

# 光大保德信安和债券型证券投资基金

## 2021 年中期报告

### 2021 年 6 月 30 日

基金管理人：光大保德信基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十一日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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。

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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	8
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	9
<b>4 管理人报告</b> .....	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	18
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	19
<b>5 托管人报告</b> .....	19
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	19
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	20
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	20
<b>6 中期财务会计报告（未经审计）</b> .....	20
6.1 资产负债表.....	20
6.2 利润表.....	21
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
6.4 报表附注.....	23
<b>7 投资组合报告</b> .....	47
7.1 期末基金资产组合情况.....	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	48
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	52
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	52
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	52
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.12 本报告期投资基金情况.....	53
7.13 投资组合报告附注.....	53
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	56

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	56
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>56</b>
<b>10 重大事件揭示</b> .....	<b>57</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	57
10.2 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 .....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	57
10.4 基金投资策略的改变 .....	57
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	57
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	57
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	57
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	57
10.9 其他重大事件 .....	60
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>61</b>
<b>12 备查文件目录</b> .....	<b>61</b>
12.1 备查文件目录 .....	61
12.2 存放地点 .....	62
12.3 查阅方式 .....	62

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	光大保德信安和债券型证券投资基金	
基金简称	光大保德信安和债券	
基金主代码	003109	
交易代码	003109	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 1 月 5 日	
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,507,514,275.14 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	光大保德信安和债券 A	光大保德信安和债券 C
下属分级基金的交易代码	003109	003110
报告期末下属分级基金的份额总额	3,124,003,761.80 份	383,510,513.34 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制信用风险、谨慎投资的前提下，力争在获取持有期收益的同时，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金根据工业增加值、通货膨胀率等宏观经济指标，结合国家货币政策和财政政策实施情况、市场收益率曲线变动情况、市场流动性情况，综合分析债券市场的变动趋势。最终确定本基金在债券类资产和股票资产之间的投资比率，构建和调整债券投资组合。</p> <p>2、目标久期策略及凸性策略</p> <p>在组合的久期选择方面，本基金将综合分析宏观面的各个要素，主要包括宏观经济所处周期、货币财政政策动向、市场流动性变动情况等，通过对各宏观变量的分析，判断其对市场利率水平的影响方向和程度，从而确定本基金固定收益投资组合久期的合理范围。并且动态调整本基金的目标久期，即预期利率上升时适当缩短组合久期，在预期利率下降时适当延长组合久期，从而提高债券投资收益。</p> <p>由于债券价格与收益率之间往往存在明显的非线性关系，所以通过凸性管理策略为久期策略补充，可以更好地分析债券的利率风险。凸性越大，利率上行引起的价格损失越小，而利率下行带来的价格上升越大；反之亦然。本基金将通过严格的凸性分析，对久期策略做出适当的补充和修正。</p> <p>3、收益率曲线策略</p> <p>在确定了组合的整体久期后，组合将基于宏观经济研究和债券市场跟踪，结合收益率曲线的拟合和波动模拟模型，对未来的收益率曲线移动进行情景分析，从而根据不同期限的收益率变动情况，在期限结构配置上适时采取子弹型、哑铃型或者阶梯型等策略，进一步优化组合的期限结构，增强</p>

基金的收益。

#### 4、信用债投资策略

信用类债券是本基金的重要投资对象，因此信用策略是本基金债券投资策略的重要部分。由于影响信用债券利差水平的因素包括市场整体的信用利差水平和信用债自身的信用情况变化，因此本基金的信用债投资策略可以具体分为市场整体信用利差曲线策略和单个信用债信用分析策略。

##### （1）市场整体信用利差曲线策略

本基金将从经济周期、市场特征和政策因素三方面考量信用利差曲线的整体走势。在经济周期向上阶段，企业盈利能力增强，经营现金流改善，则信用利差可能收窄，反之当经济周期不景气，企业的盈利能力减弱，信用利差扩大。同时本基金也将考虑市场容量、信用债结构以及流动性之间的相互关系，动态研究信用债市场的主要特征，为分析信用利差提供依据。另外，政策因素也会对信用利差造成很大影响。这种政策影响集中在信用债市场的供给方面和需求方面。本基金将从供给和需求两方面分别评估政策对信用债市场的作用。

本基金将综合各种因素，分析信用利差曲线整体及分行业走势，确定信用债券总的投资比例及分行业的投资比例。

##### （2）单个信用债信用分析策略

信用债的收益率水平及其变化很大程度上取决于其发行主体自身的信用水平，本基金将对不同信用类债券的信用等级进行评估，深入挖掘信用债的投资价值，增强本基金的收益。

本基金主要通过发行主体偿债能力、抵押物质量、契约条款和公司治理情况等方面分析和评估单个信用债券的信用水平：

信用债作为发行主体的一种融资行为，发行主体的偿债能力是首先需要考虑的重要因素。本基金将从行业和企业两个层面来衡量发行主体的偿债能力。A）行业层面：包括行业发展趋势、政策环境和行业运营竞争状况；B）企业层面：包括盈利指标分析、资产负债表分析和现金流分析等。

抵押物作为信用债发行时的重要组成部分，是债券持有人分析和衡量该债券信用风险的关键因素之一。对于抵押物质量的考察主要集中在抵押物的现金流生成能力和资产增值能力。抵押物产生稳定现金流的能力越强、资产增值的潜力越大，则抵押物的质量越好，从而该信用债的信用水平也越高。

契约条款是指在信用债发行时明确规定的，约束和限制发行人行为的条款内容。具体包含承诺性条款和限制性条款两方面，本基金首先分析信用债券中契约条款的合理性和可实施性，随后对发行人履行条款的情况进行动态跟踪与评估，发行人对契约条款的履行情况越良好，其信用水平也越高。对于通过发行债券开展融资活动的企业来说，该发行人的公司治理情况是该债券维持高信用等级的重要因素。本基金关注的公司治理情况包括持有人结构、股东权益与员工关系、运行透明度和信息披露、董事会结构和效率等。

#### 5、可转换债券投资策略

本基金在分析宏观经济运行特征和证券市场趋势判断的前提下，在综合分析可转换债券的债性特征、股性特征等因素的基础上，选择其中安全边际较高、股性活跃并具有较高上涨潜力的品种进行投资。结合行业分析和个股选择，对成长前景较好的行业和上市公司的可转换债券进行重点关注，

	<p>选择投资价值较高的个券进行投资。</p> <p><b>6、中小企业私募债投资策略</b></p> <p>与传统的信用债相比，中小企业私募债券采取非公开方式发行和交易，整体流动性相对较差，而且受到发债主体资产规模较小、经营波动性较高、信用基本面稳定性较差的影响，整体的信用风险相对较高。因此，对于中小企业私募债券的投资应采取更为谨慎的投资策略。本基金认为，投资该类债券的核心要点是对个券信用资质进行详尽的分析，并综合考虑发行人的企业性质、所处行业、资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素，确定最终的投资决策。</p> <p><b>7、资产支持证券投资策略</b></p> <p>资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产支持证券。</p> <p><b>8、证券公司短期公司债券投资策略</b></p> <p>本基金将通过对证券行业分析、证券公司资产负债分析、公司现金流分析等调查研究，分析证券公司短期公司债券的违约风险及合理的利差水平，对证券公司短期公司债券进行独立、客观的价值评估。</p> <p>基金投资证券公司短期公司债券，基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。</p> <p><b>9、杠杆投资策略</b></p> <p>在本基金的日常投资中，还将充分利用组合的回购杠杆操作，在严格头寸管理的基础上，在资金相对充裕的情况下进行风险可控的杠杆投资策略。</p> <p><b>10、国债期货投资策略</b></p> <p>基金管理人可运用国债期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在国债期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与国债期货的投资，以管理投资组合的利率风险，改善组合的风险收益特性。</p> <p><b>11、股票投资策略</b></p> <p>本基金将采取“自下而上”的方式精选个股。本基金将全面考察上市公司所处行业的产业竞争格局、业务发展模式、盈利增长模式、公司治理结构等基本特征，同时综合利用市盈率（P/E）、市净率（P/B）和折现现金流（DCF）等估值方法对公司的投资价值进行分析和比较，挖掘具备中长期持续增长的上市公司股票库，以获得较高投资回报。</p> <p><b>12、存托凭证的投资策略</b></p> <p>本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。</p> <p><b>13、权证投资策略</b></p> <p>本基金的权证投资以权证的市值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产稳定的当期收益。</p>
业绩比较基准	中债综合财富(总值)指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金，但低于股票

