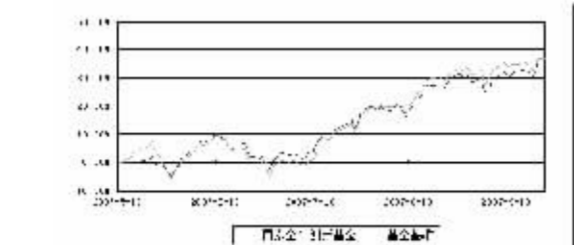


国泰金牛创新成长股票型证券投资基金

2007年第三季度报告

重要提示 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...



注：(1)本基金合同生效日为2007年5月18日，截止至2007年9月30日不满一年。

一、基金产品概况 1. 基金名称：国泰金牛创新成长股票型证券投资基金 基金代码：020010 基金运作方式：契约型开放式

二、基金投资目标 本基金为成长型股票基金，主要通过投资于具有良好发展前景的上市公司股票，在有效的风险控制前提下，追求基金资产的长期增值。

三、基金投资策略 本基金的大类资产配置主要通过宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场市场结构、证券市场走势的分析，判断宏观经济的发展趋势，并据此评价未来一段时间内股票、债券及现金类资产的配置比例。

四、基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率*20%+[上证国债指数收益率]*80%

Table with 2 columns: 主要财务指标和基金净值表现 (未审计), 2007年7-9月. Rows include 1. 本期利润, 2. 本期利润扣除公允价值变动损益后的净额, etc.

注：(1)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，计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

一、重要提示 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...

二、基金产品概况 1. 基金名称：光大保德信量化核心证券投资基金 基金代码：020011 基金运作方式：契约型开放式

三、基金投资策略 本基金的大类资产配置主要通过宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场市场结构、证券市场走势的分析，判断宏观经济的发展趋势，并据此评价未来一段时间内股票、债券及现金类资产的配置比例。

四、基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率*20%+[上证国债指数收益率]*80%

Table with 2 columns: 主要财务指标和基金净值表现 (未审计), 2007年7-9月. Rows include 1. 本期利润, 2. 本期利润扣除公允价值变动损益后的净额, etc.

注：(1)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，计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

一、重要提示 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...

二、基金产品概况 1. 基金名称：东方金账簿货币市场证券投资基金 基金代码：020012 基金运作方式：契约型开放式

三、基金投资策略 本基金的大类资产配置主要通过宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场市场结构、证券市场走势的分析，判断宏观经济的发展趋势，并据此评价未来一段时间内股票、债券及现金类资产的配置比例。

四、基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率*20%+[上证国债指数收益率]*80%

Table with 2 columns: 主要财务指标和基金净值表现 (未审计), 2007年3季度. Rows include 1. 本期利润, 2. 本期利润扣除公允价值变动损益后的净额, etc.

注：(1)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，计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

一、重要提示 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...

二、基金产品概况 1. 基金名称：光大保德信量化核心证券投资基金 基金代码：020011 基金运作方式：契约型开放式

三、基金投资策略 本基金的大类资产配置主要通过宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场市场结构、证券市场走势的分析，判断宏观经济的发展趋势，并据此评价未来一段时间内股票、债券及现金类资产的配置比例。

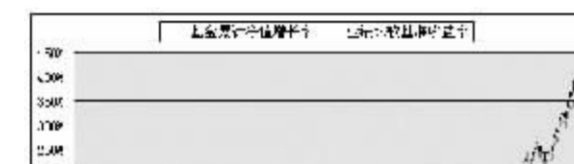
四、基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率*20%+[上证国债指数收益率]*80%

Table with 2 columns: 主要财务指标和基金净值表现 (未审计), 2007年3季度. Rows include 1. 本期利润, 2. 本期利润扣除公允价值变动损益后的净额, etc.

