光大保德信量化核心证券投资基金 2006年年度报告摘要

基金管理人:光大保德信基金管理有限公司　基金托管人:中国光大银行

重要提示:

本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。本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。

本基金的托管人——中国光大银行根据本基金合同规定,于2007年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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。

本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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

一、基金简介

(一)基金名称:光大保德信量化核心证券投资基金

基金简称:量化核心

交易代码:360001

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2004年8月27日

报告期末基金份额总额:282,528,048.49份

基金合同存续期:不定期

(二)基金投资概况

1 基金投资目标:追求长期持续稳定超出业绩比较基准的投资回报。

2. 基金投资策略:本基金借鉴了外方股东保德信投资的量化投资管理理念和长期经验,结合中国市场现行特点加以改进,形成光大保德信独特的量化投资策略;正常市场情况下不作主动资产配置,采用自下而上与自上而下相结合的方式选择股票;并通过投资组合优化器构建并动态优化投资组合,确保投资组合风险收益特征符合既定目标。

3. 业绩比较基准:90%×新华富时中国A200指数+10%×同业存款利率

4. 风险收益特征:本基金风险收益特征属于证券投资基金中风险程度中等偏高的品种,按照风险收益配比原则对投资组合进行严格的风险管理,在风险限制范围内追求收益最大化。

(三)金管理人名称:光大保德信基金管理有限公司

注册地址:上海市延安东路222号外滩中心46层

办公地址:上海市延安东路222号外滩中心46层

邮政编码:200002

法定代表人:林昌

总经理:傅德修

信息披露负责人:伍文静

联系电话:021-33074700-3105

传真:021-63351152

电子信箱:wuwj@epf.com.cn

客户服务电话:021-53524620

(四)基金托管人名称:中国光大银行

注册地址:北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦

办公地址:北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦

邮政编码:100045

法定代表人:王明权

信息披露负责人:张建春

联系电话:010-68560675

传真:010-68560661

电子信箱:zjc@cebbank.com

(五)基金信息披露报纸:《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》

基金年度报告(全文)查询网址:http://www.epf.com.cn

基金年度报告置备地点:光大保德信基金管理有限公司、中国光大银行的办公场所

二、基金主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况

(一)主要财务指标

财务指标	2006年度	2005年	2004年
基金本期净收益	437,247,457.94	-283,441,944.90	-12,651,559.13
基金份额本期净收益	0.7098	-0.1541	-0.0053
期末可供分配基金收益	181,229,603.06	-232,173,703.01	-12,631,274.19
期末可供分配基金份额收益	0.6415	-0.1566	-0.0062
期末基金资产净值	516,624,700.50	1,298,924,803.32	1,924,610,187.53
期末基金份额净值	1.8286	0.8761	0.9457
基金加权平均净值收益率	62.82%	-17.75%	-0.53%
本期基金份额净值增长率	122.98%	-7.36%	-5.44%
基金份额累计净值增长率	95.35%	-12.40%	-5.44%

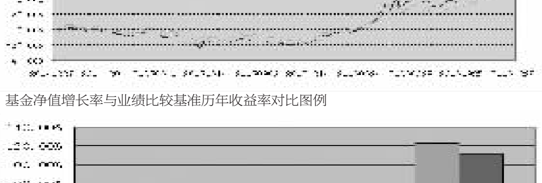
注:所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(二)基金净值表现

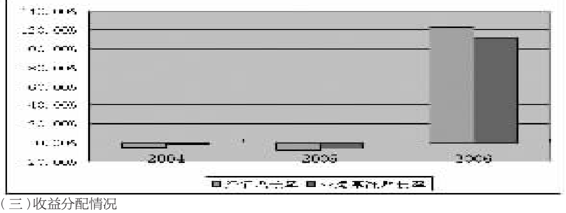
1. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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	33.46%	1.40%	45.27%	1.33%	-11.81%	0.07%
过去六个月	38.25%	1.30%	46.74%	1.27%	-8.49%	0.03%
过去一年	122.98%	1.32%	111.41%	1.24%	11.57%	0.08%
过去两年	106.57%	1.25%	97.99%	1.20%	8.58%	0.05%
自基金合同生效起至2006年12月31日	95.35%	1.18%	91.80%	1.18%	3.55%	0.00%

2. 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3. 基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图例



(三)收益分配情况

年度	每10份基金份额分红数	备注
2004年	-	
2005年	-	
2006年	0.8	2006年4月27日每10份派现金红利0.3元 2006年5月22日每10份派现金红利0.5元

三、基金管理人报告

(一)基金管理人简介

光大保德信基金管理有限公司(以下简称"光大保德信"或"公司")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,两家股东分别持有67%和33%的股份。公司主要从事基金发起、设立和管理业务,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2006年12月31日止,公司旗下管理着四只开放式基金,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和光大保德信新增长股票型证券投资基金。

(二)基金经理简介

常昊先生,硕士。1993年毕业于西北大学数学专业,1997年获陕西财经学院经济硕士学位。1997年9月至1999年4月在上海申华实业股份有限公司任投资部经理,1999年5月至2000年7月在申银万国证券公司任研究员,2000年7月至2004年3月任长盛基金管理有限公司基金经理。自2004年8月起担任本基金基金经理,自2006年9月起兼任光大保德信新增长股票型证券投资基金基金经理。现任本基金管理人的权益证券投资总监兼本基金基金经理、光大保德信新增长股票型证券投资基金基金经理。