型基金和混合型基金。
------------

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		光大保德信基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王许利	陆志俊
	联系电话	(021) 80262888	95559
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4008-202-888	95559
传真		(021) 80262468	021-62701216
注册地址		上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢, 6层	中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢(北区3号楼), 6-7层、10层	中国(上海)长宁区仙霞路18号
邮政编码		200010	200336
法定代表人		刘翔	任德奇

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.epf.com.cn
基金中期报告备置地点	光大保德信基金管理有限公司、交通银行股份有限公司的办公场所。

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	光大保德信基金管理有限公司	上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢 (北区 3 号楼), 6-7 层、10 层

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日)	
	光大保德信安和债券 A	光大保德信安和债券 C
本期已实现收益	24,166,136.25	2,638,534.14



本期利润	51,706,575.49	7,336,281.90
加权平均基金份额本期利润	0.0159	0.0149
本期加权平均净值利润率	1.44%	1.36%
本期基金份额净值增长率	1.33%	1.18%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2021年6月30日)</b>	
	光大保德信安和债券 A	光大保德信安和债券 C
期末可供分配利润	99,447,753.58	9,054,046.60
期末可供分配基金份额利润	0.0318	0.0236
期末基金资产净值	3,340,989,109.67	406,969,963.22
期末基金份额净值	1.0695	1.0612
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2021年6月30日)</b>	
	光大保德信安和债券 A	光大保德信安和债券 C
基金份额累计净值增长率	35.59%	33.90%

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。

(2) 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字。

(3) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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

光大保德信安和债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-0.39%	0.09%	-0.02%	0.09%	-0.37%	0.00%
过去三个月	0.49%	0.11%	1.48%	0.10%	-0.99%	0.01%
过去六个月	1.33%	0.14%	2.04%	0.14%	-0.71%	0.00%
过去一年	4.46%	0.17%	5.05%	0.13%	-0.59%	0.04%
过去三年	21.10%	0.17%	18.40%	0.13%	2.70%	0.04%
自基金合同生效起至今	35.59%	0.17%	23.56%	0.12%	12.03%	0.05%

光大保德信安和债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-0.42%	0.09%	-0.02%	0.09%	-0.40%	0.00%
过去三个月	0.41%	0.11%	1.48%	0.10%	-1.07%	0.01%

过去六个月	1.18%	0.14%	2.04%	0.14%	-0.86%	0.00%
过去一年	4.17%	0.17%	5.05%	0.13%	-0.88%	0.04%
过去三年	20.13%	0.17%	18.40%	0.13%	1.73%	0.04%
自基金合同生效起至今	33.90%	0.17%	23.56%	0.12%	10.34%	0.05%

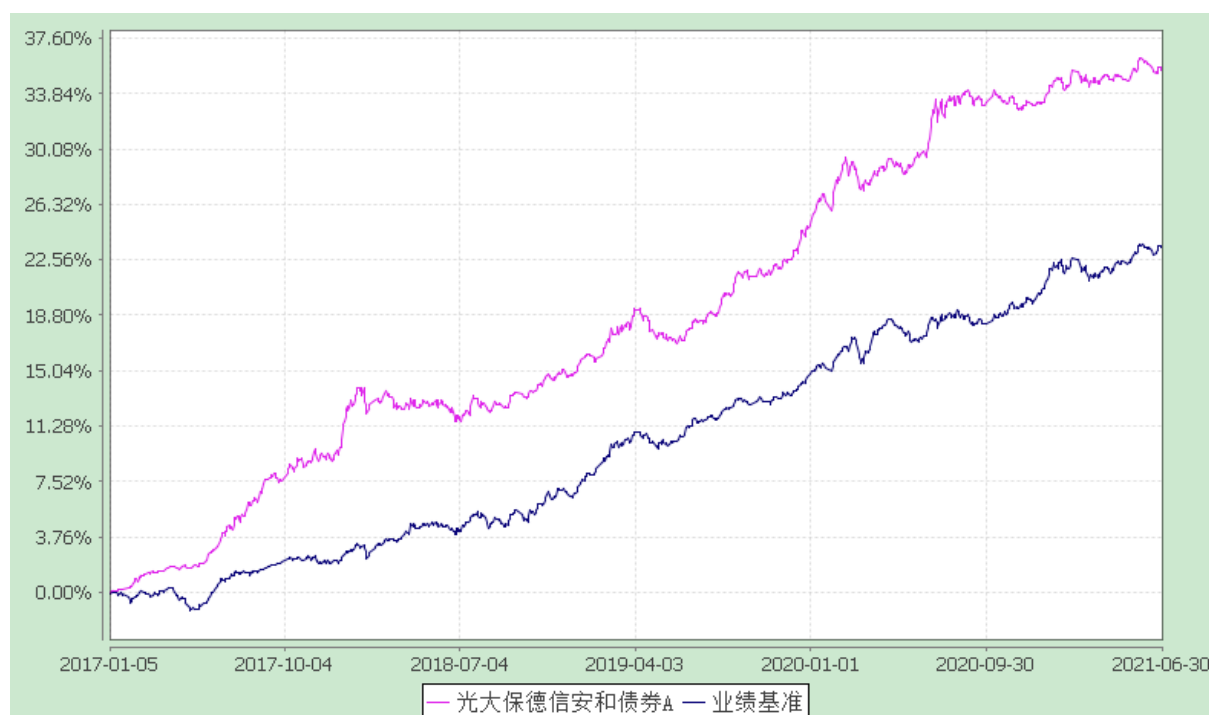
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

光大保德信安和债券型证券投资基金

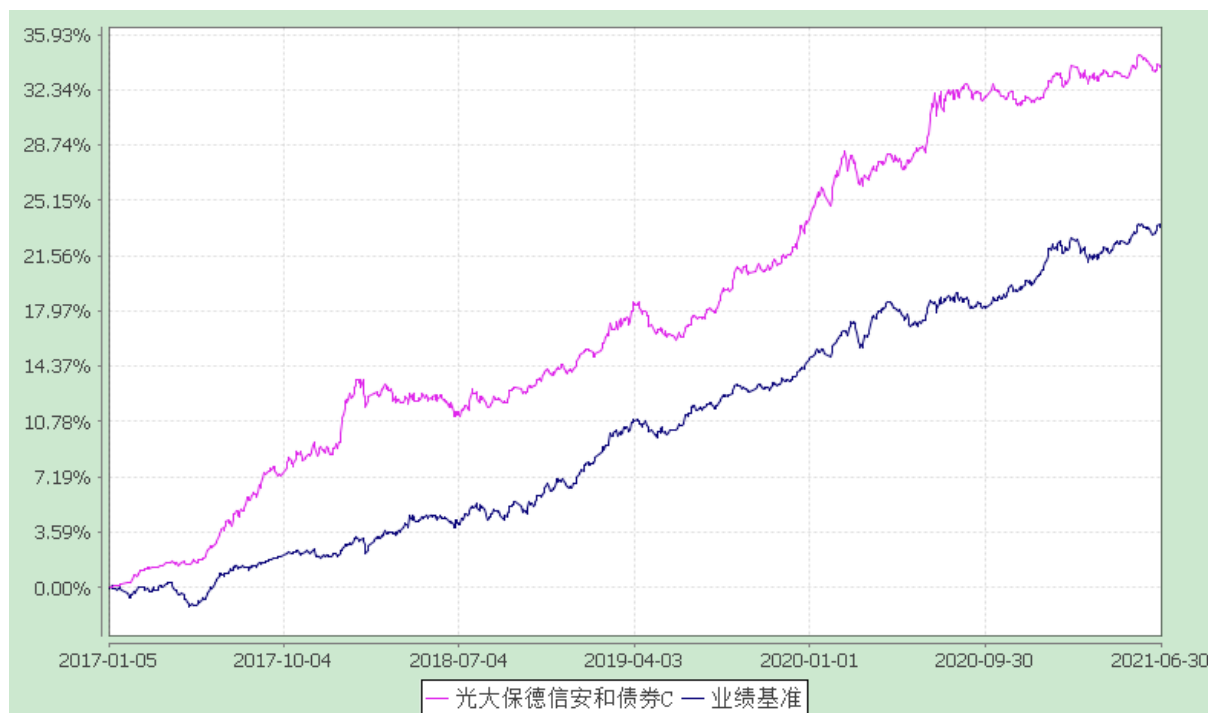
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017 年 1 月 5 日至 2021 年 6 月 30 日)

光大保德信安和债券 A



光大保德信安和债券 C



注：根据基金合同的规定，本基金建仓期为 2017 年 1 月 5 日至 2017 年 7 月 4 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 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