注：(1)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，计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

光大保德信量化核心证券投资基金

2007年第三季度报告



注：(1)本基金合同生效日为2007年5月18日，截止至2007年9月30日不满一年。

一、基金产品概况 1. 基金名称：光大保德信量化核心证券投资基金 基金代码：020011 基金运作方式：契约型开放式

二、基金投资目标 本基金为成长型股票基金，主要通过投资于具有良好发展前景的上市公司股票，在有效的风险控制前提下，追求基金资产的长期增值。

三、基金投资策略 本基金的大类资产配置主要通过宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场市场结构、证券市场走势的分析，判断宏观经济的发展趋势，并据此评价未来一段时间内股票、债券及现金类资产的配置比例。

四、基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率*20%+[上证国债指数收益率]*80%

Table with 2 columns: 主要财务指标和基金净值表现 (未审计), 2007年7-9月. Rows include 1. 本期利润, 2. 本期利润扣除公允价值变动损益后的净额, etc.

注：(1)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，计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

一、重要提示 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...

二、基金产品概况 1. 基金名称：东方金账簿货币市场证券投资基金 基金代码：020012 基金运作方式：契约型开放式

三、基金投资策略 本基金的大类资产配置主要通过宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场市场结构、证券市场走势的分析，判断宏观经济的发展趋势，并据此评价未来一段时间内股票、债券及现金类资产的配置比例。

四、基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率*20%+[上证国债指数收益率]*80%

Table with 2 columns: 主要财务指标和基金净值表现 (未审计), 2007年3季度. Rows include 1. 本期利润, 2. 本期利润扣除公允价值变动损益后的净额, etc.

注：(1)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，计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

一、重要提示 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...

二、基金产品概况 1. 基金名称：光大保德信量化核心证券投资基金 基金代码：020011 基金运作方式：契约型开放式

三、基金投资策略 本基金的大类资产配置主要通过宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场市场结构、证券市场走势的分析，判断宏观经济的发展趋势，并据此评价未来一段时间内股票、债券及现金类资产的配置比例。

型企业，最后是围绕基金业绩基准沪深300指数进行了一定的行业覆盖。从业绩表现看，本基金着眼于长期的成长型投资理念与三季度通胀人民币升值的市场特征不甚符合，导致期初净值增长较快，但随着时间的推移，我们开始调整持仓，坚持的创新成长理念正在逐步体现为较好的投资业绩。

展展四季度，本基金相信创新成长的投资理念指导下的组合管理会带来更好的投资业绩。目前市场整体的估值水平已经较高，唯有高增长才能支持高估值，挖掘高增长是四季度一个重要的投资主题。

五、基金投资组合报告 (未经审计) 1. 报告期末基金投资组合情况 资产组合 金额(元) 占基金总资产比例(%) 股票 8,778,448,297.92 81.75%

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合 序号 行业 市值(元) 占净值比例 1 农林、牧、业 129,515,922.32 1.23%

3. 报告期末按公允价值变动损益后资产组合 序号 行业 市值(元) 占净值比例 1 农林、牧、业 129,515,922.32 1.23%

注：(1)本基金合同生效日为2007年5月18日，截止至2007年9月30日不满一年。

一、重要提示 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...

二、基金产品概况 1. 基金名称：光大保德信量化核心证券投资基金 基金代码：020011 基金运作方式：契约型开放式

三、基金投资策略 本基金的大类资产配置主要通过宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场市场结构、证券市场走势的分析，判断宏观经济的发展趋势，并据此评价未来一段时间内股票、债券及现金类资产的配置比例。

四、基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率*20%+[上证国债指数收益率]*80%

Table with 2 columns: 主要财务指标和基金净值表现 (未审计), 2007年7-9月. Rows include 1. 本期利润, 2. 本期利润扣除公允价值变动损益后的净额, etc.

注：(1)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，计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

一、重要提示 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...

