光大保德信优势配置股票型证券投资基金

2012 半年度 报告摘要

2012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
报告送出日期:二〇一二年八月二十七日

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。本半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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年8月24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。

本报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	光大保德信优势配置股票
基金主代码	360007
交易代码	360007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年8月24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
报告期末基金份额总额	13,482,525,145.21份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金追求投资回报的实现,在严格管理风险的基础上,根据证券市场的变化进行行业配置,通过科学投资争取为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的回报。
投资策略	本基金为追求绝对收益的基金,强调在敏锐把握证券市场和中国经济变化方向的基础上,适当配置资产在各类证券和行业之间的比重,通过收益管理和稳健的投资操作为基金份额持有人谋取超过业绩比较基准的稳定回报。在行业配置方面,本基金将主要投资于国家重点支柱型产业。在个股选择上,本基金将主要投资于目标行业内按总市值排名前三分之一的大盘绩优股。
业绩比较基准	75%×沪深300指数+25%×天相国债全价指数。
风险收益特征	本基金为主动操作的股票型证券投资基金,属于证券投资基金中的较高风险品种。本基金力争在科学的风险管理的前提下,谋求实现基金财产的安全和增值。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	伍文静	张燕
	联系电话	021-33074700-3105	0755-83199084
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-820-2888,021-53524620	95555
传真		021-63351152	0755-83195201

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.epf.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的办公场所。

3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2012年1月1日至2012年6月30日)
本期已实现收益	-834,137,127.41
本期利润	204,087,885.96
加权平均基金份额本期利润	0.0149
本期基金份额净值增长率	2.35%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.3718
期末基金资产净值	8,469,234,926.80
期末基金份额净值	0.6282

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。

3.2 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
过去一个月	-3.19%	1.03%	-4.80%	0.82%	1.61%	0.21%
过去三个月	2.36%	0.99%	0.52%	0.84%	1.84%	0.15%
过去六个月	2.35%	1.21%	4.32%	1.00%	-1.97%	0.21%
过去一年	-15.03%	1.18%	-13.45%	1.01%	-1.58%	0.17%
过去三年	-13.09%	1.36%	-13.99%	1.17%	0.90%	0.19%
自基金合同生效起至今	-37.18%	1.67%	-37.07%	1.53%	-0.11%	0.14%

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

光大保德信优势配置股票型证券投资基金
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
(2007年8月24日至2012年6月30日)

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。

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55%和45%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2012年6月30日,光大保德信旗下管理着12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、光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信中小盘股票型证券投资基金、光大保德信添益债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金和光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金。

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(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周炜炜	首席投资总监兼本基金基金经理	2011-03-26	-	10年	周炜炜先生,CFA,伦敦商学院金融学硕士,香港大学商学院-复旦大学管理学院工商管理硕士。1998年至2000年任职于德意志银行上海分行,任助理副总裁;2000年至2001年任职于美国思腾思特管理咨询中国有限公司,任副总裁;2002年至2006年任职于招商基金管理有限公司,历任招商先锋证券投资基金基金经理、基金管理部副总监;2006年至2010年10月任职于父银施罗德基金管理有限公司,历任父银施罗德成长股票证券投资基金基金经理、权益投资部总经理、投资副总监;2010年11月加入光大保德信基金管理有限公司,现任首席投资总监兼光大保德信优势配置股票型证券投资基金基金经理。

注:1、"任职日期"和"离任日期"分别为公司决定确定的聘任日期和解聘日期

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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规定,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 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管理人对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

在2012年上半年,本基金认为市场的系统性风险在2011年已较充分地释放,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,这部分投资在今年以来取得了良好的表现。但是,在一季度末,由于本基金认为二季度是经济开始触底反弹,同时通胀继续下行的阶段,所以在季度末增加了周期成长性行业的配置,以增加组合阶段性的弹性。而实际上,这些投资在二季度的效果不佳。

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2.35%,业绩比较基准收益率为4.32%。

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年全年,本基金认为随着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。而累计的微调的稳增长政策效应也会在下半年在边际上产生效果,通过投资的带动,使中国经济在下半年阶段性的寻底成功。非银行上市公司的盈利也会在今年四季度和明年一季度开始改善,从而成为继政策预期和流动性改善推动股市后,又一阶段性重要的股市推进器。更多的产业资本会根据实体经济的投资回报和股市的隐含回报率之间进行判断,使它们做出增大对股票投资的决定。除非发生债务通缩和银行危机,否则,市场的整体估值水平继续下移的空间在缩小,长期的投资价值在逐步体现。