光大保德信基金管理有限公司（以下简称“光大保德信”）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 亿元人民币，两家股东分别持有 55% 和 45% 的股份。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务（涉及行政许可的凭许可证经营），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 2021 年 6 月 30 日，光大保德信旗下管理着 60 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、光大保德信红利混合型证券投资基金、光大保德信新增长混合型证券投资基金、光大保德信优势配置混合型证券投资基金、光大保德信增利收益债券型证券投资基金、光大保德信均衡精选混合型证券投资基金、光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信中小盘混合型证券投资基金、光大保德信信用添益债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动混合型证券投资基金、光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金、光大保

德信现金宝货币市场基金、光大保德信银发商机主题混合型证券投资基金、光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金、光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金、光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信一带一路战略主题混合型证券投资基金、光大保德信耀钱包货币市场基金、光大保德信欣鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信风格轮动混合型证券投资基金、光大保德信产业新动力灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信永鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信恒利纯债债券型证券投资基金、光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信诚鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信安祺债券型证券投资基金、光大保德信安和债券型证券投资基金、光大保德信事件驱动灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信永利纯债债券型证券投资基金、光大保德信安诚债券型证券投资基金、光大保德信多策略智选 18 个月定期开放混合型证券投资基金、光大保德信尊盈半年定期开放债券型发起式证券投资基金、光大保德信中高等级债券型证券投资基金、光大保德信先进服务业灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信尊富 18 个月定期开放债券型证券投资基金、光大保德信多策略优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信创业板量化优选股票型证券投资基金、光大保德信多策略精选 18 个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信超短债债券型证券投资基金、光大保德信晟利债券型证券投资基金、光大保德信安泽债券型证券投资基金、光大保德信尊丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、光大保德信景气先锋混合型证券投资基金、光大保德信尊泰三年定期开放债券型证券投资基金、光大保德信研究精选混合型证券投资基金、光大保德信消费主题股票型证券投资基金、光大保德信裕鑫混合型证券投资基金、光大保德信瑞和混合型证券投资基金、光大保德信尊合 87 个月定期开放债券型证券投资基金、光大保德信尊裕纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、光大保德信中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、光大保德信安瑞一年持有期债券型证券投资基金、光大保德信智能汽车主题股票型证券投资基金、光大保德信锦弘混合型证券投资基金、光大保德信新机遇混合型证券投资基金、光大保德信安阳一年持有期混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
沈荣	固收管理总部 固收低风险投资团队联席团	2021-03-05	-	9 年	沈荣先生，2007 年获得上海交通大学工学学士学位，2011 年获得上海财经大学金融学硕士学位。

	队长、基金经理			<p>2007年7月至2008年9月在上海电器科学研究所(集团)有限公司任职CAD开发工程师;2011年6月至2012年3月在国金证券股份有限公司任职行业研究员;2012年3月至2014年4月在宏源证券股份有限公司任职行业分析师、固定收益分析师;2014年4月至2017年6月在平安养老保险股份有限公司任职债券助理研究经理、投资经理;2017年7月加入光大保德信基金管理有限公司,现任公司固收管理总部固收低风险投资团队联席团队长,2017年8月至今担任光大保德信货币市场基金的基金经理,2017年8月至2019年9月担任光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2017年11月至2018年3月担任光大保德信尊享一年定期开放债券型证券投资基金(已清盘)的基金经理,2018年1月至2020年3月担任光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金(2020年3月起转型为光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金)的基金经理,2018年2月至今担任光大保德信尊盈半年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年3月至2019年11月担任光大保德信多策略智选18个月定期开放混合型证券投资基金的基金经理,2018年5月至2020年2月担任光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2018年5月至2021年5月担任光大保德信中高等级债券型证券投资基金的基金经理,2018年5月至今担任光大保德信尊富18个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理,2018年6月至今担任光大保德信超短债债券型证券投资基金的基金经理,2018年8月至2019年9月担任光大保德信晟利债券型证券投资基金的</p>
--	---------	--	--	---

					<p>基金经理，2018 年 9 月至 2019 年 9 月担任光大保德信安泽债券型证券投资基金的基金经理，2019 年 8 月至 2021 年 5 月担任光大保德信尊丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2020 年 3 月至今担任光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金的基金经理，2020 年 8 月至今担任光大保德信尊合 87 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理，2020 年 12 月至今担任光大保德信安瑞一年持有期债券型证券投资基金的基金经理，2021 年 3 月至今担任光大保德信安和债券型证券投资基金的基金经理，2021 年 7 月至今担任光大保德信现金宝货币市场基金、光大保德信耀钱包货币市场基金的基金经理。</p>
陈栋	基金经理	2020-10-24	-	12 年	<p>陈栋先生，2006 年毕业于复旦大学预防医学专业，2009 年获得复旦大学卫生经济管理学硕士学位。2009 年至 2010 年在国信证券经济研究所担任研究员；2011 年在中信证券交易与衍生产品业务总部担任研究员；2012 年 2 月加入光大保德信基金管理有限公司，担任投资研究部研究员、高级研究员，并于 2014 年 6 月起担任光大保德信银发商机主题混合型证券投资基金的基金经理助理，2015 年 4 月至今担任光大保德信银发商机主题混合型证券投资基金的基金经理，2019 年 6 月至 2020 年 8 月担任光大保德信永鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2019 年 12 月至今担任光大保德信欣鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2020 年 1 月至今担任光大保德信中小盘混合型证券投资基金的基金经理，2020 年 2 月至今担任光大保德信事件驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2020 年 10 月至今担任</p>

					光大保德信安和债券型证券投资基金的基金经理。
周华	固定收益部投资副总监、基金经理	2018-10-27	2021-03-20	11 年	周华先生，香港大学金融学硕士。2009 年 7 月至 2011 年 5 月在第一创业证券股份有限公司担任债券交易员；2011 年 6 月至 2014 年 9 月在景顺长城基金管理有限公司担任债券交易员、信用研究员、投资经理；2014 年 9 月至 2018 年 6 月在泰康资产管理有限责任公司担任固定收益投资总监；2018 年 6 月加入光大保德信基金管理有限公司，任职固定收益部投资副总监一职，2018 年 8 月至 2019 年 12 月担任光大保德信永利纯债债券型证券投资基金的基金经理，2018 年 8 月至 2020 年 10 月担任光大保德信晟利债券型证券投资基金的基金经理，2018 年 8 月至 2021 年 3 月担任光大保德信安诚债券型证券投资基金的基金经理，2018 年 9 月至 2021 年 1 月担任光大保德信安泽债券型证券投资基金的基金经理，2018 年 10 月至 2021 年 3 月担任光大保德信安和债券型证券投资基金、光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金的基金经理，2018 年 10 月至 2019 年 11 月担任光大保德信信用添益债券型证券投资基金的基金经理，2018 年 11 月至 2019 年 12 月担任光大保德信多策略精选 18 个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2019 年 8 月至 2020 年 8 月担任光大保德信尊丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2020 年 6 月至 2021 年 3 月担任光大保德信裕鑫混合型证券投资基金的基金经理，2020 年 9 月至 2021 年 3 月担任光大保德信尊裕纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。

注：1、对基金的非首任基金经理，其任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期

和解聘日期。

2、詹佳先生于 2021 年 8 月 28 日担任本基金基金经理，与沈荣先生、陈栋先生共同管理本基金。

詹佳先生简历：

詹佳先生于 2008 年获得香港科技大学运营管理学学士学位，2013 年获得香港大学金融学硕士学位。2008 年 6 月至 2011 年 6 月在忠利保险有限公司担任研究分析师；2011 年 7 月至 2013 年 6 月在香港富通投资管理有限公司担任中国股票主管、投资分析师；2013 年 7 月至 2017 年 12 月在建银国际资产管理有限公司担任董事、组合管理部门代理负责人；2017 年 12 月加入光大保德信基金管理有限公司，任职权益管理总部国际业务团队团队队长一职。2018 年 6 月至今担任光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 7 月至 2020 年 10 月担任光大保德信红利混合型证券投资基金的基金经理，2019 年 12 月至今担任光大保德信先进服务业灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2020 年 5 月至今担任光大保德信永鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2020 年 6 月至今担任光大保德信裕鑫混合型证券投资基金的基金经理，2020 年 10 月至今担任光大保德信行业轮动混合型证券投资基金的基金经理，2021 年 7 月至今担任光大保德信品质生活混合型证券投资基金的基金经理，2021 年 8 月至今担任光大保德信安和债券型证券投资基金的基金经理。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观方面，经济整体景气度呈现高位震荡的局面，总量上暂未形成明显的趋势性方向。生产端数据来看，工业增加值增速有所放缓，但也不乏如中游制造业和医药等行业保持增速高位上行的结构性亮点；而需求端，投资继续改善，但改善幅度与节奏有所波动，消费的修复力度偏弱，但仍然处于缓慢修复的进程中。

