

长信基金管理有限责任公司

基金管理人:长信基金管理有限责任公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2009年10月28日

§1 重要提示

基金管理人及基金托管人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。
基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2009年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合信息等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

Table with 2 columns: 基金名称 (长信恒利优势股票), 代码 (519887), 基金运作方式 (契约型开放式), 基金合同生效日 (2009年07月30日), 报告期末基金份额总额 (984,485,380.44)

投资目标:把握宏观经济及产业发展趋势和市场价格,力争在行业轮动和产业结构调整的过程中,重点投资受益于行业增长和具有品质优势的个股,力争获取基金资产的长期稳定增值。

投资策略:本基金采用自上而下与自下而上相结合的投资策略。自上而下:通过宏观经济、行业景气度、政策环境、估值水平等因素,判断未来市场整体运行趋势,并在此基础上进行资产配置。

业绩比较基准:沪深300指数\*70%+上证国债指数\*30%
风险收益特征:本基金为股票型基金,属于证券投资基金中较高风险和较高收益的证券投资基金品种,其预期风险和收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。

基金管理人:长信基金管理有限责任公司
基金托管人:招商银行股份有限公司

注:本基金基金合同于2009年7月30日正式生效,截至2009年9月30日本基金尚处于封闭期。

§3 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期 (2009年07月30日至2009年09月30日), 单位:人民币元

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.本基金申购费、赎回费、基金转换费等费用,按照基金合同及招募说明书的相关规定执行。

Table with 2 columns: 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, 业绩比较基准标准差④, ①-③, ②-④

注:1.图示日期为2009年7月30日至2009年9月30日,本基金运作时间未满一年。
2.按基金合同规定,本基金自合同生效之日起6个月内为建仓期,建仓期结束时,本基金的各项投资比例应符合基金合同关于投资组合比例、资产配置比例和投资限制的有关规定。

§4 基金经理 顾剑峰 简介

姓名:顾剑峰 职务:基金经理 任职日期:2009年07月30日 离任日期:无 证券从业年限:16年

说明:顾剑峰先生,经济学博士,证券从业经历16年。曾就职于上海浦东发展银行,担任信贷部副经理、信贷管理部副经理、信贷管理部副经理、信贷管理部副经理等职务。2009年7月加入长信基金管理有限责任公司,担任长信恒利优势股票型证券投资基金基金经理。

注:1.基金经理任职日期以本基金基金成立之日为准。
2.基金经理从入职以来担任本基金基金经理的工作经历为时间累计计算。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明
本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,不存在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
本报告期间,公司严格执行公平交易制度,并建立公平交易制度体系,已建立投资决策体系,加强交易执行环节的内部控制,并建立公平交易制度,确保执行公平交易制度的原则。同时,公司已通过投资交易行为的监控、分析和评估,并在此基础上对公平交易过程进行监督。

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
本报告期间,公司管理的各基金之间不存在投资风格相似的投资组合;公司没有管理的投资风格相似的不同投资组合之间的业绩差异超过5%之情形。

4.3.3 异常交易行为的专项说明
本报告期间,未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
截止2009年9月30日,本基金净值为0.872元,本报告期内本基金净值增长率为-12.8%,同期业绩比较基准涨幅为-10.64%。

4.2 2009年三季度市场回顾和基金运作分析
如预期所示,三季度市场上涨了很多人预期的,三季度中的快速调整同样超出了大家预期。其中8月份单月的跌幅甚至超过了1997年10月单月的跌幅,前期市场快速上涨,前期市场快速下跌,前期市场快速下跌,前期市场快速下跌。

4.3 2009年四季度市场展望和投资策略
对于09年四季度的市场展望,我们认为,全球经济数据无论环比还是环比都是全面好转,企业盈利情况能有效恢复,宏观经济企稳,流动性充裕,市场估值处于低位,这些都将为市场带来利好。同时,我们预计四季度市场仍将保持震荡上行态势,但涨幅有限,建议投资者在震荡中把握机会,同时,继续关注医药、银行、保险等板块投资机会。

§5 投资组合报告

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

注:1.图示日期为2009年7月30日至2009年9月30日,本基金运作时间未满一年。
2.按基金合同规定,本基金自合同生效之日起6个月内为建仓期,建仓期结束时,本基金的各项投资比例应符合基金合同关于投资组合比例、资产配置比例和投资限制的有关规定。

