光大保德信现金宝货币市场基金

2013 第四季度 报告

2013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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期: 二〇一四年一月二十二日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月21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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	光大保德信现金宝货币		
基金主代码	000210		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2013年9月5日		
报告期末基金份额总额	244,818,708.76份		
投资目标	本基金力争保持基金资产的流动性和安全性,追求高于业绩比较基准的稳定收益。		
投资策略	本基金将综合考虑各类投资品种的收益和风险特征,在保证基金资产安全性的基础上力争为投资人创造稳定的收益。银行存款一般具有收益稳定、风险低等基本特征,特别是机构投资者在投资银行存款时,往往能获得比普通投资者更高的收益率。本基金在投资银行存款时将对不同银行的银行存款收益率做深入的分析,同时结合各银行的信用等级、存款期限等因素的研究,综合考量整体利率市场环境及其变动趋势,在严格控制风险的前提下决定各银行存款的投资比例。		
业绩比较基准	人民币活期存款利率(税后)		
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的风险较低的品种,其预期收益和风险低于债券型基金、混合型基金和股票型基金。		
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
下属两级基金的基金简称	光大保德信现金宝货币A		光大保德信现金宝货币B
下属两级基金的交易代码	000210		000211
报告期末下属两级基金的份额总额	86,094,531.15份		158,724,177.61份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)	
	光大保德信现金宝货币A	光大保德信现金宝货币B
1.本期已实现收益	1,350,442.22	1,366,050.32
2.本期利润	1,350,442.22	1,366,050.32
3.期末基金资产净值	86,094,531.15	158,724,177.61

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1.光大保德信现金宝货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	1.0353%	0.0023%	0.0894%	0.0000%	0.9459%	0.0023%

2.光大保德信现金宝货币B

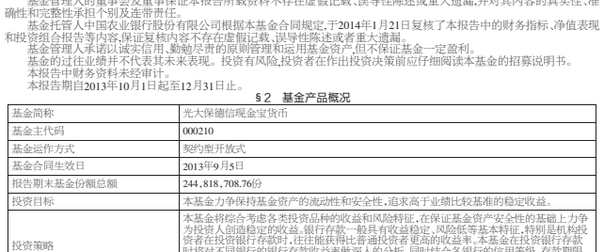
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0966%	0.0023%	0.0894%	0.0000%	1.0072%	0.0023%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

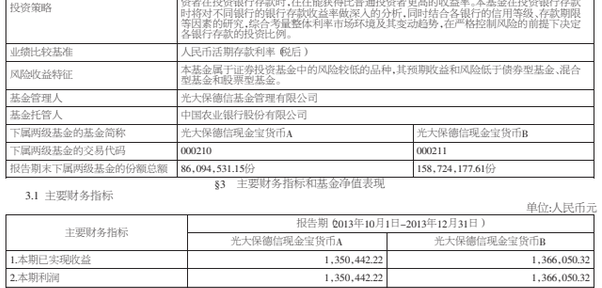
光大保德信现金宝货币市场基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013年9月5日至2013年12月31日)



1、 光大保德信现金宝货币A



2、 光大保德信现金宝货币B

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
韩爱丽	-	2013-9-5	-	6年	韩爱丽女士,复旦大学经济学硕士,CFA.2006年7月至2010年8月在上海浦东发展银行总行资金部从事固定收益交易、研究工作;2010年8月加盟光大保德信基金管理有限公司,任高级债券研究员,现任光大保德信货币市场基金基金经理、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基金经理、光大保德信添盛双月理财债券型证券投资基金基金经理、光大保德信添天盈季度理财债券型证券投资基金基金经理、光大保德信现金宝货币市场基金基金经理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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约定,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 公平交易专项说明

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 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