权益市场方面，春节前的市场延续了 20 年底以来的强势表现，以“茅指数成分股”为代表的各行业龙头屡创新高；节后则出于对全球通胀预期、美债长端利率快速上行的担忧，A 股和港股市场均出现一轮快速下跌，前期被抱团的高估值“核心资产”跌幅明显。整体上一季度 A 股市场呈现冲高回落的走势，但结构上较为分化，周期和金融板块表现较优，消费和科技板块相对较弱。

光大安和在 21 年一季度操作中，股票仓位相比 20 年四季度略有提升，行业配置上提升了银行、食品饮料、地产、医药等行业的比例，降低了非银、建筑、电力设备板块的权重。

2021 年二季度美债长端利率逐月回落，对新兴市场权益资产估值的压制有所减小，同时美元指数也整体走弱，人民币阶段性压力缓解；同期国内政策环境相对温和，微观流动性较为充裕，通胀预期也随着大宗商品价格的回落而有所缓解。A 股市场在前期的快速下跌之后迎来反弹，但结构上分化明显，以创业板为代表的成长风格表现亮眼。

光大安和在 21 年二季度操作中，股票仓位相比一季度略有提升，行业配置上提升了食品饮料、非银、银行等行业的比例，降低了传媒、机械板块的权重。

债券市场方面，收益率整体下行。具体而言，短端下行幅度大于长端，短端 1 年国债和 1 年国开二季度末为 2.45% 和 2.49%，分别下行 13bp 和 31bp。长端 10 年国债和 10 年国开二季度末为 3.08% 和 3.49%，均下行 11bp。企业债方面，1Y 的 AAA 企业债二季度末为 2.93%，下行 9bp。稍长久期的信用债分化，3Y 的 AAA 和 AA 的信用债二季度末为 3.38% 和 4.01%，分别下行 16bp 和下行 26bp。

光大安和在本报告期内保持了仓位调整的灵活性，组合配置上维持资产负债匹配原则，维持中短久期策略。在信用债券评级方面，增加中高等级信用品种占比。通过审慎和积极的管理，在把握流动性的基础上，为投资者赚取收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内光大保德信安和债券 A 份额净值增长率为 1.33%，业绩比较基准收益率为 2.04%；

本报告期内光大保德信安和债券 C 份额净值增长率增长率为 1.18%，业绩比较基准收益率为 2.04%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，新冠变异病毒可能拖累全球经济的复苏进程，美债长端利率持续走低，对新兴市场权益资产估值的压制减小，但需留意美联储提前退出宽松政策、美元指数反转的冲击。国内方面，7 月初央行超预期降准，有利于无风险利率的下行；7 月底政治局会议对于货币政策“保持流动性合理充裕”的表述未变，预计短期货币政策不会收紧。中短期国内新冠疫情存在进一步扩散的风险，可能对经济和市场带来一定的不确定性。大宗商品在政策层面的管控和干预下，价格有见顶回落迹象，纠正运动式‘减碳’也有助于缓解通胀预期。市场在经历了二季度的分化行情之后，下半年的行业配置上需要平衡好产业前景与估值水平，宏观层面需要关注政策的调控信号，以及流动性和信用的边际变化。

下半年国内我们比较关注的两大变量，第一是外需以及出口的情况，因为其下滑将直接拖累工业增加值的增速；内需方面，消费整体在缓慢恢复，其中必选消费增速平稳，可选消费边际增速改善，这一情况是下半年经济基本面的乐观因素。上游原材料涨价对经济数据边际影响最大的时点已过，但接下来商品价格的走势依然是极大取决于全球需求扩张的强度与速度，也就是外需。而外需向下拐点至少要到三季度末才能看见，因此在外需见顶之前经济基本面预计仍将维持目前平稳但边际增速放缓的情况。如果是在国内宏观面较为稳定的情况下，需要留意美联储货币政策的边际变化对利率产生的溢出效应。

安和权益部分将以金融、医药消费为底仓，适当布局科技股，同时关注低估值顺周期板块，通过波段操作来积累收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》及监管机关有关规定和《光大保德信基金管理有限公司基金估值委员会工作制度》进行。日常估值由基金管理人和本基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计的财务核对同时进行。

报告期内，公司设立由负责运营的高管、运营部代表（包括基金会计）、投研部门代表（包括权益、固定收益业务板块）、监察稽核部代表、IT 部代表、金融工程部门代表人员组成的估值委员会。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，选择基金估值模型及估值模型假设，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。基金估值政策的议定和修改采用集体决策机制，对需采用特别估值的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由

公司估值委员会讨论特别估值方案，同时审慎平衡托管行、审计师意见和基金同业的惯常做法，与托管行沟通后形成建议，经公司管理层批准后由运营部具体执行。估值委员会提交建议一般需获得估值委员会二分之一以上成员同意。

公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和长期相关工作经验，并具有广泛的代表性。

委员会对各相关部门和代表人员的分工如下：投资研究部和运营部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；运营部根据估值的专业技术对需要进行估值政策调整的品种提出初步意见提交估值委员会讨论，负责执行基金估值政策进行日常估值业务，负责与托管行、审计师、基金同业、监管机关沟通估值调整事项；监察稽核部就估值程序的合法合规发表意见；投资研究部负责估值政策调整对投资业绩影响的评估；金融工程负责估值政策调整对投资绩效的评估；IT 部就估值政策调整的技术实现进行评估。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同以及基金实际运作情况，2021 年 3 月 4 日本基金 A 类基金份额每 10 份派发红利 0.225 元，C 类基金份额每 10 份派发红利 0.224 元；2021 年 5 月 24 日本基金 A 类基金份额每 10 份派发红利 0.353 元，C 类基金份额每 10 份派发红利 0.350 元。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2021 年上半年度，基金托管人在光大保德信安和债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2021 年上半年度，光大保德信基金管理有限公司在光大保德信安和债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金进行了 2 次收益分配,本基金本报告期内向 A 级份额持有人分配利润: 174,538,345.73 元, 向 C 级份额持有人分配利润: 26,061,158.13 元, 符合基金合同的规定。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2021 年上半年度，由光大保德信基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关光大保德信安和债券型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

# 6 中期财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：光大保德信安和债券型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	80,755,960.90	256,436,174.81
结算备付金		30,458,954.40	103,783,131.77
存出保证金		117,208.74	1,425,234.73
交易性金融资产	6.4.7.2	3,579,361,062.36	6,390,382,285.78
其中：股票投资		424,086,288.00	544,180,168.12
基金投资		-	-
债券投资		3,155,274,774.36	5,846,202,117.66
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	375,935,230.90	575,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	47,733,142.40	106,513,889.48
应收股利		-	-
应收申购款		20,604,987.42	6,122,826.19
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,134,966,547.12	7,439,663,542.76
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2021 年 6 月 30 日</b>	<b>2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债:</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		302,069,149.89	1,802,367,976.44
应付证券清算款		69,534,585.63	6,145,668.54
应付赎回款		13,536,185.18	88,577,562.40
应付管理人报酬		853,887.02	1,522,753.50
应付托管费		284,628.99	507,584.48
应付销售服务费		105,663.57	228,888.61
应付交易费用	6.4.7.7	74,772.36	912,663.63
应交税费		267,157.31	625,640.95
应付利息		177,197.51	693,694.13
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	104,246.77	211,080.22
负债合计		387,007,474.23	1,901,793,512.90
<b>所有者权益:</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	3,507,514,275.14	4,981,831,798.95
未分配利润	6.4.7.10	240,444,797.75	556,038,230.91
所有者权益合计		3,747,959,072.89	5,537,870,029.86
负债和所有者权益总计		4,134,966,547.12	7,439,663,542.76

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 3,507,514,275.14 份，其中 A 类基金份额总额为 3,124,003,761.80 份，基金份额净值为 1.0695 元；C 类基金份额总额为 383,510,513.34 份，基金份额净值为 1.0612 元。

## 6.2 利润表

会计主体：光大保德信安和债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至	2020 年 1 月 1 日至
		2021 年 6 月 30 日	2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>74,467,753.35</b>	<b>166,447,429.78</b>
1.利息收入		75,015,931.60	75,443,906.94
其中：存款利息收入	6.4.7.11	531,664.77	1,657,245.28
债券利息收入		70,259,652.47	71,943,132.45