从更长远的角度看,本基金认为在中国经济增速趋缓但质量更加精细的环境中,投资者面对许多结构性的机会。如果过去十年,伴随着我国经济高速但粗放发展中,我们看到了许多上市公司随着行业的高速发展,由小变大的过程,但大量行业还是集中度非常分散,大公司还不是真正的强大。未来几年,我国经济降速转型过程中,我们可以看到许多公司由大变强的过程。我们已经看到,在经济剧烈波动的冲击下,一批优势企业在此轮经济危机调整和复苏过程中,持续扩大了其市场份额。我们有理由相信,在未来中国经济增速趋缓的过程中,这一批优势企业受益于其优于同业的竞争优势,成为行业的整合者,不断提高行业集中度,从而使得我国的各个行业的竞争效率提高,盈利能力也随之提高。相信经过未来几年的经济趋缓和行业整合的过程中,我们将迎来一批更高质量的具有全球竞争力的上市公司,这也是中国股市长期健康发展的基石。从战略导向上和财务指标看,这些公司通常都是能持续为股东创造价值的优质的成长企业,市场也会给他们更高的估值。本基金会在平衡权重价值类股票投资的基础上,自下而上不断挖掘上述这一批能持续为股东创造价值的优势成长企业,从而录得超越指数的回报。

当然,本基金会密切关注国内政策的变化、全球其它经济体的复苏和货币政策的变化等,从而对组合的结构进行调整,以保证本基金组合在长时间内取得较好业绩。

4.6管理人对报告期内本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、审计师和基金同业的意见,并必须获得估值委员会三分之二以上成员同意。

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调整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、基金同业、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;投资研究部负责估值政策调整对投资业绩影响的评估,数量小组负责估值政策调整对投资绩效的评估;IT部就估值政策调整的技术实现进行评估。

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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
光大证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构

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 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30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	1,988,600,117.99	20.03%	1,015,455,424.15	6.50%

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
光大证券	43,826,983.00	100.00%	123,452,215.80	75.46%

6.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30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	1,697,463.09	20.27%	927,712.01	20.00%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30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	863,137.56	6.59%	863,137.56	13.03%

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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	64,760,537.67	82,616,913.19
其中:支付销售机构的客户维护费	19,815,122.24	25,484,913.38

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×1.50%/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,逐日累计至每个月月末,按月支付,由基金管理人于次月首日起三个工作日内向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人在收到计算结果当日完成复核,并于当日从基金资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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	10,793,423.01	13,769,485.54

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×0.25%/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,逐日累计至每个月月末,按月支付,由基金管理人于次月首日起三个工作日内向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人在收到计算结果当日完成复核,并于当日从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年同期均未通过关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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

除基金管理人之外的其他关联方于本期期末和上年度可比期末均未投资本基金。

6.4.8.5 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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	908,521,856.82	3,007,610.48	1,012,883,543.91	4,592,384.04

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.9 期末(2012年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末未有因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

报告期末本基金未有银行间市场债券正回购。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

报告期末本基金未有证券交易所债券正回购。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金无需要说明的其他事项。

7 投资组合报告

7.1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	7,423,208,770.66	87.44
	其中:股票	7,423,208,770.66	87.44
2	固定收益投资	137,262,006.00	1.62
	其中:债券	137,262,006.00	1.62
	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	918,561,968.66	10.82
6	其他各项资产	10,672,575.17	0.13
7	合计	8,489,705,320.49	100.00

7.2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	141,166,568.16	1.67
C	制造业	3,028,913,266.35	35.76
C0	食品、饮料	477,784,769.56	5.64
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	122,947,515.14	1.45
C5	电子	14,511,966.00	0.17
C6	金属、非金属	469,864,621.10	5.55
C7	机械、设备、仪表	1,184,024,268.75	13.98
C8	医药、生物制品	759,780,125.80	8.97
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	49,205,594.75	0.58
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	741,074,073.04	8.75
H	批发和零售贸易	762,376,099.62	9.00
I	金融、保险业	1,598,136,520.24	18.87
J	房地产业	572,838,720.20	6.76
K	社会服务业	434,608,818.38	5.13
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	94,889,109.92	1.12
	合计	7,423,208,770.66	87.65

7.3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

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	600585	海螺水泥	30,065,818	445,575,422.76	5.26
2	601318	中国平安	9,429,658	431,312,556.92	5.09
3	600690	青岛海尔	31,852,221	373,308,030.12	4.41
4	600016	民生银行	62,000,000	371,380,000.00	4.39
5	000069	华侨城A	54,149,870	345,476,170.60	4.08
6	600383	金地集团	53,244,559	345,024,742.32	4.07
7	601877	正泰电器	19,801,712	302,174,125.12	3.57
8	002024	苏宁电器	32,900,000	276,031,000.00	3.26
9	601601	中国太保	12,177,700	270,101,386.00	3.19
10	000895	双汇发展	4,244,267	262,635,241.96	3.10

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于http://www.epf.com.cn网站的本基金半年度报告正文。