(三)基金运作的遵规守信情况说明

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。

2006年2月10日、3月27日、4月13日至18日、4月24日、5月8日至11日、5月22日、5月24日、6月20日至22日、7月6日、7月26日至28日、10月9日、12月18日共22个交易日,本基金因市场波动及大量赎回的影响,导致股票投资比例超过基金合同关于股票投资比例不得超过95%的限制。本基金管理人发现后积极采取措施,托管人也进行了相应提醒,上述投资比例已在法定期限内调整到规定范围之内。

(四)基金投资策略和业绩表现说明

2006年量化核心基金的净值增长率为122.98%,同期业绩比较基准增长率为111.41%,超额收益率为11.57%。由于量化核心基金采用资产配置恒定的策略,同时因为部分仓位受不可控因素的影响,超额收益的主要来源为个股选择和行业配置。本基金2006年的运作达到了为投资者获得稳定的超额回报的业绩目标。

(五)宏观经济、证券市场、行业走势及投资管理展望

1、宏观经济展望

2007年的宏观经济走势整体上仍将持续向好。出口、投资和消费将对经济增长构成比较强的支撑。出口方面,由于目前我国外向型经济的优势基础未发生根本性转变,主要的出口产品包括机电、机械、纺织产品等虽然在07年会受到外部环境的影响,但其内在比较优势仍未发生根本性改变,因此仍将保持较快增长。同时,2007年的信贷增长预计仍将保持在较高速度,而与此同时,各种融资渠道的拓展也将带动各投资主体的投资行为。固定资产投资增速有望继续维持20%以上的增长。而从消费来看,目前消费主要是通过人口结构变迁、全球产业转移以及消费倾向提高等途径对经济增长施加影响的,而这也是我国经济生活中消费变化的一个大趋势。综合以上因素,在07年预期固定资产投资增长、持续的强劲出口和长期向好的消费行为的带动下,我国明年的经济仍具有长期的增长空间,全年GDP增速应该仍会保持在10%左右的增长水平。

2、证券市场展望

本轮牛市背后的支撑因素既有制度改革因素,又有高速成长的宏观经济因素。展望2007年,制度改革将进一步深化,股权分置改革完成后,股东利益的一致性将推动上市公司治理结构不断改善,管理层股权激励全面展开,控股股东整体上市预期愈加强烈。存量、增量资产的内生和外延式增长将继续推进上市公司基本面的重大变化不断孕育出新的投资机会。而本币升值所带来的充裕的流动性将持续刺激资本市场的繁荣,在这样一个大背景下,证券市场在2007年将持续呈现牛市特征。

回头看已经过去的2006年,我们认为虽然股指上涨幅度巨大,但是考虑到实体经济发展的巨大潜力,市场只是度过了牛市初期的价值重估阶段,随着中国各产业的龙头企业陆续以各种方式回归A估,中国证券市场将更直接受益于一个正在实现崛起的大国经济自身的动力,而全球经济的稳定表现也为中国经济提供了较好的外部环境,因此实体经济强劲表现将支撑07年的中国股票市场依然有较好的表现,但预计波动幅度将小于2006年。

在市场整体估值水平都有较大提高的情况下,具备良好的成长性的上市公司将成为2007年本基金投资的主题,如果把价值低估比喻成洼地,而把成长性看做高峰的话,07年我们更愿意去翻越一座座山峰。

3、重点行业展望

在2007年我们重点关注于受益于消费升级和产业升级的行业。围绕着越来越富裕的城市消费者的衣、食、住、行、娱乐和理财等方面,我们认为具有品牌优势和定价能力的公司还将具有长期增长的空间,这些行业包括食品饮料、地产、银行和保险、商业、旅游等。其中具有核心竞争能力的企业具有长期投资价值,这些公司也一直是本基金配置的重点。产业升级是经济发展的必然产物,而在人民币升值的背景下升级的速度正在加快,在机械行业、技术型行业中这种现象越来越明显,具有技术实力推动产品升级、能够提高行业集中度、具有品牌和渠道优势、PEG合理的公司将是我们投资的重点。

4、投资管理展望

展望07年,量化核心基金将坚定既有的成长型投资策略。基本面良好、PEG估值合理、公司治理结构稳定的上市公司是重点投资的对象。在行业和风格配置方面采用较均衡的策略,个股集中度将有所下降。本基金管理人将勤勉尽责,争取为基金持有人获取较好的回报。

四、基金托管人报告

本基金托管人——中国光大银行,依据《光大保德信量化核心证券投资基金基金合同》和《光大保德信量化核心证券投资基金托管协议》,托管光大保德信量化核心证券投资基金。

2006年度,中国光大银行在光大保德信量化核心证券投资基金托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定,依法安全保管了基金的全部资产,对光大保德信量化核心证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督,及时向基金管理人提出了意见和建议,按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告,没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为,诚实信用、勤勉尽责地履行了作为托管人所应尽的义务。

2006年度,中国光大银行依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定,对基金管理人——光大保德信基金管理有限公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督,未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求,各重要方面的运作能够严格按照基金合同的规定进行。

本托管人依法对基金管理人——光大保德信基金管理有限公司编制的"光大保德信量化核心证券投资基金2006年度报告"进行了复核,认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容是真实、准确和完整的。