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,224,614.36	1,843,529.21
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-32,848,767.33	86,936,572.04
其中：股票投资收益	6.4.7.12	5,407,142.37	123,721,214.69
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-41,013,422.37	-41,738,268.36
资产支持证券投资收益	6.4.7.15	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.16	-	-
衍生工具收益	6.4.7.17	-	-
股利收益	6.4.7.18	2,757,512.67	4,953,625.71
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	32,238,187.00	3,908,106.18
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	62,402.08	158,844.62
<b>减：二、费用</b>		<b>15,424,895.96</b>	<b>26,458,186.99</b>
1. 管理人报酬		6,150,654.19	7,076,837.43
2. 托管费		2,050,218.07	2,358,945.79
3. 销售服务费		805,000.54	652,423.18
4. 交易费用	6.4.7.21	377,975.14	11,766,762.42
5. 利息支出		5,688,151.09	4,291,783.53
其中：卖出回购金融资产支出		5,688,151.09	4,291,783.53
6.税金及附加		222,253.42	176,590.95
7. 其他费用	6.4.7.22	130,643.51	134,843.69
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>59,042,857.39</b>	<b>139,989,242.79</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>59,042,857.39</b>	<b>139,989,242.79</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：光大保德信安和债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,981,831,798.95	556,038,230.91	5,537,870,029.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	59,042,857.39	59,042,857.39

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,474,317,523.81	-174,036,786.69	-1,648,354,310.50
其中：1.基金申购款	1,104,790,741.10	100,216,930.89	1,205,007,671.99
2.基金赎回款	-2,579,108,264.91	-274,253,717.58	-2,853,361,982.49
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-200,599,503.86	-200,599,503.86
五、期末所有者权益（基金净值）	3,507,514,275.14	240,444,797.75	3,747,959,072.89
项目	上年度可比期间		
	2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,881,567,739.51	163,564,377.78	2,045,132,117.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	139,989,242.79	139,989,242.79
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	5,546,745,171.24	566,684,716.01	6,113,429,887.25
其中：1.基金申购款	7,380,861,617.26	748,237,771.89	8,129,099,389.15
2.基金赎回款	-1,834,116,446.02	-181,553,055.88	-2,015,669,501.90
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-284,163,649.24	-284,163,649.24
五、期末所有者权益（基金净值）	7,428,312,910.75	586,074,687.34	8,014,387,598.09

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘翔，主管会计工作负责人：贺敬哲，会计机构负责人：王永万

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

光大保德信安和债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1598号《关于准予光大保德信安和债券型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人光大保德信基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于2017年1

月 5 日正式生效，首次设立募集规模为 380,397,743.54 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及注册登记机构为光大保德信基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为 A 类和 C 类基金份额。对于 A 类基金份额，投资者认购/申购时收取前端认购费或申购费，但不从本类别基金资产中计提销售服务费；对于 C 类基金份额，在投资者认购/申购时不收取前后端认购费或申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、金融债、地方政府债、信用债（即企业债、公司债、次级债、短期融资券、中期票据、中小企业私募债、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、证券公司短期公司债等非国家信用的固定收益类金融工具）、资产支持证券、央行票据、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货等固定收益金融工具，股票、权证等权益类资产，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种。本基金可持有可转换债券转股所得的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证，也可直接买入股票和权证。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；权益类资产的投资比例不高于基金资产的 20%；其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金业绩比较基准：中债综合财富(总值)指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集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》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》及其他中国证监会及



中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### 6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得

的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对本基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

#### 6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个体，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### 6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，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，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，

对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	80,755,960.90
定期存款	-
其他存款	-
合计	80,755,960.90

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	405,303,932.02	424,086,288.00	18,782,355.98
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	316,469,681.65	316,949,774.36
	银行间市场	2,839,680,803.70	2,838,325,000.00
	合计	3,156,150,485.35	3,155,274,774.36
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,561,454,417.37	3,579,361,062.36	17,906,644.99

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	302,000,000.00	-
银行间市场	73,935,230.90	-
合计	375,935,230.90	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期内未投资买断式回购。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	3,382.54
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	13,706.60
应收债券利息	47,707,931.08
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	8,069.48

应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	52.70
合计	47,733,142.40

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	34,324.88
银行间市场应付交易费用	40,447.48
合计	74,772.36

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	108.42
应付证券出借违约金	-
预提审计费	44,630.98
预提信息披露费	59,507.37
合计	104,246.77

#### 6.4.7.9 实收基金

光大保德信安和债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	4,257,487,450.22	4,257,487,450.22
本期申购	994,824,440.88	994,824,440.88
本期赎回（以“-”号填列）	-2,128,308,129.30	-2,128,308,129.30

本期末	3,124,003,761.80	3,124,003,761.80
-----	------------------	------------------

光大保德信安和债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	724,344,348.73	724,344,348.73
本期申购	109,966,300.22	109,966,300.22
本期赎回（以“-”号填列）	-450,800,135.61	-450,800,135.61
本期末	383,510,513.34	383,510,513.34

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

**6.4.7.10 未分配利润**

光大保德信安和债券 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	346,977,588.98	132,530,712.82	479,508,301.80
本期利润	24,166,136.25	27,540,439.24	51,706,575.49
本期基金份额交易产生的变动数	-97,157,625.92	-42,533,557.77	-139,691,183.69
其中：基金申购款	50,807,726.87	38,600,090.64	89,407,817.51
基金赎回款	-147,965,352.79	-81,133,648.41	-229,099,001.20
本期已分配利润	-174,538,345.73	-	-174,538,345.73
本期末	99,447,753.58	117,537,594.29	216,985,347.87

光大保德信安和债券 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	54,000,650.16	22,529,278.95	76,529,929.11
本期利润	2,638,534.14	4,697,747.76	7,336,281.90
本期基金份额交易产生的变动数	-21,523,979.57	-12,821,623.43	-34,345,603.00
其中：基金申购款	6,533,125.90	4,275,987.48	10,809,113.38
基金赎回款	-28,057,105.47	-17,097,610.91	-45,154,716.38
本期已分配利润	-26,061,158.13	-	-26,061,158.13
本期末	9,054,046.60	14,405,403.28	23,459,449.88

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	176,024.20
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	351,212.12
其他	4,428.45
合计	531,664.77

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	183,583,779.20
减：卖出股票成本总额	178,176,636.83
买卖股票差价收入	5,407,142.37

#### 6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

##### 6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-41,013,422.37
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-41,013,422.37

##### 6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,549,594,046.72

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,504,599,873.15
减：应收利息总额	86,007,595.94
买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-41,013,422.37

#### 6.4.7.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.16 贵金属投资收益

本基金报告期末未持有贵金属。

#### 6.4.7.17 衍生工具收益

本基金报告期内没有衍生工具收益。

#### 6.4.7.18 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,757,512.67
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,757,512.67

#### 6.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	32,238,187.00
——股票投资	-11,916,143.52
——债券投资	44,154,330.52
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-



合计	32,238,187.00
----	---------------

#### 6.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	62,270.56
转换费收入	131.52
合计	62,402.08

#### 6.4.7.21 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	345,212.64
银行间市场交易费用	32,762.50
合计	377,975.14

#### 6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行间汇划费用	8,105.16
帐户维护费	17,800.00
其他费用	600.00
合计	130,643.51

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需做披露资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
光大保德信基金管理有限公司(简称"光大保德信")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司(简称"交通银行")	基金托管人、基金销售机构
光大证券股份有限公司(简称"光大证券")	基金管理人的股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
光大证券	7,205,149.86	2.84%	1,808,176,359.46	21.17%

**6.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行权证交易。

**6.4.10.1.3 债券交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期债券成交总额的 比例
光大证券	78,308,594.08	20.48%	350,159,023.94	39.61%

## 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的 比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的 比例
光大证券	1,937,000,000.00	4.72%	6,893,000,000.00	22.11%

## 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例
光大证券	6,685.96	4.97%	6,685.96	19.48%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例
光大证券	1,664,381.06	24.49%	1,275,754.09	28.62%

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

## 6.4.10.2 关联方报酬

## 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,150,654.19	7,076,837.43
其中：支付销售机构的客户维护费	1,209,926.83	1,352,419.61

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.3% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,050,218.07	2,358,945.79

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	光大保德信安和债券 A	光大保德信安和债券 C	合计
光大保德信	-	7,821.19	7,821.19
交通银行	-	1,841.05	1,841.05
光大证券	-	5,197.84	5,197.84
合计	-	14,860.08	14,860.08
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	光大保德信安和债券 A	光大保德信安和债券 C	合计

光大保德信	-	182,027.80	182,027.80
交通银行	-	3,989.87	3,989.87
光大证券	-	32,864.72	32,864.72
合计	-	218,882.39	218,882.39

注：销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金份额分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额销售服务费年费率为 0.3%。

本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间管理人未投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

光大保德信安和债券 A

份额单位：份

关联方名称	光大保德信安和债券A本期末 2021年6月30日		光大保德信安和债券A上年度末 2020年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额占 基金总份额的比例
光大保德信资产管理 有限公司	33,539,563.94	1.07%	31,815,446.29	0.75%