§3 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期 (2009年07月01日至2009年09月30日), 单位:人民币元

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.本基金申购费、赎回费、基金转换费等费用,按照基金合同及招募说明书的相关规定执行。

Table with 2 columns: 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, 业绩比较基准标准差④, ①-③, ②-④

注:1.图示日期为2006年7月1日至2009年9月30日。
2.按基金合同规定,本基金自合同生效之日起6个月内为建仓期,建仓期结束时,本基金的各项投资比例应符合基金合同关于投资组合比例、资产配置比例和投资限制的有关规定。

§4 基金经理 顾剑峰 简介

姓名:顾剑峰 职务:基金经理 任职日期:2009年07月30日 离任日期:无 证券从业年限:16年

说明:顾剑峰先生,经济学博士,证券从业经历16年。曾就职于上海浦东发展银行,担任信贷部副经理、信贷管理部副经理、信贷管理部副经理、信贷管理部副经理等职务。2009年7月加入长信基金管理有限责任公司,担任长信恒利优势股票型证券投资基金基金经理。

注:1.基金经理任职日期以本基金基金成立之日为准。
2.基金经理从入职以来担任本基金基金经理的工作经历为时间累计计算。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明
本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,不存在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
本报告期间,公司严格执行公平交易制度,并建立公平交易制度体系,已建立投资决策体系,加强交易执行环节的内部控制,并建立公平交易制度,确保执行公平交易制度的原则。同时,公司已通过投资交易行为的监控、分析和评估,并在此基础上对公平交易过程进行监督。

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
本报告期间,公司管理的各基金之间不存在投资风格相似的投资组合;公司没有管理的投资风格相似的不同投资组合之间的业绩差异超过5%之情形。

4.3.3 异常交易行为的专项说明
本报告期间,未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
截止2009年9月30日,本基金净值为0.872元,本报告期内本基金净值增长率为-12.8%,同期业绩比较基准涨幅为-10.64%。

长信恒利优势股票型证券投资基金

2009 第三季度报告

2009年9月30日

§4 管理报告

4.1 基金经理 顾剑峰 简介
姓名:顾剑峰 职务:基金经理 任职日期:2009年07月30日 离任日期:无 证券从业年限:16年

说明:顾剑峰先生,经济学博士,证券从业经历16年。曾就职于上海浦东发展银行,担任信贷部副经理、信贷管理部副经理、信贷管理部副经理、信贷管理部副经理等职务。2009年7月加入长信基金管理有限责任公司,担任长信恒利优势股票型证券投资基金基金经理。

注:1.基金经理任职日期以本基金基金成立之日为准。
2.基金经理从入职以来担任本基金基金经理的工作经历为时间累计计算。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明
本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,不存在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
本报告期间,公司严格执行公平交易制度,并建立公平交易制度体系,已建立投资决策体系,加强交易执行环节的内部控制,并建立公平交易制度,确保执行公平交易制度的原则。同时,公司已通过投资交易行为的监控、分析和评估,并在此基础上对公平交易过程进行监督。

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
本报告期间,公司管理的各基金之间不存在投资风格相似的投资组合;公司没有管理的投资风格相似的不同投资组合之间的业绩差异超过5%之情形。

4.3.3 异常交易行为的专项说明
本报告期间,未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
截止2009年9月30日,本基金净值为0.872元,本报告期内本基金净值增长率为-12.8%,同期业绩比较基准涨幅为-10.64%。

4.2 2009年三季度市场回顾和基金运作分析
如预期所示,三季度市场上涨了很多人预期的,三季度中的快速调整同样超出了大家预期。其中8月份单月的跌幅甚至超过了1997年10月单月的跌幅,前期市场快速上涨,前期市场快速下跌,前期市场快速下跌,前期市场快速下跌。

4.3 2009年四季度市场展望和投资策略
对于09年四季度的市场展望,我们认为,全球经济数据无论环比还是环比都是全面好转,企业盈利情况能有效恢复,宏观经济企稳,流动性充裕,市场估值处于低位,这些都将为市场带来利好。同时,我们预计四季度市场仍将保持震荡上行态势,但涨幅有限,建议投资者在震荡中把握机会,同时,继续关注医药、银行、保险等板块投资机会。