中国光大银行
2007年3月22日

五、审计报告

本基金2006年年度财务会计报告经安永大华会计师事务所有限公司审计,注册会计师签字出具了安永大华业字(2007)第057号标准无保留意见的审计报告。

六、财务会计报告

(一)基金会计报表

1、资产负债表

(除特别注明外,金额单位为人民币元)			
	附注	2006年12月31日	2005年12月31日
资产			
银行存款	1	37,149,852.81	118,456,823.44
清算备付金		830,061.52	986,372.33
交易保证金		1,500,000.00	1,685,716.00
应收证券清算款		261,732.95	-
应收股利		-	-
应收利息	2	9,157.14	24,559.47
应收申购款		43,382.52	-
其他应收款		-	-
股票投资市值	3	480,659,364.63	1,193,345,372.05
其中:股票投资成本	3	322,235,988.66	1,158,483,070.23
债券投资市值		-	-
其中:债券投资成本		-	-
权证投资	4	5,301,900.00	
其中:权证投资成本	4	1,035,080.19	-
买入返售证券		-	-
待摊费用		-	-
其他资产		-	-
资产合计		525,755,451.57	1,314,498,843.29
负债及持有人权益			
负债			
应付证券清算款		6,127,650.19	8,834,454.72
应付赎回款		403,366.08	3,184,354.44
应付赎回费		414.91	5,410.16
应付管理人报酬	VI	610,988.81	1,648,436.15
应付托管费	VI	101,831.49	274,739.36
应付佣金	5	676,499.59	526,645.14
应付利息		-	-
应付收益		-	-
未交税金		-	-
其他应付款	6	750,000.00	1,000,000.00
卖出回购证券款		-	-
短期借款		-	-
预提费用	7	460,000.00	100,000.00
其他负债		-	-
负债合计		9,130,751.07	15,574,039.97
持有人权益			
实收基金	8	282,528,048.49	1,482,654,153.80
未实现利得/(损失)	9	52,867,048.95	48,444,352.53
未分配收益/(损失)		181,229,603.06	-232,173,703.01
持有人权益合计		516,624,700.50	1,298,924,803.32
负债与持有人权益总计		525,755,451.57	1,314,498,843.29
每单位基金净值		1.8286	0.8761

2、经营业绩表及收益分配表

(除特别注明外,金额单位为人民币元)			
项目	附注	2006年度	2005年度
收入		450,136,750.94	-254,715,137.58
股票差价收入	10	420,056,379.77	-317,160,077.25
债券差价收入	11	-	6,051,689.46
权证差价收入	12	21,408,655.12	18,748,436.18
债券利息收入		-	1,621,156.53
存款利息收入		599,781.03	1,748,933.84
股利收入		7,117,052.46	33,421,554.81
买入返售证券收入		-	138,052.00
其他收入	13	954,882.56	715,116.85
费用		12,889,293.00	28,726,807.32
基金管理人报酬	VI	10,638,098.92	24,169,191.47
基金托管费	VI	1,773,016.58	4,028,198.57
卖出回购证券利息支出		-	137,850.00
利息支出		-	-
其他费用	14	478,177.50	391,567.28
其中:上市年费		-	-
信息披露费		360,000.00	267,072.83
审计费用		100,000.00	100,000.00
基金净收益/(损失)		437,247,457.94	-283,441,944.90
加:未实现利得/(损失)		127,827,893.96	137,899,317.06
基金经营业绩		565,075,351.90	-145,542,627.84

3、收益分配表

(除特别注明外,金额单位为人民币元)			
项目	附注	2006年度	2005年度
本期基金净收益/(损失)		437,247,457.94	-283,441,944.90
加:期初基金净收益/(损失)		-232,173,703.01	-12,631,274.19
加:本期损益平准金		16,296,266.08	63,899,516.08
可供分配基金净收益		221,370,021.01	-232,173,703.01
减:本期已分配基金净收益	15	40,140,417.95	-
期末基金净收益/(损失)		181,229,603.06	-232,173,703.01

4、基金净值变动表

(除特别注明外,金额单位为人民币元)			
项目	附注	2006年度	2005年度
一、期初基金净值		1,298,924,803.32	1,924,610,187.53
二、本期经营活动:			
基金净收益/(损失)		437,247,457.94	-283,441,944.90
未实现利得/(损失)		127,827,893.96	137,899,317.06
经营活动产生的基金净值变动数		565,075,351.90	-145,542,627.84
三、本期基金单位交易:			
基金申购款		347,499,949.83	189,512,149.30
基金赎回款		-1,654,734,986.60	-669,654,905.67
基金单位交易产生的基金净值变动数		-1,307,235,036.77	-480,142,756.37
四、本期向持有人分配收益:			
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数		-40,140,417.95	-
五、期末基金净值		516,624,700.50	1,298,924,803.32

(二)会计报表附注

(I)基金基本情况

光大保德信量化核心证券投资基金(以下简称"本基金"),系经中国证券监督管理委员会证监基金字(2004)85号文《关于同意光大保德信量化核心证券投资基金设立的批复》的核准,由光大保德信基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集,基金合同于2004年8月27日正式生效,首次设立募集规模为2,544,287,215.94份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记人为光大保德信基金管理有限公司,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

(II)会计报表编制基础

本基金的财务报表系按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、基金合同、中国证券监督管理委员会颁布的《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

(III)主要会计政策

1. 会计年度:自公历1月1日至12月31日

比较会计报表的实际期间:2005年1月1日至2005年12月31日止期间

2. 记账本位币:人民币

3. 记账基础和计价原则

以权责发生制为记账基础,除股票投资、债券投资和权证按市值计价外,其余报表项目均以历史成本计价。

4. 基金资产的估值方法

(1)上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值;该日无交易的证券,以最近一个交易日的收盘价估值;

(2)未上市的股票的估值

送股、转增股、增发新股或配股的股票,以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的收盘价估值,该日无交易的,以最近一个交易日的收盘价计算;

首次公开发行的股票,按其成本价估值;