光大保德信安和债券 C

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资光大安和 C 类基金。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	80,755,960.90	176,024.20	134,804,196.90	1,480,768.01

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

光大保德信安和债券 A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	利润分配合 计	备注
		场 内	场 外					
1	2021-03-04	-	2021-03-04	0.225	49,543,087.57	24,411,636.10	73,954,723.67	-
2	2021-05-24	-	2021-05-24	0.353	65,948,416.97	34,635,205.09	100,583,622.06	-
合计				0.578	115,491,504.54	59,046,841.19	174,538,345.73	-

光大保德信安和债券 C

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份 基金份额	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总	利润分配合 计	备注
----	-------	-----	----------------	--------------	--------------	------------	----

		场 内	场 外	分红数		额		
1	2021-03-04	-	2021-03-04	0.224	8,471,174.02	2,814,844.77	11,286,018.79	-
2	2021-05-24	-	2021-05-24	0.350	10,604,261.63	4,170,877.71	14,775,139.34	-
合计				0.574	19,075,435.65	6,985,722.48	26,061,158.13	-

#### 6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 300,069,149.89 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
170206	17 国开 06	2021-07-05	101.18	1,100,000.00	111,298,000.00
042100183	21 电网 CP001	2021-07-01	100.17	1,100,000.00	110,187,000.00
160421	16 农发 21	2021-07-05	100.07	1,006,000.00	100,670,420.00
102001109	20 中石化 MTN003	2021-07-01	98.33	25,000.00	2,458,250.00
合计				3,231,000.00	324,613,670.00

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 2,000,000.00 元，于 2021 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金管理人制定了内部管理制度和流程来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理体系包括三个层次：第一层次是基于自我评估和管理的业务/职能部门；第二层次是公司经营层的风险管理工作委员会；第三层次是董事会下设的风险管理委员会。

各业务/职能部门是公司风险管理工作最直接的实施者，负责根据公司风险管理政策和制度，制订本部门的风险管理计划、工作流程及相关管理责任，并报请风险管理工作委员会审议批准；对本部门的主要风险指标，以及相关的测量、管理方法提出建议，并及时更新，报请风险管理工作委员会审议批准；实施本部门的风险管理日常工作，定期进行自我评估，并向风险管理工作委员会报告评估情况。

风险管理工作委员会是公司经营层面负责风险管理的最高权力机构，根据公司董事会和风险管理工作委员会制订的风险管理政策和授权，负责公司日常的风险管理工作。

风险管理委员会是公司风险管理的最高权力机构，其机构组成、运行方式和相应职责应由董事会规定。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及



汇总。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
A-1	80,283,000.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	220,574,000.00	245,263,500.00
合计	300,857,000.00	245,263,500.00

注：未评级债券包括：一般短期融资券、超短期融资债券、政策性金融债。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	99,230,000.00
合计	-	99,230,000.00

注：本基金持有同业存单的主体评级均为 AA+及以上评级。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
AAA	1,636,716,186.18	2,046,524,946.41
AAA 以下	996,326,588.18	2,952,410,195.65
未评级	221,375,000.00	502,773,475.60
合计	2,854,417,774.36	5,501,708,617.66

注：未评级债券包括：政策性金融债。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、清算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售证券等。本基金通过监控组合的久期来评估基金面临的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	80,755,960.90	-	-	-	-	-	80,755,960.90
结算备付金	30,458,954.	-	-	-	-	-	30,458,954.

	40						40
存出保证金	117,208.74	-	-	-	-	-	117,208.74
交易性金融资产	111,077,000.00	81,010,064.60	667,828,000.00	2,224,401,254.80	70,958,454.96	424,086,288.00	3,579,361,062.36
买入返售金融资产	375,935,230.90	-	-	-	-	-	375,935,230.90
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	47,733,142.40	47,733,142.40
应收申购款	-	-	-	-	-	20,604,987.42	20,604,987.42
资产总计	598,344,354.94	81,010,064.60	667,828,000.00	2,224,401,254.80	70,958,454.96	492,424,417.82	4,134,966,547.12
负债							
卖出回购金融资产	302,069,149.89	-	-	-	-	-	302,069,149.89
应付证券清算款	-	-	-	-	-	69,534,585.63	69,534,585.63
应付赎回款	-	-	-	-	-	13,536,185.18	13,536,185.18
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	853,887.02	853,887.02
应付托管费	-	-	-	-	-	284,628.99	284,628.99
应付交易费用	-	-	-	-	-	74,772.36	74,772.36
其他负债	-	-	-	-	-	104,246.77	104,246.77
应交税费	-	-	-	-	-	267,157.31	267,157.31
应付销售服务费	-	-	-	-	-	105,663.57	105,663.57
应付利息	-	-	-	-	-	177,197.51	177,197.51
负债总计	302,069,149.89	-	-	-	-	84,938,324.34	387,007,474.23
利率敏感度缺口	296,275,205.05	81,010,064.60	667,828,000.00	2,224,401,254.80	70,958,454.96	407,486,093.48	3,747,959,072.89
上年度末 2020年12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产							
银行存款	256,436,17 4.81	-	-	-	-	-	256,436,17 4.81
结算备付金	103,783,13 1.77	-	-	-	-	-	103,783,13 1.77
存出保证金	1,425,234.7 3	-	-	-	-	-	1,425,234.7 3
交易性金融资产	270,540,00 0.00	472,057,23 2.67	436,080,07 3.59	4,652,320,8 11.40	15,204,000. 00	544,180,16 8.12	6,390,382,2 85.78
买入返售金融资产	575,000,00 0.00	-	-	-	-	-	575,000,00 0.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	106,513,88 9.48	106,513,88 9.48
应收申购款	-	-	-	-	-	6,122,826.1 9	6,122,826.1 9
资产总计	1,207,184,5 41.31	472,057,23 2.67	436,080,07 3.59	4,652,320,8 11.40	15,204,000. 00	656,816,88 3.79	7,439,663,5 42.76
负债							
卖出回购金融资产	1,802,367,9 76.44	-	-	-	-	-	1,802,367,9 76.44
应付证券清算款	-	-	-	-	-	6,145,668.5 4	6,145,668.5 4
应付赎回款	-	-	-	-	-	88,577,562. 40	88,577,562. 40
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,522,753.5 0	1,522,753.5 0
应付托管费	-	-	-	-	-	507,584.48	507,584.48
应付交易费用	-	-	-	-	-	912,663.63	912,663.63
其他负债	-	-	-	-	-	211,080.22	211,080.22
应交税费	-	-	-	-	-	625,640.95	625,640.95
应付销售服务费	-	-	-	-	-	228,888.61	228,888.61
应付利息	-	-	-	-	-	693,694.13	693,694.13
负债总计	1,802,367,9 76.44	-	-	-	-	99,425,536. 46	1,901,793,5 12.90
利率敏感度缺口	-595,183,43 5.13	472,057,23 2.67	436,080,07 3.59	4,652,320,8 11.40	15,204,000. 00	557,391,34 7.33	5,537,870,0 29.86

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动；		
	利率变动范围合理。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的	
		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
		2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
	基准利率上升 1%	减少约 40,691,530.10	减少约 93,201,944.10
	基准利率下降 1%	增加约 40,691,530.10	增加约 93,201,944.10

注：上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的基金管理人每日对投资组合的行业和个券的集中度进行监控，并定期分析其相对业绩比较基准的偏离度。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，通过压力测试来评估本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	424,086,288.00	11.32	544,180,168.12	9.83
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	34,448,329.76	0.92	262,042,931.86	4.73
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	458,534,617.76	12.23	806,223,099.98	14.56

注：债券投资仅包含可交换债券，可转换债券。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金本期末及上年度末持有的交易性权益类投资比例较低，因此市场价格风险因素对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	424,086,288.00	10.26
	其中：股票	424,086,288.00	10.26
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	3,155,274,774.36	76.31
	其中：债券	3,155,274,774.36	76.31
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	375,935,230.90	9.09
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	111,214,915.30	2.69
8	其他各项资产	68,455,338.56	1.66
9	合计	4,134,966,547.12	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	154,688,784.00	4.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	560,900.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,247,600.00	0.33
J	金融业	185,167,500.00	4.94
K	房地产业	44,623,000.00	1.19
L	租赁和商务服务业	15,305,100.00	0.41
M	科学研究和技术服务业	7,140,504.00	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	579,900.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	3,773,000.00	0.10