2013年四季度国内经济增长总体平稳,同时加大结构调整力度,经济增速呈现稳中有降的态势。12月中采PMI为51,和11月相比小幅下降0.4个百分点,8月以来首次出现回落,显示不比经济增长动能放缓。从主要分项数据来看,生产和需求同时下滑,原材料补库存活动确立结束,产成品库存回落,价格平稳。1-11月,规模以上工业增加值同比增长9.7%,增速比上年同期回落0.3个百分点。1-11月全国固定资产投资同比名义增长19.9%,增速比上年同期回落0.8个百分点。1-11月社会消费品零售总额同比增长13.03%,增速比上年同期回落1.17个百分点。1-11月出口同比增长8.26%,进口同比增长7.14%,增速比上年同期分别回升0.96和2.84个百分点。2013年12月份,全国居民消费价格总水平同比上涨2.5%。食品价格上涨4.1%,非食品价格上涨1.7%。2013年,全国居民消费价格总水平比上年上涨2.6%,物价形势基本稳定。货币市场利率在四季度从6月的高点回落,但仍处于不低的水平,并在12月下旬又呈现了高企局面。在银行间流动性偏紧张的情况下,叠加债券市场特别是利率债的供给过于充分,债券收益率快速上升。在此考验下,现金宝基金结合规模变动做了相应的仓位调整,降低债券投资,通过资金回购和协议存款来提供流动性支撑,改善组合的收益与风险匹配程度,提高组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内光大保德信现金宝货币A份额净值增长率为1.0353%,业绩比较基准收益率为0.0894%;光大保德信现金宝货币B份额净值增长率为1.0966%,业绩比较基准收益率为0.0894%。

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2014年1季度,无论从宏观还是从微观角度,内需增长依然乏力,工业企业利润累计增速还难见有明显改善,这预示着未来国内经济增速被弱的趋势仍然持续,宏观政策将以调结构为主,2014年通胀将会温和盘整,不会有超预期的上行。长期来看,国内经济在实现淘汰落后产能,调整优化产业结构的过程中,以往依赖低附加值的传统商品出口、地产和基建投资推动的经济高速增长不可持续。资金面上,在对未来长期流动性的政策或变局均不明确的情况下,央行更倾向于将流动性调控工具向短期化方向倾斜,给自己留下操作空间。在整体数量上基本能做到中性,但是短期工具的释放存在一定的滞后性,特别是在长期利率高企的状况下,机构对流动性的担心会减少市场活跃度,表现在资金层面就是中性偏紧。现金宝基金在兼顾收益性、流动性的前提下,会适时调整信用债的投资,同时维持协议存款和逆回购的比例。操作上把平衡性作为第一位,谨慎投资,力求在投资标的种类、比例方面做到平衡和风险的可控。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	29,926,659.13	12.22
	其中:债券	29,926,659.13	12.22
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	62,254,766.88	25.42
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	151,009,066.31	61.65
4	其他资产	1,759,648.50	0.72
5	合计	244,950,140.82	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额		0.02
	其中:买断式回购融资		-
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:上表中,报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	41
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	63
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	0

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

报告期内投资组合平均剩余期限未有违规超过180天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	62.60	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	8.16	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	24.51	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	4.06	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.33	-

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	摊余成本(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	29,926,659.13	12.22
	其中:政策性金融债	29,926,659.13	12.22
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	29,926,659.13	12.22
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130210	13国开10	200,000	19,985,291.41	8.16
2	130236	13国开36	100,000	9,941,367.72	4.06

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	-0.0029%
报告期内偏离度的最低值	-0.0212%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0081%

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十名资产支持证券投资明细

报告期末本基金未有资产支持证券交易情况。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

(1).本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。 (2).为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离,从而对基金持有人的利益产生稀释和不公平的结果,基金管理人于每一估值日,采用市场利率或交易价格,对基金持有的估值对象进行重新评估,即"影子定价"。当基金资产净值与影子定价的偏离达到或超过基金资产净值的一定幅度时,或基金管理人认为发生了其他的重大偏离时,基金管理人可以与基金托管人商定后进行调整,使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值,确保以摊余成本法计算的基金资产净值不会对基金持有人造成实质性的损害。 (3).如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值。 (4).如有新增事项或变更事项,按国家最新规定估值。

5.8.2 本报告期内不存在剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 本基金投资的前十名证券的发行主体,本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.4 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,755,348.50
4	应收申购款	4,300.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,759,648.50

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	光大保德信现金宝货币A	光大保德信现金宝货币B
本报告期期初基金份额总额	314,430,600.53	210,419,954.13
本报告期基金总申购份额	85,502,127.57	100,624,774.87
减:本报告期基金总赎回份额	313,838,196.95	152,320,551.39
本报告期期末基金份额总额	86,094,531.15	158,724,177.61

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

单位:份

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	基金转换出	2013-11-05	-30,000,000.00	-30,060,233.17	0.0000
2	申购	2013-12-25	18,000,000.00	18,000,000.00	0.0000
3	基金转换入	2013-12-27	9,090,000.00	9,090,000.00	0.0000
合计			-2,910,000.00	-2,970,233.17	

