

光大保德信优势配置股票证券投资基金 2009年半年度报告摘要

2009年6月30日

基金管理人:光大保德信基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司

重要提示
本基金管理人及基金托管人不存在虚假记载、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法律责任。

2.1 基金基本情况
基金名称:光大保德信优势配置股票
交易代码:360007
基金运作方式:契约型开放式

2.2 基金业绩
投资目标:本基金追求绝对收益的基金,强调在有效控制证券市场和中国经济发展方向的基础上,通过科学合理的资产配置,实现超越业绩比较基准的回报。

2.3 基金管理人及基金托管人
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

2.4 信息披露方式
信息披露网址:www.ebf.com.cn
基金半年度报告备置地点:光大保德信基金管理有限公司、招商银行股份有限公司

3.1 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 报告期 (09年1月1日至2009年6月30日) and 报告期末基金净值总额 (18,011,186,361.15元)

Table with 2 columns: 报告期 (09年1月1日至2009年6月30日) and 报告期末基金净值 (18,011,186,361.15元)

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;2. 本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益扣除相关费用后的余额。

3.2 基金投资组合

Table with 5 columns: 阶段, 份额净值增长率, 业绩比较基准收益率, ①-③, ②-④

注:根据基金合同的约定,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基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

4 基金管理人及基金托管人

4.1 基金管理人及其基本情况
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组建。

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期间, 证券从业年限, 说明

4.2 基金托管人及其基本情况
招商银行股份有限公司(以下简称“招商”)是经中国银监会批准,于2002年10月8日正式开业的全国性股份制商业银行。

4.3 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资团队、交易团队支持等各方面得到公平对待。

4.4 基金管理人内部控制制度的完善性说明
本基金管理人建立了完善的风险管理体系,包括风险管理委员会、风险管理部、风险管理部等。

4.5 基金管理人内部控制制度的完善性说明
本基金管理人建立了完善的内部控制制度,包括内部控制委员会、内部控制部、内部控制部等。

4.6 基金管理人内部控制制度的完善性说明
本基金管理人建立了完善的内部控制制度,包括内部控制委员会、内部控制部、内部控制部等。

4.7 基金管理人内部控制制度的完善性说明
本基金管理人建立了完善的内部控制制度,包括内部控制委员会、内部控制部、内部控制部等。

4.8 基金管理人内部控制制度的完善性说明
本基金管理人建立了完善的内部控制制度,包括内部控制委员会、内部控制部、内部控制部等。

4.9 基金管理人内部控制制度的完善性说明
本基金管理人建立了完善的内部控制制度,包括内部控制委员会、内部控制部、内部控制部等。

4.10 基金管理人内部控制制度的完善性说明
本基金管理人建立了完善的内部控制制度,包括内部控制委员会、内部控制部、内部控制部等。

4.11 基金管理人内部控制制度的完善性说明
本基金管理人建立了完善的内部控制制度,包括内部控制委员会、内部控制部、内部控制部等。

4.12 基金管理人内部控制制度的完善性说明
本基金管理人建立了完善的内部控制制度,包括内部控制委员会、内部控制部、内部控制部等。

4.13 基金管理人内部控制制度的完善性说明
本基金管理人建立了完善的内部控制制度,包括内部控制委员会、内部控制部、内部控制部等。

4.14 基金管理人内部控制制度的完善性说明
本基金管理人建立了完善的内部控制制度,包括内部控制委员会、内部控制部、内部控制部等。

4.15 基金管理人内部控制制度的完善性说明
本基金管理人建立了完善的内部控制制度,包括内部控制委员会、内部控制部、内部控制部等。

托管人:审计师、行业、监管机构沟通值调整事项;监察稽核部就估值程序的合法合规发表意见;投资者数量小组负责审核估值政策调整对估值、投资、资产、投资风险和风险评估的影响;IT部就估值政策调整的技术实现提供技术支持。

5 托管人报告
报告期内,本基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

6 半年度财务会计报告(未经审计)
6.1 资产负债表
单位:人民币元

Table with 4 columns: 资产, 附注号, 2009年6月30日, 2008年12月31日

6.2 利润表
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 2009年6月30日, 2008年12月31日

6.3 所有者权益(净资产)变动表
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 2009年6月30日, 2008年12月31日

6.4 现金流量表
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 2009年6月30日, 2008年12月31日

6.5 所有者权益(净资产)变动表
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 2009年6月30日, 2008年12月31日