(3)非公开发行的股票的估值

根据基金部通知[2006]37号文《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》,2006年11月13日前投资的非公开发行的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值;该日无交易的证券,以最近一个交易日的收盘价计算;2006年11月13日后投资的非公开发行的股票按以下方法估值:

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票的初始取得成本时,应采用在证券交易所上市交易的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值;

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票的初始取得成本时,应按以下公式确定估值日该非公开发行股票的价值:

$FV=C+(P-C)\times(Dl-Dr)/Dl$

(其中:FV为估值日该非公开发行股票的价值;C为该非公开发行股票的初始取得成本;P为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价;Dl为该非公开发行股票锁定期所含的交易天数;Dr为估值日剩余锁定期,即估值日至锁定期结束所含的交易天数,不含估值日当天);

(4)上市债券以不含息价格计价,按估值日证券交易所挂牌的收盘价计算后的净价估值;该日无交易的,以最近交易日净价估值,并按债券面值与票面利率扣除应由债券发行单位代扣代缴的个人所得税后在债券持有期间内逐日计提利息;

(5)未上市债券和在银行间同业市场交易的债券以不含息价格计价,按成本估值,并按债券面值与票面利率扣除应由债券发行单位代扣代缴的个人所得税后在债券持有期间内逐日计提利息;

(6)上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值;该日无交易的权证,以最近一个交易日的收盘价计算;

(7)未上市流通的权证,由基金管理人和托管人综合考虑市场情况、标的股票价格、行权价格、剩余期限、市场无风险利率、标的股票价格波动等因素,按照最能反映权证公允价值的价格估值;

(8)配股权证,从配股除权日到配股确认日止,按收盘价高于配股价的差额估值;如果收盘价等于或低于配股价,则估值额为零;

(9)如遇特殊情况而无法或不宜以上述方法确定资产价值时,或有确凿证据表明按上述方法不能客观反映基金资产公允价值的,基金管理人可根据具体情况,在与基金托管人商议后,按最能反映基金资产公允价值的方法估值;

(10)如国家对证券投资基金资产估值方法有新增规定或变更事项,按国家最新规定估值。

5.证券投资的成本计价方法

(1)股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资,股票投资成本按成交日应支付的全部价款入帐;因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价,于股权分置改革方案实施后的股票复牌日,冲减股票投资成本;

卖出股票于成交日确认股票差价收入/(损失),出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(2)债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资按成交日应支付的全部价款入帐,其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,作为应收利息单独核算,不构成债券投资成本;

买入银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资。债券投资按实际支付的全部价款入帐,其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,作为应收利息单独核算,不构成债券投资成本;

买入央行票据和零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,按上述会计处理方法核算;

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券差价收入/(损失);卖出银行间同业市场交易的债券于实际收到全部价款时确认债券差价收入/(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

(3)权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资,权证投资成本按成交日应支付的全部价款入帐;

配股权证及由股权分置改革而被动获得的权证,在确认日记录所获分配的权证数量,该等权证初始成本为零;

卖出权证于成交日确认权证差价收入/(损失),出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

6. 收入的确认和计量

(1)股票差价收入于卖出股票成交日确认,并按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额入账;

(2)债券差价收入

卖出交易所上市债券:于成交日确认债券差价收入,并按应收取的全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额入账;

卖出银行间同业市场交易债券:于实际收到价款时确认债券差价收入,并按实际收到的全部价款与其成本、应收利息的差额入账;

(3)权证差价收入于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交总额与其成本和相关费用的差额入账;

(4)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提;

(5)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账;若提前支取定期存款,按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入,并根据提前支取所实际收到的利息收入与帐面已确认的利息收入的差额确认利息损失,列入利息收入减项,存款利息收入以净额列示;

(6)股利收入于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;

(7)买入返售证券收入按融出资金额及约定利率,在证券持有期内采用直线法逐日计提的金额入账;

(8)其他收入于实际收到时确认收入。

7. 费用的确认和计量

(1)基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率逐日计提;

(2)基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提;

(3)卖出回购证券支出按融入资金额及约定利率,在回购期限内采用直线法逐日计提;

(4)其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第五位的,则采用待摊或预提的方法。

8. 基金申购、赎回的确认

(1)确认申购份数时,保留小数点后两位,小数点两位以后的部分舍去,舍去部分所代表的资产归基金所有。

基金申购费用=申购金额×申购费率

净申购金额=申购金额-申购费用

=实收基金+未实现利得平准金+损益平准金

申购份额=净申购金额/交易日基金份额净值

实收基金=申购份额×1元

未实现利得平准金=(交易日未实现利得/交易日净资产)×净申购金额

损益平准金=(交易日未分配利润/交易日净资产)×净申购金额

投资者选择红利自动再投资,不收取申购费用。

(2)确认赎回总额时,保留小数点后两位,小数点两位以后的部分舍去,舍去部分所代表的资产归基金所有。

赎回总额=赎回份额×交易日基金单位净值

=实收基金+未实现利得平准金+损益平准金

实收基金=赎回份额×1元

未实现利得平准金=(交易日未实现利得/交易日净资产)×赎回总额

损益平准金=(交易日未分配利润/交易日净资产)×赎回总额

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

(3)交易日的基金单位净值在当天收市后计算。

9. 基金的收益分配政策

(1)每一基金份额享有同等收益分配权;

(2)基金当年收益须先弥补上一年度亏损后,方可进行当年收益分配;

(3)如果基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配;

(4)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;

(5)在符合基金分配条件的前提下,基金收益分配每年至少一次,但若基金合同生效不满3个月,收益可不分配,年度分配在基金会计年度结束后的4个月内完成;

