

# 光大保德信优势配置混合型证券投资基金

## 2015 第四季度报告

2015年12月31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:二〇一六年一月二十日

**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约定,于2016年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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预示其未来表现,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。  
本报告期末资料未经审计。  
本报告期间自2015年10月1日起至12月31日止。

**2 基金产品概况**

基金名称	光大保德信优势配置混合
基金代码	501007
交易场所	深圳证券交易所
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2010年10月14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

本报告期末基金资产净值情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	4,096,330,939.65	81.72
2	固定收益	4,096,330,939.65	81.72
3	银行存款	2,882,990.89	0.06
4	买入返售金融资产	0	0.00
5	应收利息	0	0.00
6	其他资产	0	0.00
7	资产减值准备	0	0.00
8	其他负债	330,000,000.00	6.38
9	其中:卖出回购金融资产款	330,000,000.00	6.38
10	所有者权益	5,989,732,189.59	117.81
11	负债	3,386,805,246.76	67.19
12	其中:应付利息	0	0.00
13	其他负债	3,386,805,246.76	67.19

**5 投资组合报告**

5.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	23,000,000.00	0.24
B	医药生物	232,000,000.00	2.34
C	信息技术	6,926,111,695.28	69.82
D	电力、热力、燃气及水利生产和供应业	16,249,544.00	0.16
E	建筑业	115,277,564.22	1.15
F	制造业	1,022,253,632.46	10.22
G	交通运输、仓储和邮政业	52,220,000.00	0.52
H	住宿和餐饮业	113,760,000.00	1.13
I	房地产业	56,820,833.57	0.56
J	金融业	723,232,937.93	7.23
K	其他行业	27,980,000.00	0.27
L	备用资金	275,930,241.54	2.75
M	持有至到期投资	116,526,000.00	1.16
N	可供出售金融资产	173,344,614.26	1.73
O	其他资产	0	0.00
P	其他负债	0	0.00
S	股指期货	0	0.00
T	国债期货	0	0.00
合计		4,986,101,814.64	49.72

**3.1 主要财务指标**

主要财务指标	报告期(2015年10月1日至2015年12月31日)
1.本期已实现收益	403,290,021.63
2.本期公允价值变动损益	935,758,101.51
3.本期资产减值准备	0.00
4.本期投资收益(含公允价值变动)	6,660,963,843.02
5.本期基金费用	1,476.06

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(不含公允价值变动损益)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损益。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,计入费用后实际收益水平更低于所列数字。  
2.本期公允价值变动损益指基金本期公允价值变动收益(含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。  
3.本期基金费用指基金本期管理费、基金托管费、基金销售服务费、基金合同生效以来的应支付的各项费用。  
4.本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率乘以85%加上上证国债指数收益率乘以15%。  
5.本报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较  
6.本报告期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  
7.本报告期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  
8.本报告期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  
9.本报告期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  
10.本报告期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  
11.本报告期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  
12.本报告期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  
13.本报告期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  
14.本报告期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  
15.本报告期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  
16.本报告期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  
17.本报告期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  
18.本报告期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  
19.本报告期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  
20.本报告期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  
21.本报告期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  
22.本报告期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  
23.本报告期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  
24.本报告期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  
25.本报告期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  
26.本报告期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  
27.本报告期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  
28.本报告期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  
29.本报告期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  
30.本报告期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  
31.本报告期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  
32.本报告期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  
33.本报告期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  
34.本报告期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  
35.本报告期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  
36.本报告期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  
37.本报告期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  
38.本报告期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  
39.本报告期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  
40.本报告期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  
41.本报告期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  
42.本报告期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  
43.本报告期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  
44.本报告期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  
45.本报告期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  
46.本报告期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  
47.本报告期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  
48.本报告期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  
49.本报告期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  
50.本报告期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  
51.本报告期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  
52.本报告期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  
53.本报告期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  
54.本报告期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  
55.本报告期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  
56.本报告期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  
57.本报告期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  
58.本报告期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  
59.本报告期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  
60.本报告期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  
61.本报告期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  
62.本报告期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  
63.本报告期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  
64.本报告期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  
65.本报告期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  
66.本报告期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  
67.本报告期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  
68.本报告期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  
69.本报告期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  
70.本报告期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  
71.本报告期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  
72.本报告期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  
73.本报告期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  
74.本报告期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  
75.本报告期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  
76.本报告期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  
77.本报告期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  
78.本报告期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  
79.本报告期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  
80.本报告期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  
81.本报告期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  
82.本报告期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  
83.本报告期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  
84.本报告期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  
85.本报告期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  
86.本报告期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  
87.本报告期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  
88.本报告期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  
89.本报告期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  
90.本报告期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  
91.本报告期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  
92.本报告期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  
93.本报告期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  
94.本报告期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  
95.本报告期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  
96.本报告期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  
97.本报告期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  
98.本报告期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  
99.本报告期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  
100.本报告期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

