票       |
| 基金主代码      | 360007            |
| 基金次级代码     | 360007            |
| 基金合同生效方式   | 契约型开放式            |
| 基金合同生效日    | 2007年8月12日        |
| 报告期末基金份额总额 | 3,611,698,298.88份 |

投资目标

本基金通过精选个股的行业配置，通过科技股投资获取基金价值增长的收益，同时在供应链上游环节中寻找具有核心竞争力的优质企业，从而在长期持有后获得稳定的收益。

投资策略

本基金将主要投资于具有良好成长性的股票，同时关注于估值较低的股票，以期在长期持有后获得稳定的收益。

业绩比较基准

75%×沪深300指数+25%×中证全指金融

风险收益特征

本基金为股票型基金，风险较高。本基金在科学的风险管理的前提下，追求实现基金财产的安全和增值。

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

| 主要财务指标         | 报告期(2015年4月1日至2015年6月30日) |
|----------------|---------------------------|
| 1.本期已实现收益      | 2,443,503,531.08          |
| 2.本期利润         | 1,269,681,489.44          |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.32583                   |
| 4.期末基金资产净值     | 5,113,070,225.58          |
| 5.期末基金份额净值     | 1.04157                   |

注:本期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)减去相关费用后的余额，本期利润为期初至报告期末利润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，费用影响实际收益水平可能要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本期报告期内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 净值增长(①) 净值增长率差(②) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 14.30% 2.88% 8.73% 1.96% 5.57% 0.52%

注:为更好地反映本基金的业绩特征,本报告期将净值增长率与同期业绩比较基准收益率“75%×沪深300指数+25%×中证全指金融”的几何平均数“1.04157”作为业绩比较基准。

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比如图

(2007年8月24日至2015年6月30日)



注:为更好地反映本基金的业绩特征,本报告期将净值增长率与同期业绩比较基准收益率“75%×沪深300指数+25%×中证全指金融”的几何平均数“1.04157”作为业绩比较基准。

3.2.3 基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比如图

(2007年8月24日至2015年6月30日)

注:为更好地反映本基金的业绩特征,本报告期将净值增长率与同期业绩比较基准收益率“75%×沪深300指数+25%×中证全指金融”的几何平均数“1.04157”作为业绩比较基准。

3.2.4 基金合同生效以来基金各项资产配置比例

3.2.5 管理人报告

4.1 基金经理或基金经理助理简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

| 姓名  | 职务         | 任本基金的基金经理期限 | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|------------|-------------|--------|-----|
| 于进杰 | 研究部总监、基金经理 | 2014-08-02  | -      | 10年 |

于进杰先生, CFA, 经济学硕士, 华东理工大学工商管理学院金融工程专业, 2007年7月至2014年6月任国投瑞银基金管理有限公司研究员, 2006年6月加入光大保德信基金管理有限公司, 历任投资研究员、高级研究员, 现任光大保德信基金管理有限公司基金经理, 光大保德信股票型基金基金经理, 光大保德信优势配置基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司期内, 基金管理人遵守严谨、规范的基金管理, 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 公平交易制度的执行情况

为充分保护基金持有人的利益, 确保基金管理人旗下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, 本基金管理人研究设计、投研制度设计、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方面出发, 建设公平交易制度, 并严格执行, 本报告期, 本公司未发现不公平交易的情况。

4.4 公平交易制度的执行情况

本公司期内, 所有投资组合在公平交易方面均未发生不公平交易的情况。

4.5 管理人对报告期内基金投资组合的重大关联交易的说明

本公司期内未发生重大关联交易。

4.6 管理人对报告期内基金投资组合的偏离度说明

本公司期内所有股票类资产的偏离度始终在±1.5%以内。

4.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人运用固有资金投资本基金不存在关联交易。

4.8 报告期内基金投资组合的偏离度情况的说明

本公司期内未发生偏离度情况。

4.9 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

宏观经济、政策、制度、市场环境等变化导致本基金的资产配置比例与基金合同约定的比例有所偏离。

4.10 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.11 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.12 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.13 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.14 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.15 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.16 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.17 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.18 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.19 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.20 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.21 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.22 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.23 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.24 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.25 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.26 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.27 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.28 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.29 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.30 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.31 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.32 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.33 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.34 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.35 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.36 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.37 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.38 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.39 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.40 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.41 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.42 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.43 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.44 报告期内基金投资组合的偏离度和分析

本公司期内未发生偏离度情况。

4.45 报告期内基金投资组合的偏离度和分析