(6)本基金收益分配方式分为两种:现金分红与红利再投资,本基金默认的收益分配方式是现金分红。投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;

(7)红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用由基金份额持有人自行承担。当基金份额持有人的现金红利不足以支付银行转账或其他手续费用时,基金注册登记人可将投资者的现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额。自动再投资的计算方法,依照《光大保德信基金管理有限公司开放式基金注册登记业务规则》及相关制度的有关规定执行;

(8)法律、法规或监管机构另有规定的,从其规定。

(IV)税项

(1)印花税

根据财政部、国家税务总局财税字[2006]11号文《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》,自2006年1月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的2‰调整为1‰。

(2)营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税。

(3)个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》,对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入,由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴20%的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税字[2006]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2006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[2006]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。

(V)本报告期无重大会计差错

(VI)年末持有的流通受限的股票

a. 因网下新股申购而流通受限的股票

股票代码	股票名称	数量	投资成本	年末估值单价	年末估值总额	可流通日期(年/月/日)	开盘单价
601628	中国人寿	11,025	208,152.00	18.88	208,152.00	2007/04/09	N/A

b. 因股权分置改革而流通受限的股票

股票代码	股票名称	数量	投资成本	年末估值单价	年末估值总额	可流通日期(年/月/日)	开盘单价
000895	S双汇	900,000	10,859,172.25	31.17	28,053,000.00	尚未确定	N/A

除此之外,无因其他原因导致年末持有的股票流通受限的情况。

(VII)关联方关系及其交易

1. 关联方关系

企业名称	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、基金发起人 注册登记人、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
光大证券股份有限公司("光大证券")	基金管理人的股东、基金代销机构
保德信投资管理有限公司	基金管理人的股东

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 通过关联方席位进行的交易

(a). 股票投资

关联方名称	2006年1月1日至12月31日止期间		2005年1月1日至12月31日止期间	
	成交金额	占报告期总成交金额的比例	成交金额	占报告期总成交金额的比例
光大证券	1,129,660,278.57	27.97%	927,283,011.06	28.56%

(b). 权证投资

关联方名称	2006年1月1日至12月31日止期间		2005年1月1日至12月31日止期间	
	成交金额	占报告期总成交金额的比例	成交金额	占报告期总成交金额的比例
光大证券	6,795,150.16	19.26%		

(c). 佣金

	2006年度			
佣金	年佣金	占全年佣金总量的比例	年末余额	占应付佣金余额的比例
光大证券	911,876.12	27.88%	163,150.44	24.12%
	2005年度			
佣金	年佣金	占全年佣金总量的比例	年末余额	占应付佣金余额的比例
光大证券	748,257.84	28.66%	285,688.66	54.25%

注:(1)上述佣金已扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的由券商承担的证券结算风险基金。

(2)股票交易佣金为成交金额的1‰扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、买(卖)证管费和证券结算风险基金等);证券公司不向本基金收取国债现券及国债回购和企业债券的交易佣金,但交易的经手费和证管费由本基金交纳,其所计提的证券结算风险基金从支付给证券公司的股票交易佣金中扣除。佣金的比率是公允的,符合证监会有关规定。管理人因此从关联方获得的服务主要包括:为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

3. 与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金自2005年1月1日至2005年12月31日止期间及2006年度均未通过银行间同业市场与关联方进行债券(含回购)交易。

4. 基金管理人及托管人报酬

(1)基金管理人报酬——基金管理费

a. 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

b. 基金管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

项目	2006年1月1日至12月31日止期间	2005年1月1日至12月31日止期间
期初余额	1,648,436.15	2,530,937.15
本期计提	10,638,098.92	24,169,191.47
本期支付	11,675,546.26	25,051,692.47
期末余额	610,988.81	1,648,436.15

(2)基金托管人报酬——基金托管费

a. 支付基金托管人中国光大银行的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

b. 基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

项目	2006年1月1日至12月31日止期间	2005年1月1日至12月31日止期间
期初余额	274,739.36	421,822.85
本期计提	1,773,016.58	4,028,198.57
本期支付	1,945,924.45	4,175,282.06
期末余额	101,831.49	274,739.36

(3)由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行股份有限公司保管,并按银行间同业利率计息。由基金托管人保管的银行存款余额及产生的利息收入如下:		
项目	2006年12月31日止	2005年12月31日止
银行存款余额	37,149,852.81	118,456,823.44
项目	2006年1月1日至12月31日止期间	2005年1月1日至12月31日止期间
银行存款产生的利息收入	500,079.85	1,681,695.40

5. 关联方持有基金份额

(1)基金管理人所持有的本基金份额

	2006年度
年初持有基金份额	-
加:本年转入	8,155,126.01
其中:基金分红再投资	-
减:本年赎回	-
年末持有实收基金	8,155,126.01
占年末基金总份额的比例	2.89%
转入费	1,000元

光大保德信基金管理有限公司于2006年8月10日通过代销机构将其以固有资金投资的光大保德信货币市场基金1,000万份转换为本基金。

(2)基金托管人、基金管理人主要股东及其控制的机构所持有的本基金份额

本基金的基金托管人、基金管理人主要股东及其控制的机构于2006年年及2005年末均未持有本基金份额。

V. 或有事项

无需要说明的重大或有事项。

VI. 承诺事项

无需要说明的承诺事项。

VII. 资产负债表日后的非调整事项

无需要说明的资产负债表日后的非调整事项。

VIII. 其他重要事项

无需要说明的其他重要事项。

IX. 会计报表的批准

本会计报表及附注已于2007年3月22日经本基金管理人批准。

七、投资组合报告

(一)基金资产组合情况

	期末市值(元)	占基金总资产的比例
股票	480,659,364.63	91.42%
债券	-	-
权证	5,301,900.00	1.01%
银行存款和清算备付金	37,979,914.33	7.22%
其他资产	1,814,272.61	0.35%
合计	525,755,451.57	100.00%