6.6 资产负债表
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 2009年6月30日, 2008年12月31日

6.7 利润表
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 2009年6月30日, 2008年12月31日

6.8 所有者权益(净资产)变动表
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 2009年6月30日, 2008年12月31日

6.9 现金流量表
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 2009年6月30日, 2008年12月31日

6.10 所有者权益(净资产)变动表
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 2009年6月30日, 2008年12月31日

6.11 资产负债表
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 2009年6月30日, 2008年12月31日

6.12 利润表
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 2009年6月30日, 2008年12月31日

6.13 所有者权益(净资产)变动表
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 2009年6月30日, 2008年12月31日

6.14 现金流量表
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 2009年6月30日, 2008年12月31日

6.15 所有者权益(净资产)变动表
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 2009年6月30日, 2008年12月31日

6.16 资产负债表
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 2009年6月30日, 2008年12月31日

6.17 利润表
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 2009年6月30日, 2008年12月31日

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
6.4.8 本报告期末及上年度末已到期而未展期的关联方交易
6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

Table with 4 columns: 关联方名称, 2009年1月1日至2009年6月30日, 2008年1月1日至2008年6月30日

6.4.8.1.1 股票交易
单位:人民币元

Table with 4 columns: 关联方名称, 2009年1月1日至2009年6月30日, 2008年1月1日至2008年6月30日

6.4.8.1.2 债券交易
单位:人民币元

Table with 4 columns: 关联方名称, 2009年1月1日至2009年6月30日, 2008年1月1日至2008年6月30日

6.4.8.1.3 债券回购交易
单位:人民币元

Table with 4 columns: 关联方名称, 2009年1月1日至2009年6月30日, 2008年1月1日至2008年6月30日

注:上述关联交易均按照正常商业条款进行,扣除证券承销和佣金(包括但不限于:经手费、证券清算费用)和上海证券交易所“经手费”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经纪和融资融券服务。

6.4.8.2 关联方管理
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 2009年1月1日至2009年6月30日, 2008年1月1日至2008年6月30日

注:1. 本基金管理费按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提。计算方法如下:
H=0.0150%\*前一日基金资产净值

2. 本基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提。计算方法如下:
H=0.0025%\*前一日基金资产净值

3. 本基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
H=0.0025%\*前一日基金资产净值

4. 本基金赎回费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
H=0.0025%\*前一日基金资产净值

5. 本基金申购费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
H=0.0025%\*前一日基金资产净值

6. 本基金赎回费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
H=0.0025%\*前一日基金资产净值

7. 本基金申购费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
H=0.0025%\*前一日基金资产净值

8. 本基金赎回费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
H=0.0025%\*前一日基金资产净值

9. 本基金申购费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
H=0.0025%\*前一日基金资产净值

10. 本基金赎回费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
H=0.0025%\*前一日基金资产净值

11. 本基金申购费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
H=0.0025%\*前一日基金资产净值

12. 本基金赎回费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
H=0.0025%\*前一日基金资产净值

13. 本基金申购费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
H=0.0025%\*前一日基金资产净值

14. 本基金赎回费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
H=0.0025%\*前一日基金资产净值

15. 本基金申购费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
H=0.0025%\*前一日基金资产净值

16. 本基金赎回费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
H=0.0025%\*前一日基金资产净值

17. 本基金申购费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
H=0.0025%\*前一日基金资产净值

18. 本基金赎回费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
H=0.0025%\*前一日基金资产净值

19. 本基金申购费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
H=0.0025%\*前一日基金资产净值

20. 本基金赎回费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
H=0.0025%\*前一日基金资产净值

21. 本基金申购费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
H=0.0025%\*前一日基金资产净值

22. 本基金赎回费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
H=0.0025%\*前一日基金资产净值

23. 本基金申购费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
H=0.0025%\*前一日基金资产净值

24. 本基金赎回费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
H=0.0025%\*前一日基金资产净值

25. 本基金申购费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
H=0.0025%\*前一日基金资产净值

26. 本基金赎回费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
H=0.0025%\*前一日基金资产净值

27. 本基金申购费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
H=0.0025%\*前一日基金资产净值

28. 本基金赎回费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
H=0.0025%\*前一日基金资产净值

29. 本基金申购费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
H=0.0025%\*前一日基金资产净值

30. 本基金赎回费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
H=0.0025%\*前一日基金资产净值

31. 本基金申购费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
H=0.0025%\*前一日基金资产净值

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)