S	综合	-	-
	合计	424,086,288.00	11.32

### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末投资沪港通股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601398	工商银行	20,400,000.00	105,468,000.00	2.81
2	600519	贵州茅台	39,400.00	81,033,980.00	2.16
3	600048	保利地产	2,800,000.00	33,712,000.00	0.90
4	601939	建设银行	4,600,000.00	30,590,000.00	0.82
5	600031	三一重工	680,000.00	19,767,600.00	0.53
6	601166	兴业银行	904,600.00	18,589,530.00	0.50
7	601888	中国中免	51,000.00	15,305,100.00	0.41
8	000858	五粮液	49,000.00	14,596,610.00	0.39
9	601688	华泰证券	720,000.00	11,376,000.00	0.30
10	000001	平安银行	452,500.00	10,235,550.00	0.27
11	601288	农业银行	2,504,000.00	7,587,120.00	0.20
12	600383	金地集团	740,000.00	7,577,600.00	0.20
13	300014	亿纬锂能	72,400.00	7,524,532.00	0.20
14	603259	药明康德	45,600.00	7,140,504.00	0.19
15	600570	恒生电子	72,400.00	6,751,300.00	0.18
16	000333	美的集团	85,000.00	6,066,450.00	0.16
17	300760	迈瑞医疗	12,000.00	5,760,600.00	0.15
18	000651	格力电器	100,000.00	5,210,000.00	0.14
19	600588	用友网络	155,000.00	5,155,300.00	0.14
20	300413	芒果超媒	55,000.00	3,773,000.00	0.10
21	000661	长春高新	9,000.00	3,483,000.00	0.09
22	000002	万科A	140,000.00	3,333,400.00	0.09
23	002371	北方华创	8,000.00	2,219,040.00	0.06
24	600872	中炬高新	51,600.00	2,168,232.00	0.06
25	600060	海信视像	100,800.00	1,703,520.00	0.05
26	000568	泸州老窖	6,000.00	1,415,640.00	0.04

27	002007	华兰生物	25,000.00	917,000.00	0.02
28	002142	宁波银行	20,000.00	779,400.00	0.02
29	601100	恒立液压	9,000.00	773,280.00	0.02
30	002821	凯莱英	2,000.00	745,200.00	0.02
31	600104	上汽集团	30,000.00	659,100.00	0.02
32	002415	海康威视	10,000.00	645,000.00	0.02
33	300347	泰格医药	3,000.00	579,900.00	0.02
34	603939	益丰药房	10,000.00	560,900.00	0.01
35	600036	招商银行	10,000.00	541,900.00	0.01
36	002410	广联达	5,000.00	341,000.00	0.01

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601688	华泰证券	11,883,566.00	0.21
2	000858	五粮液	5,816,575.36	0.11
3	000333	美的集团	4,080,742.00	0.07
4	000002	万科A	3,985,919.00	0.07
5	600570	恒生电子	3,508,929.00	0.06
6	600383	金地集团	2,928,621.00	0.05
7	000661	长春高新	2,726,280.00	0.05
8	600104	上汽集团	2,672,987.00	0.05
9	601166	兴业银行	2,376,500.00	0.04
10	600588	用友网络	1,929,311.70	0.03
11	000568	泸州老窖	1,875,200.00	0.03
12	300760	迈瑞医疗	1,806,170.00	0.03
13	000651	格力电器	1,778,246.07	0.03
14	601888	中国中免	1,756,980.00	0.03
15	600060	海信视像	1,635,360.00	0.03
16	601658	邮储银行	1,582,000.00	0.03
17	000001	平安银行	1,568,850.00	0.03
18	600036	招商银行	1,343,000.00	0.02
19	601100	恒立液压	1,093,242.00	0.02
20	600048	保利地产	1,048,600.00	0.02

##### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例
----	------	------	----------	-------------

				(%)
1	601668	中国建筑	21,272,936.00	0.38
2	601688	华泰证券	17,901,057.00	0.32
3	601288	农业银行	16,201,440.00	0.29
4	601398	工商银行	13,477,559.90	0.24
5	601211	国泰君安	11,038,436.29	0.20
6	601939	建设银行	9,296,080.00	0.17
7	603690	至纯科技	8,675,635.38	0.16
8	603288	海天味业	8,295,950.00	0.15
9	002371	北方华创	5,896,269.00	0.11
10	000729	燕京啤酒	5,264,994.00	0.10
11	002050	三花智控	4,808,696.20	0.09
12	300413	芒果超媒	4,383,826.90	0.08
13	600585	海螺水泥	3,950,681.40	0.07
14	600309	万华化学	3,898,687.00	0.07
15	300014	亿纬锂能	3,707,779.00	0.07
16	002142	宁波银行	3,448,321.00	0.06
17	600048	保利地产	3,333,335.00	0.06
18	601318	中国平安	3,289,780.00	0.06
19	601888	中国中免	3,124,000.00	0.06
20	300750	宁德时代	2,580,300.00	0.05

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	69,998,900.23
卖出股票的收入（成交）总额	183,583,779.20

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	261,319,000.00	6.97
	其中：政策性金融债	221,375,000.00	5.91

4	企业债券	536,184,444.60	14.31
5	企业短期融资券	300,857,000.00	8.03
6	中期票据	2,022,466,000.00	53.96
7	可转债（可交换债）	34,448,329.76	0.92
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,155,274,774.36	84.19

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	101754046	17 华电股 MTN001	1,100,000	111,870,000.00	2.98
2	170206	17 国开 06	1,100,000	111,298,000.00	2.97
3	042100183	21 电网 CP001	1,100,000	110,187,000.00	2.94
4	160421	16 农发 21	1,100,000	110,077,000.00	2.94
5	101901518	19 广州金控 MTN002	1,000,000	101,540,000.00	2.71

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

基金管理人可运用国债期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在国债期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与国债期货的投资，以管理投资组合的利率风险，改善组合的风险收益特性。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 本报告期投资基金情况

### 7.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

## 7.13 投资组合报告附注

7.13.1 工商银行（601398）的发行主体中国工商银行股份有限公司于 2021 年 1 月 8 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚（银保监罚决字（2020）71 号），具体内容为：一、未按规定将案件风险事件确认为案件并报送案件信息确认报告；二、关键岗位未进行实质性轮岗；三、法人账户日间透支业务存在资金用途管理的风险漏洞；四、为同业投资业务提供隐性担保；五、理财产品通过申购/赎回净值型理财产品调节收益；六、非标准化债权资产限额测算不准确；七、理财资金通过投资集合资金信托计划优先级的方式变相放大劣后级受益人的杠杆比例；八、部分重点领域业务未向监管部门真实反映；九、为违规的政府购买服务项目提供融资；十、理财资金违规用于缴纳或置换土地款；十一、通过转让分级互投实现不良资产虚假出表；十二、理财资金投资本行不良资产或不良资产收益权；十三、面向一般个人客户发行的理财产品投资权益性资产；十四、理财资金投资他行信贷资产收益权或非标资产收益权；十五、全权委托业务不规范；十六、用其他资金支付结构性存款收益；十七、自营贷款承接本行理财融资、贷款用途管理不尽职；十八、理财资金承接本行自营贷款；十九、封闭式理财产品相互交易调节收益；二十、滚动发行产品承接风险资产，且按原价交易调节收益；二十一、高净值客户认定不审慎；二十二、理财产品信息披露不到位；二十三、部

分理财产品在全国银行业理财信息登记系统中未登记或超时限登记。行政处罚决定为：银保监罚决字（2020）71 号：罚款 5470 万元

基金管理人按照内部研究工作规范对该股票进行分析后将其列入基金投资对象备选库并跟踪研究。该行政处罚事件发生后，基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

17 国开 06（170206.IB）的发行主体国家开发银行于 2020 年 12 月 25 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字〔2020〕67 号），主要内容为：一、为违规的政府购买服务项目提供融资。二、项目资本金管理不到位，棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况。三、违规变相发放土地储备贷款。四、设置不合理存款考核要求，以贷转存，虚增存款。五、贷款风险分类不准确。六、向资产管理公司以外的主体批量转让不良信贷资产。七、违规进行信贷资产拆分转让，隐匿信贷资产质量。八、向棚改业务代理结算行强制搭售低收益理财产品。九、扶贫贷款存贷挂钩。十、易地扶贫搬迁贷款“三查”不尽职，部分贷款资金未真正用于扶贫搬迁。十一、未落实同业业务交易对手名单制监管要求。十二、以贷款方式向金融租赁公司提供同业融资，未纳入同业借款业务管理。十三、以协定存款方式吸收同业存款，未纳入同业存款业务管理。十四、风险隔离不到位，违规开展资金池理财业务。十五、未按规定向投资者充分披露理财产品投资非标准化债权资产情况。十六、逾期未整改，屡查屡犯，违规新增业务。十七、利用集团内部交易进行子公司间不良资产非洁净出表。十八、违规收取小微企业贷款承诺费。十九、收取财务顾问费质价不符。二十、利用银团贷款承诺费浮利分费。二十一、向检查组提供虚假整改说明材料。二十二、未如实提供信贷资产转让台账。二十三、案件信息迟报、瞒报。二十四、对以往监管检查中发现的国别风险管理问题整改不到位。中国银行保险监督管理委员会作出行政处罚决定为罚款 4880 万元。