§5 投资组合报告

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

注:1.图示日期为2009年7月30日至2009年9月30日,本基金运作时间未满一年。
2.按基金合同规定,本基金自合同生效之日起6个月内为建仓期,建仓期结束时,本基金的各项投资比例应符合基金合同关于投资组合比例、资产配置比例和投资限制的有关规定。

§3 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期 (2009年07月01日至2009年09月30日), 单位:人民币元

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.本基金申购费、赎回费、基金转换费等费用,按照基金合同及招募说明书的相关规定执行。

Table with 2 columns: 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, 业绩比较基准标准差④, ①-③, ②-④

注:1.图示日期为2006年7月1日至2009年9月30日。
2.按基金合同规定,本基金自合同生效之日起6个月内为建仓期,建仓期结束时,本基金的各项投资比例应符合基金合同关于投资组合比例、资产配置比例和投资限制的有关规定。

§4 基金经理 顾剑峰 简介

姓名:顾剑峰 职务:基金经理 任职日期:2009年07月30日 离任日期:无 证券从业年限:16年

说明:顾剑峰先生,经济学博士,证券从业经历16年。曾就职于上海浦东发展银行,担任信贷部副经理、信贷管理部副经理、信贷管理部副经理、信贷管理部副经理等职务。2009年7月加入长信基金管理有限责任公司,担任长信恒利优势股票型证券投资基金基金经理。

注:1.基金经理任职日期以本基金基金成立之日为准。
2.基金经理从入职以来担任本基金基金经理的工作经历为时间累计计算。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明
本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,不存在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
本报告期间,公司严格执行公平交易制度,并建立公平交易制度体系,已建立投资决策体系,加强交易执行环节的内部控制,并建立公平交易制度,确保执行公平交易制度的原则。同时,公司已通过投资交易行为的监控、分析和评估,并在此基础上对公平交易过程进行监督。

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
本报告期间,公司管理的各基金之间不存在投资风格相似的投资组合;公司没有管理的投资风格相似的不同投资组合之间的业绩差异超过5%之情形。

4.3.3 异常交易行为的专项说明
本报告期间,未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
截止2009年9月30日,本基金净值为0.872元,本报告期内本基金净值增长率为-12.8%,同期业绩比较基准涨幅为-10.64%。

4.2 2009年三季度市场回顾和基金运作分析
如预期所示,三季度市场上涨了很多人预期的,三季度中的快速调整同样超出了大家预期。其中8月份单月的跌幅甚至超过了1997年10月单月的跌幅,前期市场快速上涨,前期市场快速下跌,前期市场快速下跌,前期市场快速下跌。

4.3 2009年四季度市场展望和投资策略
对于09年四季度的市场展望,我们认为,全球经济数据无论环比还是环比都是全面好转,企业盈利情况能有效恢复,宏观经济企稳,流动性充裕,市场估值处于低位,这些都将为市场带来利好。同时,我们预计四季度市场仍将保持震荡上行态势,但涨幅有限,建议投资者在震荡中把握机会,同时,继续关注医药、银行、保险等板块投资机会。

§5 投资组合报告

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

注:1.图示日期为2009年7月30日至2009年9月30日,本基金运作时间未满一年。
2.按基金合同规定,本基金自合同生效之日起6个月内为建仓期,建仓期结束时,本基金的各项投资比例应符合基金合同关于投资组合比例、资产配置比例和投资限制的有关规定。

§3 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期 (2009年07月01日至2009年09月30日), 单位:人民币元

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.本基金申购费、赎回费、基金转换费等费用,按照基金合同及招募说明书的相关规定执行。

Table with 2 columns: 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, 业绩比较基准标准差④, ①-③, ②-④

注:1.图示日期为2006年7月1日至2009年9月30日。
2.按基金合同规定,本基金自合同生效之日起6个月内为建仓期,建仓期结束时,本基金的各项投资比例应符合基金合同关于投资组合比例、资产配置比例和投资限制的有关规定。

§4 基金经理 顾剑峰 简介

姓名:顾剑峰 职务:基金经理 任职日期:2009年07月30日 离任日期:无 证券从业年限:16年

说明:顾剑峰先生,经济学博士,证券从业经历16年。曾就职于上海浦东发展银行,担任信贷部副经理、信贷管理部副经理、信贷管理部副经理、信贷管理部副经理等职务。2009年7月加入长信基金管理有限责任公司,担任长信恒利优势股票型证券投资基金基金经理。