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会批准设立光大保德信现金宝货币市场基金的文件

2.光大保德信现金宝货币市场基金合同

3.光大保德信现金宝货币市场基金招募说明书

4.光大保德信现金宝货币市场基金托管协议

5.光大保德信现金宝货币市场基金法律意见书

6.光大保德信基金管理有限公司的业务资格批件、营业执照、公司章程

7.基金托管人业务资格批件和营业执照

8.报告期内光大保德信现金宝货币市场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

8.2 存放地点

上海市延安东路222号外滩中心大厦46层本基金管理人办公地址。

8.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。 投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人。 客户服务中心电话:4008-202-888,021-53524620。 公司网址:www.epf.com.cn。

光大保德信基金管理有限公司
二〇一四年一月二十二日

光大保德信优势配置股票型证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013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: 二〇一四年一月二十二日

§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规定,于2014年1月21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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

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		
报告期末基金份额总额	12,249,361,493.75份		
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。		
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		

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	60,745,650.53
2.本期利润	289,745,691.36
3.加权平均基金份额本期利润	0.0234
4.期末基金资产净值	9,276,312,074.06
5.期末基金份额净值	0.7573

注: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。 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要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

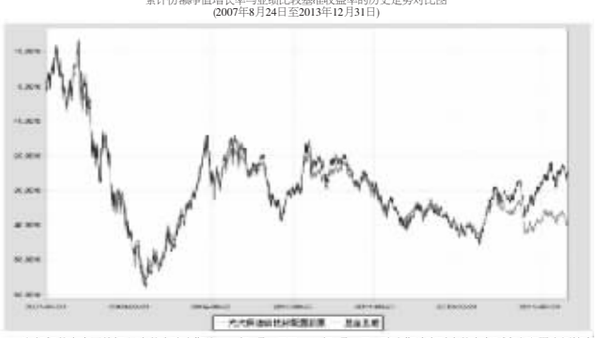
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.19%	1.35%	-2.27%	0.84%	5.46%	0.51%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2007年8月24日至2013年12月31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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周炜伟	首席投资总监兼本基金基金经理	2011-3-26	-	11年	周炜伟先生,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月任职于交银施罗德基金管理有限公司,历任交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。

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约定,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 公平交易专项说明

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 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2013年四季度,本基金坚持三季度以来的策略,从估值的安全角度出发,坚持不参与许多品贵的热门成长股的投资。相反,本基金认为从2014年的角度出发,随着中国经济进入一个新的稳态增长期和市场对经济改革的信心的增强,许多价值类股票会随着经济企稳和改革改善,迎来盈利的改善周期。正是如此,本基金遵循经济2014年企稳和企业改革改善这两个纬度出发,坚持了相当的价值类股票的暴露。这在第三季度有所收获,在四季度也保持了较好的收益,本基金相信,这些布局和投资会在2014年带来更大的收益。

当然,从更长远的角度看,本基金认为制约中国经济发展和股市估值的结构性因素虽然还会在未来相当长的时间内存在。在中国经济增速趋缓但质量更加精细的环境中,投资者会面对更多结构性的机会而非周期性的机会。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。

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3.19%,业绩比较基准收益率为-2.27%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在2014年以及以后几年,各个行业内的公司和股票分化会越来越严重,这对过去行业轮动或行业整体投资的策略带来极大挑战。精选行业内个股,精选行业内的优胜者和整合者,是未来相当长时间的投资策略。正是出于这样的判断,本基金会在合理估值的基础上,持续关注和加大对于能受益于未来行业整合的优势企业的投资,目下而上不断把握上述这一批能持续为股东创造价值的优势成长企业。相应的,本基金会维持较高的个股集中度,因为,长期行业优势者和整合者,而且估值要合理,毕竟是少数。

在2014年,我们还会继续有面临风险和挑战。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。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	8,235,256,298.10	88.28
	其中:股票	8,235,256,298.10	88.28
2	固定收益投资	374,860,918.40	4.02
	其中:债券	374,860,918.40	4.02
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	98,660,249.33	1.06
	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	585,250,565.38	6.27
6	其他资产	34,374,669.53	0.37
7	合计	9,328,402,700.74	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	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	-	-
C	制造业	5,508,351,972.73	59.38
D	电力,热力,燃气及水生产和供应业	46,999,797.90	0.51
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	149,717,838.90	1.61
G	交通运输,仓储和邮政业	172,355,720.40	1.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输,软件和信息技术服务业	997,603,710.97	10.75
J	金融业	900,924,945.35	9.71
K	房地产业	249,900,000.00	2.69
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	174,722,311.85	1.88
N	水利,环境和公共设施管理业	34,680,000.00	0.37
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	8,235,256,298.10	88.78