**5.2 基金资产配置**

5.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	农林牧渔	23,000,000.00	0.24
2	医药生物	232,000,000.00	2.34
3	信息技术	6,926,111,695.28	69.82
4	电力、热力、燃气及水利生产和供应业	16,249,544.00	0.16
5	建筑业	115,277,564.22	1.15
6	制造业	1,022,253,632.46	10.22
7	交通运输、仓储和邮政业	52,220,000.00	0.52
8	住宿和餐饮业	113,760,000.00	1.13
9	房地产业	56,820,833.57	0.56
10	金融业	723,232,937.93	7.23
11	其他行业	27,980,000.00	0.27
12	备用资金	275,930,241.54	2.75
13	持有至到期投资	116,526,000.00	1.16
14	可供出售金融资产	173,344,614.26	1.73
15	其他资产	0	0.00
16	其他负债	0	0.00
17	股指期货	0	0.00
18	国债期货	0	0.00
19	合计	4,986,101,814.64	49.72

**5.3 报告期内基金持仓变动**

5.3.1 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

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	002009	长源控股	7,272,220	238,361,340.80	2.38
2	601288	农业银行	9,164,741	210,402,236.15	2.10
3	600562	宏创股份	20,176,784	212,543,302.73	2.12
4	002136	安硕信息	11,709,904	201,425,478.78	2.01
5	001216	大亚股份	4,908,649	184,580,266.30	1.84
6	600045	中国宏桥	9,149,418	150,851,414.46	1.51
7	000911	招商轮船	3,099,468	140,816,726.68	1.41
8	002078	湖南黄金	22,713,756	127,578,496.95	1.27
9	600883	海通证券	5,307,792	127,560,260.80	1.27
10	600168	华鲁恒升	6,441,687	127,039,913.24	1.27

**5.4 报告期内基金持仓变动**

5.4.1 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

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	002009	长源控股	7,272,220	238,361,340.80	2.38
2	601288	农业银行	9,164,741	210,402,236.15	2.10
3	600562	宏创股份	20,176,784	212,543,302.73	2.12
4	002136	安硕信息	11,709,904	201,425,478.78	2.01
5	001216	大亚股份	4,908,649	184,580,266.30	1.84
6	600045	中国宏桥	9,149,418	150,851,414.46	1.51
7	000911	招商轮船	3,099,468	140,816,726.68	1.41
8	002078	湖南黄金	22,713,756	127,578,496.95	1.27
9	600883	海通证券	5,307,792	127,560,260.80	1.27
10	600168	华鲁恒升	6,441,687	127,039,913.24	1.27

**5.5 报告期内基金持仓变动**

5.5.1 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

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	122001	建设银行	78,882,321	2,862,300,200.88	28.62
2	122011	工商银行	1,098,287,282	2,862,300,200.88	28.62
3	122020	农业银行	1,098,287,282	2,862,300,200.88	28.62
4	122030	交通银行	1,098,287,282	2,862,300,200.88	28.62
5	122040	招商银行	1,098,287,282	2,862,300,200.88	28.62

