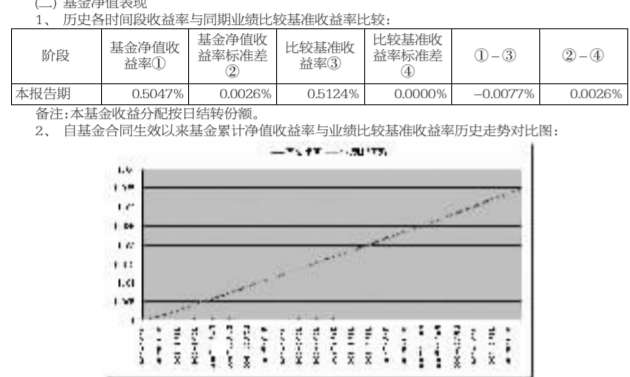


一、重要提示: 本基金管理人及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

二、基金产品概况 (一)基金概况 基金名称:光大货币 基金运作方式:契约型开放式 基金合同生效日:2006年6月9日 报告期末基金份额总额:756,929,067.39份

三、主要财务指标和基金净值表现 (一)主要财务指标(单位:人民币元): 基金本期净收益 3,943,681.76 基金份额本期净收益 0.0049 期末基金资产净值 756,929,067.39 期末基金份额净值 1.0000



四、管理人报告 (一)基金管理人 光大保德信基金管理有限公司 (二)基金管理人承诺 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。

五、投资组合报告 (一)报告期末基金资产组合 资产组合 期末市值(元) 占基金总资产的比例 股票 629,324,182.53 92.95%

六、开放式基金份额变动 本报告期初基金份额总额 790,452,076.85 加:本期基金总申购份额 1,964,402,602.45 减:本期基金总赎回份额 1,998,016,611.91 本报告期末基金份额总额 756,929,067.39

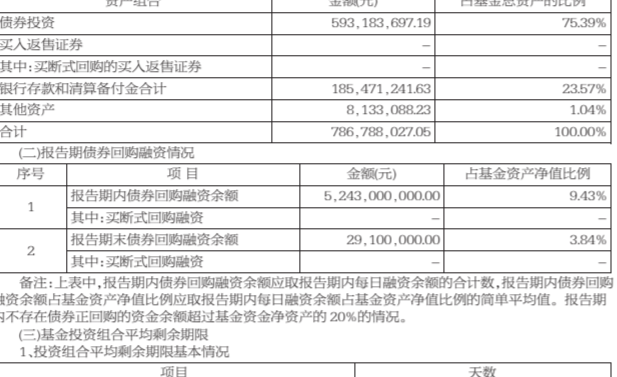
七、备查文件目录 (一)本基金备案文件目录 1、中国证监会批准设立光大保德信货币市场基金的文件 2、光大保德信货币市场基金基金合同

八、光大保德信基金管理有限公司 2007年4月20日

光大保德信货币市场基金 2007年第一季度报告

刘源先生,1969年生,美国圣克塞尔大学工商管理硕士,美国卡内基梅隆大学计算机金融学硕士,曾任德意志银行国际公司投资部经理,2004年4月加入光大保德信基金管理有限公司,担任公司债

三、主要财务指标和基金净值表现 (一)主要财务指标(单位:人民币元): 基金本期净收益 3,943,681.76 基金份额本期净收益 0.0049 期末基金资产净值 756,929,067.39 期末基金份额净值 1.0000



四、管理人报告 (一)基金管理人 光大保德信基金管理有限公司 (二)基金管理人承诺 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。

五、投资组合报告 (一)报告期末基金资产组合 资产组合 期末市值(元) 占基金总资产的比例 股票 629,324,182.53 92.95%

六、开放式基金份额变动 本报告期初基金份额总额 790,452,076.85 加:本期基金总申购份额 1,964,402,602.45 减:本期基金总赎回份额 1,998,016,611.91 本报告期末基金份额总额 756,929,067.39

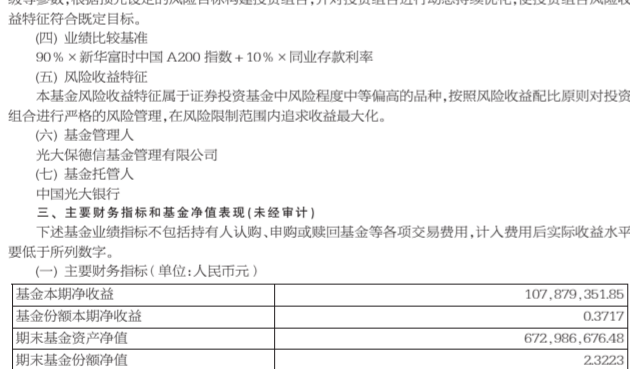
七、备查文件目录 (一)本基金备案文件目录 1、中国证监会批准设立光大保德信货币市场基金的文件 2、光大保德信货币市场基金基金合同

八、光大保德信基金管理有限公司 2007年4月20日

一、重要提示: 本基金管理人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。

二、基金产品概况 (一)基金概况 基金名称:量化核心 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:289,795,365.43份