基金管理人按照内部研究工作规范对该发行主体进行分析后将其列入基金投资对象备选库并跟踪研究。该行政处罚事件发生后，基金管理人密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

除上述证券外，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。

7.13.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	117,208.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	47,733,142.40
5	应收申购款	20,604,987.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	68,455,338.56

#### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	127012	招路转债	9,778,260.80	0.26
2	110043	无锡转债	4,017,042.00	0.11
3	123070	鹏辉转债	3,690,193.80	0.10
4	110067	华安转债	3,222,600.00	0.09
5	128129	青农转债	3,205,051.98	0.09
6	113011	光大转债	2,868,695.60	0.08
7	128107	交科转债	2,520,763.20	0.07
8	127022	恒逸转债	2,456,000.00	0.07
9	127005	长证转债	44,513.20	0.00

#### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

报告期内本基金没有其他需要说明的重要事项。

## 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
光大保德信安和债券 A	81,843	38,170.69	2,319,191,174.05	74.24%	804,812,587.75	25.76%
光大保德信安和债券 C	79,884	4,800.84	700,298.42	0.18%	382,810,214.92	99.82%
合计	161,727	21,687.87	2,319,891,472.47	66.14%	1,187,622,802.67	33.86%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	光大保德信安和债券 A	425,137.00	0.01%
	光大保德信安和债券 C	185,891.94	0.05%
	合计	611,028.94	0.02%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	光大保德信安和债券 A	0
	光大保德信安和债券 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	光大保德信安和债券 A	-
	光大保德信安和债券 C	-
	合计	-

注：本基金的基金经理未持有本基金的份额。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份



项目	光大保德信安和债券 A	光大保德信安和债券 C
基金合同生效日（2017 年 1 月 5 日）基金份额总额	44,494,885.17	335,902,858.37
本报告期期初基金份额总额	4,257,487,450.22	724,344,348.73
本报告期基金总申购份额	994,824,440.88	109,966,300.22
减：本报告期基金总赎回份额	2,128,308,129.30	450,800,135.61
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,124,003,761.80	383,510,513.34

## 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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

本报告期内，经公司十届十三次董事会会议审议通过，自 2021 年 2 月 2 日起，梅雷军先生正式离任公司副总经理、首席运营总监兼首席信息官，自 2021 年 2 月 26 日起，贺敬哲先生正式担任公司副总经理兼首席信息官。

本报告期内，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐轶。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略无改变。

### 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金报告期内未持有基金。

### 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所情况。

### 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的基金管理人和基金托管人的托管业务部门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。

### 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

	单元数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
平安证券	1	513,000.00	0.20%	467.50	0.35%	-
银河证券	1	2,046,325.00	0.81%	1,864.80	1.39%	-
东吴证券	2	4,285,933.00	1.69%	3,905.70	2.90%	-
中泰证券	1	6,160,560.00	2.43%	5,614.15	4.17%	-
信达证券	1	6,841,475.90	2.70%	6,234.63	4.63%	-
光大证券	2	7,205,149.86	2.84%	6,685.96	4.97%	-
方正证券	1	8,423,118.00	3.32%	7,676.02	5.70%	-
东北证券	2	10,940,833.70	4.31%	9,970.22	7.41%	-
东方财富	4	207,148,858.97	81.69%	92,169.96	68.48%	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-

注：1) 报告期内租用证券公司交易单元变更情况

本基金本报告期内新增交易单元：东方财富49639、012133席位

本基金本报告期内撤销交易单元：东方财富38144、003553席位

(2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

基金管理人选择证券经营机构，并选用其交易单元供本基金买卖证券专用，应本着安全、高效、低成本，能够为本基金提供高质量增值研究服务的原则，对该证券经营机构的经营情况、治理情况、研究实力等进行综合考量。

基本选择标准如下：

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；

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。

(3) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

投资研究团队按照(2)中列出的有关经营情况、治理情况的选择标准，对备选的证券经营机构进行初步筛选；

对通过初选的各证券经营机构，投资研究团队各成员在其分管行业或领域的范围内，对该机构所提供的研究报告和信息资讯进行评分。

根据各成员评分，得出各证券经营机构的综合评分。

投资研究团队根据各机构的得分排名，拟定要选用其专用交易单元的证券经营机构，并报本管理人董事会批准。

经董事会批准后，由本管理人交易部门、运营部门配合完成专用交易单元的具体租用事宜。

### 10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
平安证券	11,723,551.17	3.07%	-	-	-	-
银河证券	16,861,006.14	4.41%	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	3,727,835.79	0.97%	-	-	-	-
信达证券	5,953,345.37	1.56%	-	-	-	-
光大证券	78,308,594.08	20.48%	1,937,000,000.00	4.72%	-	-
方正证券	85,414,242.79	22.34%	14,310,000,000.00	34.84%	-	-
东北证券	19,923,920.32	5.21%	4,273,000,000.00	10.40%	-	-
东方财富	160,496,428.11	41.97%	20,548,100,000.00	50.03%	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

东方证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-

## 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	光大保德信基金管理有限公司旗下基金 2020 年 12 月 31 日基金份额净值及累计净值公告	基金管理人公司网站、中国证监会基金电子披露网站及本基金选定的信息披露报纸	2021-01-01
2	光大保德信基金管理有限公司关于暂停使用招商银行直付通服务办理直销网上交易部分业务的公告	同上	2021-01-18
3	光大保德信安和债券型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	同上	2021-01-22
4	光大保德信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	同上	2021-02-02
5	光大保德信安和债券型证券投资基金(光大保德信安和债券 A) 基金产品资料概要更新	同上	2021-02-03
6	光大保德信安和债券型证券投资基金(光大保德信安和债券 C) 基金产品资料概要更新	同上	2021-02-03
7	光大保德信安和债券型证券投资基金招募说明书【更新】	同上	2021-02-03
8	光大保德信安和债券型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资的公告	同上	2021-02-26
9	光大保德信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	同上	2021-02-26
10	光大保德信安和债券型证券投资基金分红公告	同上	2021-03-02
11	光大保德信安和债券型证券投资基金恢复大额申购、转换转入、定期定额投资的公告	同上	2021-03-03
12	光大保德信安和债券型证券投资基金基金经理变更公告	同上	2021-03-05
13	光大保德信安和债券型证券投资基金(光大保德信安和债券 A) 基金产品资料概要更新	同上	2021-03-08
14	光大保德信安和债券型证券投资基金(光大保德信安和债券 C) 基金产品资料概要更新	同上	2021-03-08
15	光大保德信安和债券型证券投资基金招募说明书(更新)	同上	2021-03-08
16	光大保德信安和债券型证券投资基金基金经	同上	2021-03-20

	理变更公告		
17	光大保德信安和债券型证券投资基金(光大保德信安和债券 A) 基金产品资料概要更新	同上	2021-03-23
18	光大保德信安和债券型证券投资基金(光大保德信安和债券 C) 基金产品资料概要更新	同上	2021-03-23
19	光大保德信安和债券型证券投资基金招募说明书(更新)	同上	2021-03-23
20	光大保德信安和债券型证券投资基金 2020 年年度报告	同上	2021-03-31
21	光大保德信安和债券型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	同上	2021-04-22
22	光大保德信安和债券型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资的公告	同上	2021-05-19
23	光大保德信安和债券型证券投资基金分红公告	同上	2021-05-20
24	光大保德信安和债券型证券投资基金恢复大额申购、转换转入、定期定额投资的公告	同上	2021-05-21

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期不存在单一投资者持有基金份额比例超过20%的情形。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准光大保德信安和债券型证券投资基金设立的文件
- 2、光大保德信安和债券型证券投资基金基金合同
- 3、光大保德信安和债券型证券投资基金招募说明书
- 4、光大保德信安和债券型证券投资基金托管协议
- 5、光大保德信安和债券型证券投资基金法律意见书
- 6、报告期内光大保德信安和债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告
- 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

## 12.2 存放地点

上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢（北区 3 号楼），6-7 层、10 层本基金管理人办公地址。

## 12.3 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：4008-202-888，021-80262888。公司网址：[www.epf.com.cn](http://www.epf.com.cn)。

光大保德信基金管理有限公司

二〇二一年八月三十一日