**5.6 报告期内基金持仓变动**

5.6.1 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

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	002009	长源控股	7,272,220	238,361,340.80	2.38
2	601288	农业银行	9,164,741	210,402,236.15	2.10
3	600562	宏创股份	20,176,784	212,543,302.73	2.12
4	002136	安硕信息	11,709,904	201,425,478.78	2.01
5	001216	大亚股份	4,908,649	184,580,266.30	1.84
6	600045	中国宏桥	9,149,418	150,851,414.46	1.51
7	000911	招商轮船	3,099,468	140,816,726.68	1.41
8	002078	湖南黄金	22,713,756	127,578,496.95	1.27
9	600883	海通证券	5,307,792	127,560,260.80	1.27
10	600168	华鲁恒升	6,441,687	127,039,913.24	1.27

**5.7 报告期内基金持仓变动**

5.7.1 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

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	002009	长源控股	7,272,220	238,361,340.80	2.38
2	601288	农业银行	9,164,741	210,402,236.15	2.10
3	600562	宏创股份	20,176,784	212,543,302.73	2.12
4	002136	安硕信息	11,709,904	201,425,478.78	2.01
5	001216	大亚股份	4,908,649	184,580,266.30	1.84
6	600045	中国宏桥	9,149,418	150,851,414.46	1.51
7	000911	招商轮船	3,099,468	140,816,726.68	1.41
8	002078	湖南黄金	22,713,756	127,578,496.95	1.27
9	600883	海通证券	5,307,792	127,560,260.80	1.27
10	600168	华鲁恒升	6,441,687	127,039,913.24	1.27

**5.8 报告期内基金持仓变动**

5.8.1 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

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	002009	长源控股	7,272,220	238,361,340.80	2.38
2	601288	农业银行	9,164,741	210,402,236.15	2.10
3	600562	宏创股份	20,176,784	212,543,302.73	2.12
4	002136	安硕信息	11,709,904	201,425,478.78	2.01
5	001216	大亚股份	4,908,649	184,580,266.30	1.84
6	600045	中国宏桥	9,149,418	150,851,414.46	1.51
7	000911	招商轮船	3,099,468	140,816,726.68	1.41
8	002078	湖南黄金	22,713,756	127,578,496.95	1.27
9	600883	海通证券	5,307,792	127,560,260.80	1.27
10	600168	华鲁恒升	6,441,687	127,039,913.24	1.27

**5.9 报告期内基金持仓变动**

5.9.1 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

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	002009	长源控股	7,272,220	238,361,340.80	2.38
2	601288	农业银行	9,164,741	210,402,236.15	2.10
3	600562	宏创股份	20,176,784	212,543,302.73	2.12
4	002136	安硕信息	11,709,904	201,425,478.78	2.01
5	001216	大亚股份	4,908,649	184,580,266.30	1.84
6	600045	中国宏桥	9,149,418	150,851,414.46	1.51
7	000911	招商轮船	3,099,468	140,816,726.68	1.41
8	002078	湖南黄金	22,713,756	127,578,496.95	1.27
9	600883	海通证券	5,307,792	127,560,260.80	1.27
10	600168	华鲁恒升	6,441,687	127,039,913.24	1.27

**5.10 报告期内基金持仓变动**

5.10.1 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

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	002009	长源控股	7,272,220	238,361,340.80	2.38
2	601288	农业银行	9,164,741	210,402,236.15	2.10
3	600562	宏创股份	20,176,784	212,543,302.73	2.12
4	002136	安硕信息	11,709,904	201,425,478.78	2.01
5	001216	大亚股份	4,908,649	184,580,266.30	1.84
6	600045	中国宏桥	9,149,418	150,851,414.46	1.51
7	000911	招商轮船	3,099,468	140,816,726.68	1.41
8	002078	湖南黄金	22,713,756	127,578,496.95	1.27
9	600883	海通证券	5,307,792	127,560,260.80	1.27
10	600168	华鲁恒升	6,441,687	127,039,913.24	1.27

**5.11 报告期内基金持仓变动**

5.11.1 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

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	002009	长源控股	7,272,220	238,361,340.80	2.38
2	601288	农业银行	9,164,741		