三、主要财务指标和基金净值表现 (一)主要财务指标(单位:人民币元): 基金本期净收益 107,879,351.85 基金份额本期净收益 0.3717 期末基金资产净值 672,986,676.48 期末基金份额净值 2.3223



四、管理人报告 (一)基金管理人 光大保德信基金管理有限公司 (二)基金管理人承诺 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。

五、投资组合报告 (一)报告期末基金资产组合 资产组合 期末市值(元) 占基金总资产的比例 股票 629,324,182.53 92.95%

六、开放式基金份额变动 本报告期初基金份额总额 282,529,048.49 加:本期基金总申购份额 25,373,909.29 减:本期基金总赎回份额 18,106,613.35 本报告期末基金份额总额 289,795,365.43

七、备查文件目录 (一)本基金备案文件目录 1、中国证监会批准设立光大保德信量化核心证券投资基金的文件 2、光大保德信量化核心证券投资基金基金合同

八、光大保德信基金管理有限公司 2007年4月20日

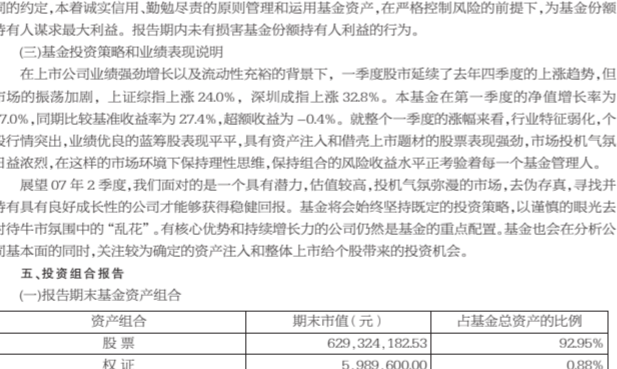
九、光大保德信基金管理有限公司 2007年4月20日

十、光大保德信基金管理有限公司 2007年4月20日

一、重要提示: 本基金管理人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。

二、基金产品概况 (一)基金概况 基金名称:光大货币 基金运作方式:契约型开放式 基金合同生效日:2006年6月9日 报告期末基金份额总额:756,929,067.39份

三、主要财务指标和基金净值表现 (一)主要财务指标(单位:人民币元): 基金本期净收益 3,943,681.76 基金份额本期净收益 0.0049 期末基金资产净值 756,929,067.39 期末基金份额净值 1.0000



四、管理人报告 (一)基金管理人 光大保德信基金管理有限公司 (二)基金管理人承诺 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。

五、投资组合报告 (一)报告期末基金资产组合 资产组合 期末市值(元) 占基金总资产的比例 股票 629,324,182.53 92.95%

六、开放式基金份额变动 本报告期初基金份额总额 790,452,076.85 加:本期基金总申购份额 1,964,402,602.45 减:本期基金总赎回份额 1,998,016,611.91 本报告期末基金份额总额 756,929,067.39

七、备查文件目录 (一)本基金备案文件目录 1、中国证监会批准设立光大保德信货币市场基金的文件 2、光大保德信货币市场基金基金合同

八、光大保德信基金管理有限公司 2007年4月20日

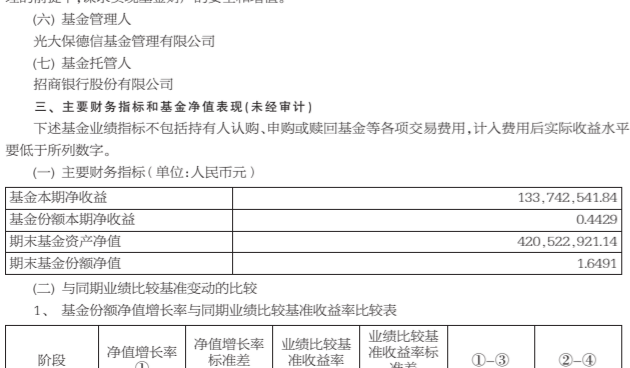
九、光大保德信基金管理有限公司 2007年4月20日

十、光大保德信基金管理有限公司 2007年4月20日

一、重要提示: 本基金管理人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。

二、基金产品概况 (一)基金概况 基金名称:光大货币 基金运作方式:契约型开放式 基金合同生效日:2006年6月9日 报告期末基金份额总额:756,929,067.39份

三、主要财务指标和基金净值表现 (一)主要财务指标(单位:人民币元): 基金本期净收益 3,943,681.76 基金份额本期净收益 0.0049 期末基金资产净值 756,929,067.39 期末基金份额净值 1.0000

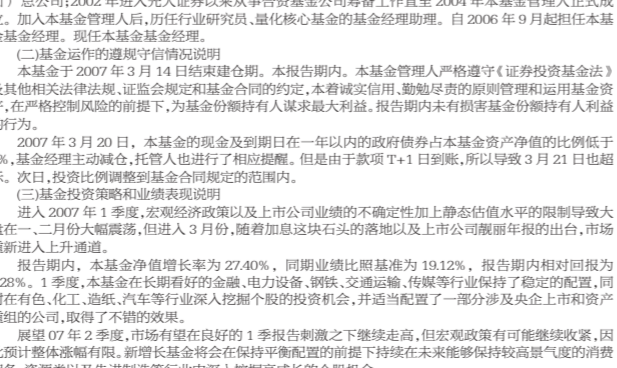


四、管理人报告 (一)基金管理人 光大保德信基金管理有限公司 (二)基金管理人承诺 本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