Table with 2 columns: 其中:买入式回购的买入返售金融资产, 146,065,767.57, 16.81

Table with 2 columns: 6 其他资产, 220,383.56, 0.03

Table with 2 columns: 7 合计, 872,538,285.64, 100.00

§2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

§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

Table with 5 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 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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

§7 备查文件目录

- 1.中国证监会批准设立基金的文件;
2.《长信恒利优势股票型证券投资基金基金合同》;
3.《长信恒利优势股票型证券投资基金招募说明书》;
4.《长信恒利优势股票型证券投资基金托管协议》;
5.报告期内指定网站上披露的基金公告的原文;
6.长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资料批露文件;
7.2.2 存放地点:基金管理人住所;
7.3 查阅方式:长信基金管理有限责任公司网站: http://www.cxfund.com.cn.

§4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

§5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 5 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(%)

§6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 报告期末基金份额总额, 984,485,380.44

§7 备查文件目录

- 1.中国证监会批准设立基金的文件;
2.《长信增利动态策略股票型证券投资基金基金合同》;
3.《长信增利动态策略股票型证券投资基金招募说明书》;
4.《长信增利动态策略股票型证券投资基金托管协议》;
5.报告期内指定网站上披露的基金公告的原文;
6.长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资料批露文件;
7.2.2 存放地点:基金管理人住所;
7.3 查阅方式:长信基金管理有限责任公司网站: http://www.cxfund.com.cn.

§4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

§5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 5 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(%)

§6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 报告期末基金份额总额, 5,011,568,133.77

§7 备查文件目录

- 1.中国证监会批准设立基金的文件;
2.《光大保德信优势配置股票型证券投资基金基金合同》;
3.《光大保德信优势配置股票型证券投资基金招募说明书》;
4.《光大保德信优势配置股票型证券投资基金托管协议》;
5.报告期内指定网站上披露的基金公告的原文;
6.光大保德信优势配置股票型证券投资基金法律意见书;
7.2.2 存放地点:基金管理人住所;
7.3 查阅方式:光大保德信优势配置股票型证券投资基金网站: http://www.evgfunds.com.cn.

§8 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

Table with 5 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(%)

§9 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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

§7 备查文件目录

- 1.中国证监会批准设立基金的文件;
2.《光大保德信优势配置股票型证券投资基金基金合同》;
3.《光大保德信优势配置股票型证券投资基金招募说明书》;
4.《光大保德信优势配置股票型证券投资基金托管协议》;
5.报告期内指定网站上披露的基金公告的原文;
6.光大保德信优势配置股票型证券投资基金法律意见书;
7.2.2 存放地点:基金管理人住所;
7.3 查阅方式:光大保德信优势配置股票型证券投资基金网站: http://www.evgfunds.com.cn.

长信增利动态策略股票型证券投资基金

2009 第三季度报告

2009年9月30日

§4 管理报告

4.1 基金经理 顾剑峰 简介
姓名:顾剑峰 职务:基金经理 任职日期:2009年07月30日 离任日期:无 证券从业年限:16年

说明:顾剑峰先生,经济学博士,证券从业经历16年。曾就职于上海浦东发展银行,担任信贷部副经理、信贷管理部副经理、信贷管理部副经理、信贷管理部副经理等职务。2009年7月加入长信基金管理有限责任公司,担任长信增利动态策略股票型证券投资基金基金经理。

注:1.基金经理任职日期以本基金基金成立之日为准。
2.基金经理从入职以来担任本基金基金经理的工作经历为时间累计计算。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明
本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,不存在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
本报告期间,公司严格执行公平交易制度,并建立公平交易制度体系,已建立投资决策体系,加强交易执行环节的内部控制,并建立公平交易制度,确保执行公平交易制度的原则。同时,公司已通过投资交易行为的监控、分析和评估,并在此基础上对公平交易过程进行监督。

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
本报告期间,公司管理的各基金之间不存在投资风格相似的投资组合;公司没有管理的投资风格相似的不同投资组合之间的业绩差异超过5%之情形。

4.3.3 异常交易行为的专项说明
本报告期间,未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
截止2009年9月30日,本基金净值为2.0486元,本报告期内本基金净值增长率为-7.36%,同期业绩比较基准涨幅为-3.19%。