(二)按行业分类的股票投资组合

行业分类	市值(元)	占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	0.00	0.00%
B 采掘业	20,769,450.24	4.02%
C 制造业	206,537,936.70	39.98%
C0 食品、饮料	81,599,684.70	15.79%
C1 纺织、服装、皮毛	4,495,000.00	0.87%
C3 造纸、印刷	1,226,700.00	0.24%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	8,220,000.00	1.59%
C6 金属、非金属	57,977,500.00	11.22%
C7 机械、设备、仪表	53,019,052.00	10.26%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00%
E 建筑业	11,208,589.68	2.17%
F 交通运输、仓储业	41,593,405.00	8.05%
G 信息技术业	66,124,831.01	12.80%
H 批发和零售贸易	25,518,000.00	4.94%
I 金融、保险业	53,012,152.00	10.26%
J 房地产业	18,528,000.00	3.59%
K 社会服务业	0.00	0.00%
L 传播与文化产业	0.00	0.00%
M 综合类	37,367,000.00	7.23%
合计	480,659,364.63	93.04%

(三)报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

2006年12月31日

序号	股票代码	股票名称	期末数量(股)	期末市值(元)	占基金资产净值比例
1	600973	宝胜股份	3,074,731	39,079,831.01	7.56%
2	000895	S双汇	900,000	28,053,000.00	5.43%
3	600036	招商银行	1,600,000	26,176,000.00	5.07%
4	600887	伊利股份	900,000	23,850,000.00	4.62%
5	002028	思源电气	710,000	21,236,100.00	4.11%
6	600028	中国石化	2,277,352	20,769,450.24	4.02%
7	600415	小商品城	250,000	19,375,000.00	3.75%
8	600761	安徽合力	870,000	19,357,500.00	3.75%
9	601006	大秦铁路	2,330,050	18,873,405.00	3.65%
10	000002	万 科 A	1,200,000	18,528,000.00	3.59%

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《光大保德信量化核心证券投资基金2006年年度报告》正文。

(四)股票投资组合的重大变动

1、报告期内累计买入价值超出期初基金资产净值2%的股票明细如下(至少前20名):

股票代码	股票名称	买入出累计金额	占期初基金资产净值比例
600050	中国联通	55,446,851.88	4.27%
000063	中兴通讯	49,467,087.83	3.81%
600973	宝胜股份	33,822,787.87	2.60%
600636	三爱富	32,390,144.88	2.49%
600005	武钢股份	31,143,527.97	2.40%
600361	华联综超	29,651,950.97	2.28%
000538	云南白药	28,593,166.36	2.20%
600489	中金黄金	28,557,141.05	2.20%
600331	宏达股份	28,496,920.83	2.19%
600761	安徽合力	28,283,976.96	2.18%
600205	S山东铝	27,617,304.35	2.13%
000061	农 产 品	26,647,598.19	2.05%
601006	大秦铁路	25,168,335.09	1.94%
600895	张江高科	24,631,627.25	1.90%
600104	上海汽车	23,129,967.65	1.78%
000625	长安汽车	21,720,236.33	1.67%
000002	万 科 A	20,999,168.50	1.62%
000839	中信国安	20,064,525.05	1.54%
600028	中国石化	19,925,633.25	1.53%
600456	宝钛股份	19,438,074.03	1.50%

2、报告期内累计卖出金额超出期初基金净值2%的股票明细如下:

股票代码	股票名称	卖出累计金额	占基金资产净值比例
600036	招商银行	100,638,057.25	7.75%
000063	中兴通讯	88,567,462.17	6.82%
600050	中国联通	88,262,031.08	6.80%
000002	万 科 A	86,368,531.66	6.65%
600028	中国石化	86,278,078.24	6.64%
600900	长江电力	78,126,933.89	6.01%
600009	上海机场	61,685,461.30	4.75%
600887	伊利股份	54,983,745.24	4.23%
600519	贵州茅台	53,502,810.64	4.12%
600000	浦发银行	52,007,734.95	4.00%
600832	东方明珠	47,760,773.80	3.68%
600019	宝钢股份	45,340,879.04	3.49%
600037	歌华有线	44,469,522.84	3.42%
000538	云南白药	43,326,217.89	3.34%
600104	上海汽车	42,435,571.33	3.27%
600879	火箭股份	40,416,962.63	3.11%
600489	中金黄金	38,104,421.42	2.93%
000858	五 粮 液	37,745,368.45	2.91%
600018	上港集团	37,619,479.75	2.90%
600694	大商股份	37,488,405.62	2.89%

3、报告期内买入股票成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票成本总额	1,392,571,215.16
卖出股票收入总额	2,224,068,132.31

(五)按券种分类的债券投资组合

债券类别	债券市值(元)	占基金资产净值的比例
国家债券投资	-	-
央行票据投资	-	-
金融债券投资	-	-
企业债券投资	-	-
可转债投资	-	-
债券投资合计	-	-

(六)按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	名称	市值(元)	占基金资产净值的比例
1	-	-	-

(七)投资组合报告附注

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。

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。

3、其他资产构成:

序号	其他资产	金额(元)
1	交易保证金	1,500,000.00
2	应收利息	9,157.14
3	证券清算款	261,732.95
4	应收申购款	43,382.52
	合计	1,814,272.61

4、报告期末本基金无投资处于转股期的可转换债券。

5、权证投资:

(1).报告期末持有权证明细:

权证名称	代码	持有数量(份)	成本总额(元)	备注
伊利CWB1	580009	300,000	1,035,080.19	此成本为平均成本

(2).报告期内持有权证明细:

权证名称	代码	持有数量(份)	成本总额(元)	持有原因
伊利CWB1	580009	300,000	-	送配权证
伊利CWB1	580009	100,000	1,380,106.92	主动投资
长电CWB1	580007	1,700,000	6,075,000.81	主动投资
合计		2,100,000	7,455,107.73	

八、基金份额持有人户数、持有人结构

持有基金份额/比例				持有人户数	户均持有份额(份)
个人(份)	比例	机构(份)	比例		
41,158,940.54	14.57%	241,369,107.95	85.43%	1352	208,970.45

九、开放式基金份额变动

基金合同生效日的基金份额总额	2,544,287,215.94
本报告期初基金总份额	1,482,654,153.80
加:本期基金总申购份额	254,136,243.39
转换入基金总份额	46,550,563.70
分红再投资总份额	5,337,708.29
减:本期基金总赎回份额	1,505,058,878.93
转换出基金总份额	1,091,741.76
本报告期末基金总份额	282,528,048.49

十、重大事件揭示

(一)基金份额持有人大会决议:

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

(二)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:

经光大保德信基金管理有限公司(以下简称"公司")三届四次董事会审议通过,同意由首席运营总监梅雷军先生兼任公司副总经理。梅雷军先生的副总经理任职资格已获中国证监会核准。(《光大保德信基金管理有限公司关于梅雷军先生兼任公司副总经理的公告》信息披露报纸:上海证券报、中国证券报、证券时报,披露日期:2006年11月22日)。

经光大保德信基金管理有限公司三届六次董事会审议通过,同意由首席市场总监梅键先生、首席投资总监袁宏隆先生兼任公司副总经理。梅键、袁宏隆先生的副总经理任职资格已获中国证监会核准(《光大保德信基金管理有限公司关于梅键、袁宏隆先生兼任公司副总经理的公告》信息披露报纸:上海证券报、中国证券报、证券时报,披露日期:2007年2月9日)。

本基金托管人的专门基金托管部门在报告期内未发生重大人事变动。

(三)涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

(四)基金投资策略的改变:

本报告期本基金投资策略无改变。

(五)基金收益分配事项:

	分红公告日	权益登记日	每10份基金份额收益分配金额(元)	收益分配金额(元)
2006年度第1次分红	2006年4月24日	2006年4月27日	0.30	16,053,339.22
2006年度第2次分红	2006年5月18日	2006年5月22日	0.50	24,087,078.73

(六)本基金的会计师事务所的情况:

报告期内,本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所情况,报告年度支付给聘任安永大华会计师事务所的报酬情况是十万元,目前该审计机构已提供审计服务的连续年限2年。

(七)基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情形: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。

(八)基金租用证券公司专用交易席位的有关情况:

1、报告期内租用各证券公司席位进行的证券成交量统计

证券公司名称	租用席位数量	股票成交金额	占总成交额的比例	权证成交金额	占总成交额的比例	佣金	占佣金总量的比例
光大证券	2	1,129,660,278.57	27.97%	6,795,150.16	19.26%	911,876.12	27.88%
国泰君安	1	256,593,409.88	6.35%	1,020,000.00	2.89%	200,786.61	6.14%
海通证券	1	213,169,335.54	5.28%	-	-	174,798.49	5.34%
平安证券	1	213,163,767.66	5.28%	-	-	166,802.09	5.10%
申银万国	1	753,255,399.82	18.65%	14,659,215.66	41.54%	617,668.09	18.88%
银河证券	1	231,977,751.22	5.74%	-	-	181,524.32	5.55%
中金公司	1	788,634,045.31	19.53%	7,454,530.02	21.13%	646,677.90	19.77%
中信证券	1	314,558,673.73	7.78%	5,356,551.25	15.18%	257,937.47	7.88%
中银国际	1	138,032,264.05	3.42%	-	-	113,185.26	3.46%
合计		4,039,044,925.78	100.00%	35,285,447.09	100.00%	3,271,256.35	100.00%

2、报告期内未租用各证券公司席位进行的债券和债券回购成交量。

3、专用席位的选择标准和程序

1)选择使用基金专用席位的证券经营机构的选择标准

基金管理人负责选择证券经营机构,选用其专用交易席位供本基金买卖证券专用,选择交易席位制度体现了我们团队化的投资程序。选用标准为:

- ●实力雄厚,信誉良好,注册资本不少于3亿元人民币。
- ●财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- ●经营行为规范,近两年未发生重大违规行为而受到证监会处罚。
- ●内部管理规范、严格,具备健全的内部控制制度,并能满足基金运作高度保密的要求。
- ●具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求,并能为本基金提供全面的信息服务。
- ●研究实力较强,有固定的研究机构和专门的研究人员,能及时为本基金提供高质量的咨询服务。
- ●能够为满足投资团队的每一位成员的要求。
- ●对于某一领域的研究实力超群,或是能够提供全方面,高质量的服务。

基金管理人按照以上标准进行考察后确定证券交易机构的选择,与被选择的证券经营机构签订协议,报中国证监会备案并通知基金托管人。

2)选择使用基金专用席位的证券经营机构的程序

- ●投资团队成员选择3到10个证券经营机构,根据各证券经营机构所提供的各类研究报告和信息资讯进行综合评价,包括研究报告的覆盖面、观点的说服力、支持观点的论点质量、分析方式的独创性某一领域内的专长和提供信息、数据及研究的及时性。
- ●任何一个机构在任何一个评估因素不得获得一位成员40票以上或10票以下的投票。
- ●根据投票情况得出算术平均。
- ●在一般情况下,单个券商所获得的总有效票数应在5%至30%之间。