7.4报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600585	海螺水泥	372,151,668.97	4.37
2	601318	中国平安	210,950,514.34	2.48
3	600030	中信证券	208,731,078.92	2.45
4	600690	青岛海尔	207,936,474.06	2.44
5	601369	陕鼓动力	195,938,454.45	2.30
6	000933	神火股份	173,258,394.25	2.04
7	600325	华发股份	160,909,867.07	1.89
8	600176	中国玻纤	142,941,747.37	1.68
9	000401	冀东水泥	127,231,534.24	1.49
10	600383	金地集团	125,788,463.21	1.48
11	600649	城投控股	125,109,854.18	1.47
12	600028	中国石化	111,888,094.82	1.31
13	000926	福星股份	109,615,667.68	1.29
14	600050	中国联通	107,346,881.89	1.26
15	600837	海通证券	103,966,295.78	1.22
16	000728	国元证券	100,034,722.96	1.18
17	000069	华侨城A	97,896,088.04	1.15
18	601688	华泰证券	96,880,605.57	1.14
19	000651	格力电器	96,667,580.13	1.14
20	000063	中兴通讯	92,604,083.58	1.09

7.4.2 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	291,020,412.14	3.42
2	601088	中国神华	289,398,342.56	3.40
3	600000	浦发银行	269,504,516.48	3.17
4	600376	首开股份	264,644,568.86	3.11
5	600050	中国联通	178,600,689.07	2.10
6	600015	华夏银行	171,487,292.92	2.01
7	600176	中国玻纤	144,561,687.11	1.70
8	000401	冀东水泥	144,340,578.02	1.70
9	600489	中金黄金	140,959,568.42	1.66
10	000063	中兴通讯	134,591,772.08	1.58
11	600028	中国石化	107,546,864.50	1.26
12	600519	贵州茅台	104,444,787.54	1.23
13	000728	国元证券	103,693,715.70	1.22
14	600511	国药股份	102,597,397.74	1.21
15	600697	欧亚集团	100,139,068.55	1.18
16	600694	大商股份	94,528,435.26	1.11
17	002065	东华软件	92,428,220.03	1.09
18	000887	中鼎股份	91,762,845.09	1.08
19	002281	光迅科技	85,263,794.68	1.00
20	000527	美的电器	83,649,787.98	0.98

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	4,825,409,511.02
卖出股票的收入(成交)总额	5,117,458,740.94

注:7.4.1项"买入金额"、7.4.2项"卖出金额"及7.4.3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。

7.5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	中期票据	-	-
7	可转债	137,262,006.00	1.62
8	其他	-	-
9	合计	137,262,006.00	1.62

7.6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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	1,259,400	137,262,006.00	1.62

7.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

7.8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。

7.9投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 本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。

7.9.3 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	500,000.00
2	应收证券清算款	9,340,238.83
3	应收股利	-
4	应收利息	775,810.29
5	应收申购款	56,526.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,672,575.17

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	137,262,006.00	1.62

7.9.5 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未存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1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
670,574	20,105.95	298,566,096.72	2.21%	13,183,959,048.49	97.79%

8.2期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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基金	18,689.59	0.00%

注:本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金的基金经理均未持有本基金的份额。

9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2007年8月24日)基金份额总额	9,905,973,604.86
本报告期期初基金份额总额	13,870,283,580.02
本报告期基金总申购份额	24,967,629.10
减:本报告期基金总赎回份额	412,726,063.91
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	13,482,525,145.21

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 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

本报告期内本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金在本报告期内的投资策略未发生改变。

10.5为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 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。

10.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
光大证券股份有限公司	1	1,988,600,117.99	20.03%	1,697,463.09	20.27%	-
东方证券股份有限公司	2	1,836,804,844.63	18.50%	1,539,077.10	18.38%	-
安信证券股份有限公司	1	1,048,636,394.79	10.56%	891,337.56	10.64%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	797,165,386.67	8.03%	654,512.00	7.81%	-
中信证券股份有限公司	1	678,023,300.44	6.83%	578,772.97	6.91%	-
中金公司	1	555,525,643.96	5.59%	458,963.41	5.48%	-
兴业证券股份有限公司	1	543,911,921.72	5.48%	465,019.56	5.55%	-
国金证券有限责任公司	2	456,112,826.77	4.59%	373,091.81	4.45%	-
福银证券股份有限公司	1	449,593,764.90	4.53%	384,204.00	4.59%	-
东兴证券	1	415,923,650.75	4.19%	353,535.41	4.22%	-
招商证券股份有限公司	1	362,813,077.91	3.65%	311,217.09	3.72%	-
申银万国证券股份有限公司	1	256,639,134.02	2.58%	210,699.35	2.52%	-
华泰证券股份有限公司	3	249,768,108.39	2.52%	212,238.81	2.53%	-
中国银河证券股份有限公司	1	115,048,786.96	1.16%	97,792.82	1.17%	-
国信证券有限责任公司	1	75,679,815.95	0.76%	64,712.50	0.77%	-
中信建投证券有限责任公司	2	63,007,008.88	0.63%	51,194.21	0.61%	-
海通证券股份有限公司	1	36,984,467.23	0.37%	31,436.38	0.38%	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券有限公司	1	-	-	-	-	-

注:(1)报告期内租用证券公司交易单元变更情况

报告期内停止租用中邮证券。

(2)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