一、重要提示: 本基金管理人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。

二、基金产品概况 (一)基金概况 基金名称:光大货币 基金运作方式:契约型开放式 基金合同生效日:2006年6月9日 报告期末基金份额总额:756,929,067.39份

三、主要财务指标和基金净值表现 (一)主要财务指标(单位:人民币元): 基金本期净收益 3,943,681.76 基金份额本期净收益 0.0049 期末基金资产净值 756,929,067.39 期末基金份额净值 1.0000



四、管理人报告 (一)基金管理人 光大保德信基金管理有限公司 (二)基金管理人承诺 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。

光大保德信货币市场基金 2007年第一季度报告

Table with columns: 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. Rows include 30天以内, 30天合-60天, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 成本(元), 占基金资产净值的比例. Rows include 1 国债, 2 金融债, 3 央行票据, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 成本(元), 占基金资产净值的比例. Rows include 1 07央票 04, 2 06央行票, 3 07国债, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 成本(元), 占基金资产净值的比例. Rows include 1 报告期末债券回购融资余额, 2 报告期末买入回购融资余额, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 成本(元), 占基金资产净值的比例. Rows include 1 07央票 04, 2 06央行票, 3 07国债, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 成本(元), 占基金资产净值的比例. Rows include 1 报告期末债券回购融资余额, 2 报告期末买入回购融资余额, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 成本(元), 占基金资产净值的比例. Rows include 1 07央票 04, 2 06央行票, 3 07国债, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 成本(元), 占基金资产净值的比例. Rows include 1 报告期末债券回购融资余额, 2 报告期末买入回购融资余额, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 成本(元), 占基金资产净值的比例. Rows include 1 07央票 04, 2 06央行票, 3 07国债, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 成本(元), 占基金资产净值的比例. Rows include 1 报告期末债券回购融资余额, 2 报告期末买入回购融资余额, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 成本(元), 占基金资产净值的比例. Rows include 1 07央票 04, 2 06央行票, 3 07国债, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 成本(元), 占基金资产净值的比例. Rows include 1 报告期末债券回购融资余额, 2 报告期末买入回购融资余额, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 成本(元), 占基金资产净值的比例. Rows include 1 07央票 04, 2 06央行票, 3 07国债, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 成本(元), 占基金资产净值的比例. Rows include 1 报告期末债券回购融资余额, 2 报告期末买入回购融资余额, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 成本(元), 占基金资产净值的比例. Rows include 1 07央票 04, 2 06央行票, 3 07国债, etc.

备注:以上数据按工作日计算。(六)投资组合报告附注 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,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价折价,在剩余期限内逐日摊销,相日计提收益。

六、开放式基金份额变动 本报告期初基金份额总额 790,452,076.85 加:本期基金总申购份额 1,964,402,602.45 减:本期基金总赎回份额 1,998,016,611.91 本报告期末基金份额总额 756,929,067.39

Table with columns: 类别, 金额(元). Rows include 应收证券清算款 5,002,750.00, 应收利息 2,134,877.76, etc.

Table with columns: 序号, 名称, 市值(元), 占基金资产净值的比例. Rows include 1, 2, 3, 4, 5.

Table with columns: 序号, 债券名称, 成本(元), 占基金资产净值的比例. Rows include 1 07央票 04, 2 06央行票, 3 07国债, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 成本(元), 占基金资产净值的比例. Rows include 1 报告期末债券回购融资余额, 2 报告期末买入回购融资余额, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 成本(元), 占基金资产净值的比例. Rows include 1 07央票 04, 2 06央行票, 3 07国债, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 成本(元), 占基金资产净值的比例. Rows include 1 报告期末债券回购融资余额, 2 报告期末买入回购融资余额, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 成本(元), 占基金资产净值的比例. Rows include 1 07央票 04, 2 06央行票, 3 07国债, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 成本(元), 占基金资产净值的比例. Rows include 1 报告期末债券回购融资余额, 2 报告期末买入回购融资余额, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 成本(元), 占基金资产净值的比例. Rows include 1 07央票 04, 2 06央行票, 3 07国债, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 成本(元), 占基金资产净值的比例. Rows include 1 报告期末债券回购融资余额, 2 报告期末买入回购融资余额, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 成本(元), 占基金资产净值的比例. Rows include 1 07央票 04, 2 06央行票, 3 07国债, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 成本(元), 占基金资产净值的比例. Rows include 1 报告期末债券回购融资余额, 2 报告期末买入回购融资余额, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 成本(元), 占基金资产净值的比例. Rows include 1 07央票 04, 2 06央行票, 3 07国债, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 成本(元), 占基金资产净值的比例. Rows include 1 报告期末债券回购融资余额, 2 报告期末买入回购融资余额, etc.