5.3 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

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	600690	青岛海尔	35,999,999	701,999,980.50	7.57
2	000039	中集集团	38,579,929	573,297,744.94	6.18
3	601877	正泰电器	19,801,712	492,666,594.56	5.31
4	600588	用友软件	34,499,815	477,477,439.60	5.15
5	600000	浦发银行	47,000,000	443,210,000.00	4.78
6	000999	华润三九	15,797,391	393,197,061.99	4.24
7	600585	海螺水泥	21,599,900	366,334,304.00	3.95
8	601166	兴业银行	33,000,000	334,620,000.00	3.61
9	002311	海大集团	26,573,672	311,974,909.28	3.36
10	600196	复星医药	15,000,000	293,850,000.00	3.17

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	374,860,918.40	4.04
8	其他	-	-
9	合计	374,860,918.40	4.04

5.5 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债券投资明细

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(%)
1	113002	工行转债	2,600,000	263,510,000.00	2.84
2	110015	石化转债	1,167,690	111,350,918.40	1.20

5.6 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资产支持证券投资明细

报告期末本基金未持有资产支持证券。

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权证投资明细

报告期末本基金未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金合同中尚无股指期货的投资政策。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 2013年11月7日,中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司("本公司","连同其附属公司,"本集团")董事会("董事会")根据中国证券报股份有限公司2013年11月7日的A股公告获悉,公司非执行董事徐敏杰("徐先生")正接受相关部门调查("调查")。目前公司生产经营活动一切正常。公司董事会相信,调查将不会对集团业务及营运构成重大不利影响。董事会将继续监察调查进展并不时评估调查对本集团的影响。公司将根据监管要求对相关情况及时披露。本基金管理人认为公司非执行董事被相关部门调查事件已经被基本消化。本基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

根据环保部2013年8月29日发布的2012年度全国主要污染物总量减排情况考核结果,中石化未完成氮氧化物减排目标,自考核结果公布之日起,环保部暂停审批中石化两家集团公司除油品升级和节能减排项目之外的新、改、扩建炼化项目环评。中石化对此积极回应,其新闻发言人吕大鹏对外表示,中石化按受环保部的考核要见,服从处理决定,同时针对现有的问题和差距,进一步加大环保投入,督促并帮助有关问题企业加速整改,确保环境保护各项指标尽快达标。中石化董事长傅成玉也做出表态,要求把批评当动力,并带头作检讨。2013年7月,中石化总部已决定实施"碧水蓝天"环保专项行动,将在近三年,投资228.7亿元实施803个环保治理项目。目前,该专项行动已全面启动,并在受到事件影响下提速,以期尽快实现减排目标。

本基金管理人认为中国石化该负面事件影响已经基本消化。本基金管理人对"石化债券"的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

本基金投资的前十名证券的发行主体除上述公司之外,本期未出现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、处罚的情况。

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

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,520,788.53
2	应收证券清算款	31,052,336.09
3	应收股利	-
4	应收利息	1,706,952.70
5	应收申购款	94,592.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,374,669.53

5.10.4 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)	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	263,510,000.00	2.84
2	110015	石化转债	111,350,918.40	1.20

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	12,595,436,998.46
本报告期基金总申购份额	274,844,830.54
减:本报告期基金总赎回份额	620,920,335.25
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	12,249,361,493.75

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会批准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托管协议

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件、营业执照、公司章程

7.基金托管人业务资格批件和营业执照

8.报告期内光大保德信优势配置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

8.2 存放地点

上海市延安东路222号外滩中心大厦46层本基金管理人办公地址。

8.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。 投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人。 客户服务中心电话:4008-202-888,021-53524620。 公司网址:www.epf.com.cn。

光大保德信基金管理有限公司
二〇一四年一月二十二日

博时标普500交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2013 第四季度 报告

2013年12月31日

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月22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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月21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。

根据基金管理人2013年12月27日刊登的《博时基金管理有限公司关于博时标普500指数型证券投资基金修订基金合同部分条款的公告》,博时标普500指数型证券投资基金自2013年12月31日转为博时标普500交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品概况

基金简称	博时标普500ETF联接(QDII)
基金主代码	050025
交易代码	050025
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月14日
报告期末基金份额总额	159,198,734.27份
投资目标	通过投资于博时标普