4.2 2009年三季度市场回顾和基金运作分析
如预期所示,三季度市场上涨了很多人预期的,三季度中的快速调整同样超出了大家预期。其中8月份单月的跌幅甚至超过了1997年10月单月的跌幅,前期市场快速上涨,前期市场快速下跌,前期市场快速下跌,前期市场快速下跌。

4.3 2009年四季度市场展望和投资策略
对于09年四季度的市场展望,我们认为,全球经济数据无论环比还是环比都是全面好转,企业盈利情况能有效恢复,宏观经济企稳,流动性充裕,市场估值处于低位,这些都将为市场带来利好。同时,我们预计四季度市场仍将保持震荡上行态势,但涨幅有限,建议投资者在震荡中把握机会,同时,继续关注医药、银行、保险等板块投资机会。

§5 投资组合报告

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

注:1.图示日期为2006年7月1日至2009年9月30日。
2.按基金合同规定,本基金自合同生效之日起6个月内为建仓期,建仓期结束时,本基金的各项投资比例应符合基金合同关于投资组合比例、资产配置比例和投资限制的有关规定。

§3 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期 (2009年07月01日至2009年09月30日), 单位:人民币元

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.本基金申购费、赎回费、基金转换费等费用,按照基金合同及招募说明书的相关规定执行。

Table with 2 columns: 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, 业绩比较基准标准差④, ①-③, ②-④

注:1.图示日期为2006年7月1日至2009年9月30日。
2.按基金合同规定,本基金自合同生效之日起6个月内为建仓期,建仓期结束时,本基金的各项投资比例应符合基金合同关于投资组合比例、资产配置比例和投资限制的有关规定。

§4 基金经理 顾剑峰 简介

姓名:顾剑峰 职务:基金经理 任职日期:2009年07月30日 离任日期:无 证券从业年限:16年

说明:顾剑峰先生,经济学博士,证券从业经历16年。曾就职于上海浦东发展银行,担任信贷部副经理、信贷管理部副经理、信贷管理部副经理、信贷管理部副经理等职务。2009年7月加入长信基金管理有限责任公司,担任长信增利动态策略股票型证券投资基金基金经理。

注:1.基金经理任职日期以本基金基金成立之日为准。
2.基金经理从入职以来担任本基金基金经理的工作经历为时间累计计算。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明
本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,不存在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
本报告期间,公司严格执行公平交易制度,并建立公平交易制度体系,已建立投资决策体系,加强交易执行环节的内部控制,并建立公平交易制度,确保执行公平交易制度的原则。同时,公司已通过投资交易行为的监控、分析和评估,并在此基础上对公平交易过程进行监督。

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
本报告期间,公司管理的各基金之间不存在投资风格相似的投资组合;公司没有管理的投资风格相似的不同投资组合之间的业绩差异超过5%之情形。

4.3.3 异常交易行为的专项说明
本报告期间,未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
截止2009年9月30日,本基金净值为2.0486元,本报告期内本基金净值增长率为-7.36%,同期业绩比较基准涨幅为-3.19%。

光大保德信优势配置股票型证券投资基金

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:二〇〇九年十月二十八日

§1 重要提示

基金管理人及基金托管人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。
基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2009年10月27日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合信息等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

Table with 2 columns: 基金名称 (光大保德信优势配置股票), 代码 (519887), 基金运作方式 (契约型开放式), 基金合同生效日 (2009年8月24日), 报告期末基金份额总额 (17,458,398.268)

投资目标:本基金追求投资回报的长期,在严格控制风险的基础上,根据证券市场的变化进行行业配置,通过科学的投资策略力争获取超越业绩比较基准的长期稳定增值。

投资策略:本基金采用自上而下与自下而上相结合的投资策略。自上而下:通过宏观经济、行业景气度、政策环境、估值水平等因素,判断未来市场整体运行趋势,并在此基础上进行资产配置。

业绩比较基准:75%\*沪深300指数+25%\*上证国债指数
风险收益特征:本基金为股票型基金,属于证券投资基金中较高风险和较高收益的证券投资基金品种,其预期风险和收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。

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

注:本基金基金合同于2009年8月24日正式生效,截至2009年9月30日本基金尚处于封闭期。

§3 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期 (2009年07月01日至2009年09月30日), 单位:人民币元