

光大保德信优势配置股票型证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013年6月30日

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	110,057,398.61	1.36
C	制造业	3,678,913,397.12	45.35

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	105,317,654.75	1.30
E	建筑业	99,548,356.69	1.23
F	批发和零售业	358,264,128.50	4.42
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	768,296,536.56	9.47
J	金融业	984,263,438.83	12.13
K	房地产业	813,071,519.81	10.02
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	157,307,570.24	1.94
N	水利、环境和公共设施管理业	103,472,972.92	1.28
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	7,178,512,779.03	88.49

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	公允价值占净资产比例(%)
1	000063	中兴通讯	37,000,000	471,750,000.00	5.82
2	001877	正海能源	19,801,712	392,655,966.08	4.84
3	000838	金地集团	56,471,312	387,393,200.32	4.78
4	000040	浦发银行	46,409,217	360,319,266.23	4.44
5	600690	青岛啤酒	33,299,853	363,301,296.23	4.48
6	001105	永发铝业	24,367,000	296,367,000.00	3.67
7	000999	华鲁化工	11,321,158	360,311,244.90	4.44
8	000039	中集集团	27,762,496	286,785,838.68	3.54
9	600406	国电山阴	18,988,734	283,501,500.02	3.51
10	600649	城投控股	40,953,967	283,401,451.64	3.49

10	600649	城投投资	40,953,967	283,401,516.64	3.49
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合					
序号	债券品种		公允价值(元)	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		219,927,000.00	2.71	
8	其他		--	--	
9	合计		219,927,000.00	2.71	

7	可转债		219,927,000.00	2.71	
8	其他			0.00	
9	合计		219,927,000.00	2.71	
5.3 报告期内未获公允价值且公允价值与净资产比例大小排名的前五名证券投资品种					
序号	证券代码	证券名称	数量(股)	公允价值(元)	公允价值占净资产比例(%)
1	113002	工行转债	1,660,000	175,008,000.00	2.16
2	110015	石化转债	450,000	44,419,000.00	0.55
5.4 报告期内公允价值高于或低于净资产比例大小排名的前五名资产支持证券投资品种					
报告期内本基金未持有资产支持证券。					
5.5 报告期内公允价值高于或低于净资产比例大小排名的前五名权证投资品种					
报告期内本基金未持有权证。					
5.6 报告期内本基金投资的股指期货交易情况说明					

5.8 报告期内本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期内本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：报告期内，本基金无股指期货投资。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金合同内无股指期货的投资政策。

5.9 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本报告编制日前一年内受到证券监管部门公开谴责、处罚的情况

5.9.1 本基金投资的前十名证券中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.9.2 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,617,554.14
2	应收证券清算款	36,684,415.48

2	应收证券清算款		36,684,415.48	
3	应收股利		—	
4	应收利息		1,424,714.76	
5	应收中购款		1,197,879.08	
6	其他应收款		—	
7	待摊费用		—	
8	其他		—	
9	合计		40,924,563.46	
5.9.4 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	公允价值(元)	占期末净资产(%)
1	113002	工行转债	175,098,000.00	2.16

	1	110902	工行转债		173,088,000.00	2.16
	2	110015	石化转债		44,019,000.00	0.55
5.9.5 报告期末前十名股票存在流通受限情况的说明						
序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限原因说明	
1	000999	华润三九	300,311,244.90	3.70	大股东资产重组	
§6 开放式基金份额变动						
						单位:份
本报告期初基金份额总额						12,923,767,324.38
本报告期基金总申购份额						19,900,338.88
减:本报告期基金总赎回份额						361,498,737.44

减:本报告期末基金总份额(份)	360,498,737.44
本报告期末基金份额变动份额	
本报告期末基金份额总额	12,583,194,925.82

5.7 影响投资决策的其他重要信息

5.8 备查文件目录

5.8.1 备查文件目录

1. 中国证监会和光大保德信优势配置股票型证券投资基金设立的文件
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持有人协议
5. 光大保德信优势配置股票型证券投资基金法律意见书
6. 基金管理人业务资格批核、营业执照、公司章程

6.基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程

7.基金管理人基金资格批件和营业执照

8.报告期内及报告期内六个月末基金投资资产在指定报刊上披露的各项公告

9.中国证监会要求的其他文件

8.2 存放地点

上海市陆家嘴 222 号外滩中心大厦 46 层基金管理人办公地址。

8.3 查阅方式

投资者对于基金管理人办公时间内的查阅。投资者对本报告如有疑问,可咨询本基金管理人。客户服务中心电话: 908-020-888, 021-53522620。公司网址: www.cpf.com.cn。

光大保德信基金管理有限公司
二〇一三年七月十一日

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(%)
1	600104	上汽集团	340,000	4,491,400.00	6.01
2	605199	贵州茅台	19,500	3,751,215.00	5.02
3	000651	格力电器	138,000	3,458,280.00	4.63
4	600809	山西汾酒	130,000	3,185,000.00	4.26
5	601877	正海电器	151,000	2,995,840.00	4.01

6	000002	万科 A	30,000	2,955,000.00	3.95
7	600648	保利地产	270,000	2,675,700.00	3.58
8	000388	华泰证券	2,500,000	2,500,000.00	3.35
9	401166	华夏银行	170,000	2,481,000.00	3.30
10	300012	华商银行	210,000	2,427,600.00	3.26

5.4 报告期内按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未投资债券。

5.5 报告期内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

本基金本报告期末未投资债券。

5.6 报告期内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投资资产支持证券。

5.7 报告期内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投资权证。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名证券投资品种

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资品种

5.9 报告期内基金投资的前十名证券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内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情形

5.9.2 基金投资的前十名股票未出现基金合同规定的备选股票情况

5.9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	51,880.91
2	应收证券清算款	14,142,559.33
3	应收股利	96,900.00

3	应收股利		96,900.00
4	应收利息		1,391.73
5	应收申购款		217,970.06
6	其他应收款		-
7	待摊费用		-
8	其他		-
9	合计		14,510,672.03

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转债债券。

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.6 开放式基金份额变动

本基金本报告期末前十名股东中不存在流通受限的情况		单位:份
5.6 开放式基金份额变动		
本报告期期初基金份额总额		78,889,908.06
本报告期基金总申购份额		14,704,128.73
减:本报告期基金总赎回份额		22,206,202.34
本报告期基金净申购份额		-
本报告期期末基金份额总额		71,387,834.45

5.7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准光大保德信行业轮动股票型证券投资基金设立的文件
2. 光大保德信行业轮动股票型证券投资基金基金合同
3. 光大保德信行业轮动股票型证券投资基金托管协议

光大证券股份有限公司证券投资基金管理
7、光大银行行轮动股票型证券投资基金信息披露公告书
8、光大银行行轮动股票型证券投资基金招募说明书
9、光大保德信行轮动股票型证券投资基金托管协议
6、基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
7、基金管理人业务资格批件和营业执照内页
8、报告期内光大银行行轮动股票型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告
9、中国证监会要求的其他文件

7.2 存放地点
上海市外滩中法大厦门牌40层本基金管理人办公地址。

7.3 查阅方式
投资者可至本基金管理人办公场所查询。投资人对报告若有疑问，可咨询各中心电话：
4008-200-888（或201-53524120）。
公司网站：www.evgf.com.cn

光大银行行轮动股票型证券投资基金