一个普通的证券经营机构无法获得高投票率,除非其能够提供及时服务。能够不断创新或在某一领域有特殊专长的证券经营机构比一个仅仅具有广覆盖面的证券经营机构更容易得到高投票率。

此套经过缜密严谨的选用机制反映了我们的投资程序,证券经营机构对我们的交易执行判断影响有限。同时,我们量化程序具有覆盖面广的优点。证券经营机构可以在两方面为我们提供增值服务:收集可供我们进行量化分析的数据以及深入的定性分析。

团队成员将投票结果汇集到投资副总监计算整体投票结果,由投资总监对最终投票结果做整体把握,并将其转换为委托目标要求的百分比形式。

(九)其他在报告期内发生的重大事件(披露在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和本基金管理人公司网站上):

1. 2006年1月10日,基金管理人刊登《光大保德信基金管理有限公司关于变更基金代销机构的公告》,原华夏证券股份有限公司名称变更为中信建投证券有限责任公司。

2. 2006年1月12日,基金管理人刊登《光大保德信基金管理有限公司关于推出开放式基金网上交易业务的公告》。

3. 2006年2月22日,基金管理人刊登《光大保德信基金管理有限公司关于旗下光大保德信量化核心证券投资基金暂停申购和转入业务的公告》。

4. 2006年2月24日,基金管理人刊登《光大保德信基金管理有限公司关于旗下光大保德信量化核心证券投资基金重新开放申购和转入业务的公告》。

5. 2006年4月13日,基金管理人刊登《光大保德信量化核心证券投资基金更新招募说明书》及摘要。

6. 2006年4月13日,基金管理人刊登《光大保德信基金管理有限公司关于旗下光大保德信量化核心证券投资基金暂停大额申购及转入业务的公告》。

7. 2006年4月24日,基金管理人刊登《光大保德信基金管理有限公司关于量化核心证券投资基金2006年度第一次分红公告》,每10份基金份额派发现金红利0.3元。

8. 2006年4月27日,基金管理人刊登《光大保德信基金管理有限公司关于旗下光大保德信量化核心证券投资基金重新开放大额申购及转入业务的公告》。

9. 2006年5月18日,基金管理人刊登《光大保德信基金管理有限公司关于量化核心证券投资基金2006年度第二次分红公告》,每10份基金份额派发现金红利0.5元。

10.2006年6月28日,基金管理人刊登《光大保德信基金管理有限公司关于新增平安证券为光大保德信量化核心证券投资基金代销机构的公告》,自2006年6月30日起平安证券有限责任公司代理销售本基金。

11.2006年6月28日,基金管理人刊登《光大保德信基金管理有限公司关于旗下基金申购费率优惠活动的公告》,在2006年6月30日至2006年7月30日止的正常交易日,凡购买本基金的投资者(仅适用于前端收费)均享受正常申购费率6折的优惠。

12.2006年7月22日,基金管理人刊登《光大保德信基金管理有限公司关于新增代销机构的公告》,自2006年7月22日起招商银行代理销售本基金。

13.2006年8月5日,基金管理人刊登《光大保德信基金管理有限公司关于增加基金定期定额申购业务和基金转换业务销售机构的公告》,自2006年8月7日起中国光大银行、平安证券有限责任公司、山西证券有限责任公司开通本基金及光大保德信货币市场基金定期定额申购业务和基金转换业务。

14.2006年8月8日,基金管理人刊登《关于将公司固有资金投资旗下的货币基金部分转换为旗下量化核心基金的公告》,光大保德信基金管理有限公司于2006年8月10日通过代销机构将其以固有资金投资的光大保德信货币市场基金1,000万份转换为量化核心基金。

15.2006年10月11日,基金管理人刊登《光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书(更新)摘要》。

16.2006年11月1日,基金管理人刊登《光大保德信管理有限公司关于旗下所有股票型基金在交通银行开展网上银行申购费率优惠活动的公告》,投资者通过交通银行网上银行申购开放式基金(前端模式)的申购费率实行优惠费率。

17. 2006年11月22日,基金管理人刊登《光大保德信基金管理有限公司关于梅雷军先生兼任公司副总经理的公告》。

18.2006年12月22日,基金管理人刊登《光大保德信基金管理有限公司关于旗下量化核心证券投资基金暂停大额申购及转入业务的公告》,自2006年12月22日起,暂停光大保德信量化核心证券投资基金单笔金额在人民币50万元以上(不含50万元)的申购和从我司管理的其他开放式基金单笔金额50万元以上(不含50万元)转入上述基金的业务,且单个基金账户对单只基金日累计申购及/或转入金额不得超过50万元。

十一、年度报告备查文件目录

(一)本基金备查文件目录

1、中国证监会批准光大保德信量化核心证券投资基金设立的文件

2、光大保德信量化核心证券投资基金基金合同

3、光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书

4、光大保德信量化核心证券投资基金托管协议

5、光大保德信量化核心证券投资基金法律意见书

6、光大保德信量化核心证券投资基金财务报表及报表附注

7、基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程

8、基金托管人业务资格批件和营业执照

9、中国证监会要求的其他文件

(二)存放地点及查阅方式

1、查阅地址:中国上海市延安东路222号外滩中心大厦46层

2、网址:http://www.epf.com.cn

光大保德信基金管理有限公司
2007年3月30日