二、基金产品概况 1. 基金名称：光大保德信量化核心证券投资基金 基金代码：020011 基金运作方式：契约型开放式

三、基金投资策略 本基金的大类资产配置主要通过宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场市场结构、证券市场走势的分析，判断宏观经济的发展趋势，并据此评价未来一段时间内股票、债券及现金类资产的配置比例。

四、基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率*20%+[上证国债指数收益率]*80%

Table with 2 columns: 主要财务指标和基金净值表现 (未审计), 2007年7-9月. Rows include 1. 本期利润, 2. 本期利润扣除公允价值变动损益后的净额, etc.

注：(1)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，计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

一、重要提示 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...

二、基金产品概况 1. 基金名称：光大保德信量化核心证券投资基金 基金代码：020011 基金运作方式：契约型开放式

三、基金投资策略 本基金的大类资产配置主要通过宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场市场结构、证券市场走势的分析，判断宏观经济的发展趋势，并据此评价未来一段时间内股票、债券及现金类资产的配置比例。

四、基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率*20%+[上证国债指数收益率]*80%

Table with 2 columns: 主要财务指标和基金净值表现 (未审计), 2007年7-9月. Rows include 1. 本期利润, 2. 本期利润扣除公允价值变动损益后的净额, etc.

注：(1)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，计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

一、重要提示 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...

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 市值(元), 占净值比例. Rows include 1. 600100 同方股份, 2. 601318 中国平安, etc.

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 序号 债券名称 市值(元) 占基金总资产比例(%)

五、基金投资组合报告 (未经审计) 1. 报告期末基金投资组合情况 资产组合 金额(元) 占基金总资产比例(%) 股票 8,778,448,297.92 81.75%

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合 序号 行业 市值(元) 占净值比例 1 农林、牧、业 129,515,922.32 1.23%

3. 报告期末按公允价值变动损益后资产组合 序号 行业 市值(元) 占净值比例 1 农林、牧、业 129,515,922.32 1.23%

注：(1)本基金合同生效日为2007年5月18日，截止至2007年9月30日不满一年。

一、重要提示 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...

二、基金产品概况 1. 基金名称：光大保德信量化核心证券投资基金 基金代码：020011 基金运作方式：契约型开放式

三、基金投资策略 本基金的大类资产配置主要通过宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场市场结构、证券市场走势的分析，判断宏观经济的发展趋势，并据此评价未来一段时间内股票、债券及现金类资产的配置比例。

四、基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率*20%+[上证国债指数收益率]*80%

Table with 2 columns: 主要财务指标和基金净值表现 (未审计), 2007年7-9月. Rows include 1. 本期利润, 2. 本期利润扣除公允价值变动损益后的净额, etc.

注：(1)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，计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

一、重要提示 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...

二、基金产品概况 1. 基金名称：光大保德信量化核心证券投资基金 基金代码：020011 基金运作方式：契约型开放式

三、基金投资策略 本基金的大类资产配置主要通过宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场市场结构、证券市场走势的分析，判断宏观经济的发展趋势，并据此评价未来一段时间内股票、债券及现金类资产的配置比例。

四、基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率*20%+[上证国债指数收益率]*80%

Table with 2 columns: 主要财务指标和基金净值表现 (未审计), 2007年7-9月. Rows include 1. 本期利润, 2. 本期利润扣除公允价值变动损益后的净额, etc.

注：(1)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，计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

一、重要提示 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...

二、基金产品概况 1. 基金名称：光大保德信量化核心证券投资基金 基金代码：020011 基金运作方式：契约型开放式

三、基金投资策略 本基金的大类资产配置主要通过宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场市场结构、证券市场走势的分析，判断宏观经济的发展趋势，并据此评价未来一段时间内股票、债券及现金类资产的配置比例。

四、基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率*20%+[上证国债指数收益率]*80%

Table with 2 columns: 主要财务指标和基金净值表现 (未审计), 2007年7-9月. Rows include 1. 本期利润, 2. 本期利润扣除公允价值变动损益后的净额, etc.

注：(1)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，计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

一、重要提示 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...

二、基金产品概况 1. 基金名称：光大保德信量化核心证券投资基金 基金代码：020011 基金运作方式：契约型开放式