

**光大保德信优势配置混合型证券投资基金**  
**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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<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.....	8
<b>4 管理人报告</b> .....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>5 托管人报告</b> .....	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
<b>6 中期财务会计报告（未经审计）</b> .....	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
<b>7 投资组合报告</b> .....	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	50
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.....	50
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.....	50
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.....	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 本报告期投资基金情况.....	51
7.13 投资组合报告附注.....	51
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	52

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>53</b>
<b>10 重大事件揭示</b> .....	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
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 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4 基金投资策略的改变 .....	53
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	53
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
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 .....	53
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
10.9 其他重大事件 .....	56
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>57</b>
<b>12 备查文件目录</b> .....	<b>57</b>
12.1 备查文件目录 .....	57
12.2 存放地点 .....	57
12.3 查阅方式 .....	57

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	光大保德信优势配置混合型证券投资基金
基金简称	光大保德信优势配置混合
基金主代码	360007
交易代码	360007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年8月24日
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,202,510,252.73 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金追求投资回报的实现，在严格管理风险的基础上，根据证券市场的变化进行行业配置，通过科学投资争取为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的回报。
投资策略	<p>本基金为追求绝对收益的基金，强调在敏锐把握证券市场和中国宏观经济变化方向的基础上，适当配置资产在各类证券和行业之间的比重，通过收益管理和稳健的投资操作为基金份额持有人谋取超过业绩比较基准的稳定回报。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>（1）宏观经济运行的变化和国家的宏观调控政策将对证券市场产生深刻影响。本基金通过综合国内外宏观经济状况、国家财政政策、央行货币政策、物价水平变化趋势等因素，构建宏观经济分析平台；</p> <p>（2）运用历史数据并结合光大保德信内部的定性和定量分析模型，确定影响各类资产收益水平的先行指标，将上一步的宏观经济分析结果量化为对先行指标的影响，进而判断对各类资产收益的影响；</p> <p>（3）结合上述宏观经济对各类资产未来收益影响的分析结果和本基金投资组合的风险预算管理，确定各类资产的投资比重。</p> <p>2、股票类品种投资策略</p> <p>（1）行业配置策略</p> <p>在行业配置方面，本基金将主要投资于国家重点支柱型产业。由于国家重点支柱产业代表了未来中国经济的发展方向，为中国经济的增长提供了强劲的动力，因此，这些行业必将随着中国经济的高速发展而发展，处于这些产业中的上市公司具有业务增长快、盈利能力持续稳健上升的特点。</p> <p>在具体的行业选择上，本基金将从三个维度进行考虑：一是从全球产业分工和全球化背景下我国的比较优势角度；二是从国家的宏观经济调控和产业政策角度，即行业发展受国民经济发展的拉动作用的大小；三是从行业竞争状况、盈利状况、行业所处生命周期和行业平均市盈率、市净率、等角度进行敏感度分析。在以上综合分析的基础上，利用公司开发的树状集群评价体系选择出本基金投资的重点考虑行业。</p>

树状集群行业分析体系是本基金行业分析及配置的主要工具,该体系利用定量和定性指标对不同行业进行重点因素分析。在定量方面主要利用行业投资回报(行业平均的资本回报率等)、行业盈利状况(行业平均的利润率等)、行业估值水平等指标;在定性方面则重点考虑利用行业周期阶段、行业竞争状况、产业政策、行业进入壁垒、买方议价能力等指标。

#### (2) 个股选择策略

在个股选择上,本基金将主要投资于以上确定的目标行业内按总市值排名前三分之一的大盘绩优股。

A. 根据上市公司的财务指标、公司管理的规范程度等相关信息对目标行业的上市公司进行筛选,从而形成一级股票池。所选择的财务指标主要为能够反映上市公司盈利能力、增长速度和财务安全性的指标,具体包括:市盈率、市净率、每股收益、净资产收益率、销售毛利率、存货周转率、应收账款周转率、总资产增长率、主营业务收入增长率、主营业务利润增长率、净利润增长率、资产负债率、流动比率、速动比率、已获利息覆盖率等。公司管理的规范程度主要参考最近几年有无重大违法违规事件发生、财务报告有无重大问题、公司管理层是否出现较大变动等方面。

B. 在一级股票池基础上,本基金管理人将结合相关研究报告和实地调研结果,在光大保德信内部定量模型和定性分析体系的支持下,筛选出备选股票,作为二级股票池。

C. 对二级股票池中的股票进行相关性分析,并结合其他的定量分析模型确定出投资组合,在有效分散风险的前提下,为基金份额持有人获取尽可能高的稳健回报。

D. 通过光大保德信股票实时跟踪模型,对投资组合内的目标公司进行实时跟踪,当目标股票价格跌入估值水平以下时发出购买信号。

此外,考虑到一、二级市场的价差带来的套利机会,本基金将在分析新发行股票内在价值的基础上、在基金合同规定的额度内积极参与新股申购,为投资者获取稳定的套利回报。

#### (3) 存托凭证的投资策略

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。

### 3、固定收益类品种投资策略

固定收益类品种的投资追求在严格控制风险基础上获取稳健回报的原则。

(1) 本基金采用利率预期调整方法作为本基金固定收益类证券投资的核心策略。通过宏观经济分析平台把握市场利率水平的运行态势,作为组合久期选择的主要依据;

(2) 根据各子类品种的收益水平和对利率的敏感性等指标确定各子类资产的配置比重;

(3) 在利率预期调整方法基础上,通过分析个券的剩余期限与收益率的配比状况、信用等级状况、流动性指标等因素,选择风险收益配比最合理的个券作为投资对象,并形成组合;

(4) 根据基金申购、赎回等情况,对投资组合进行流动性管理,确保基金资产的变现能力。

基金经理将根据市场的实际情况及基金的申购赎回状况,将部分资产投资于央行票据、债券回购等短期金融工具或保留为现金。同时基金经理将适时的通过回购(逆回购)等资产调控工具,提高基金资产的使用效率。

### 4、权证投资策略

	除了本基金被动持有股权分置改革而发行的权证外,也将根据基金管理人对权证价值的判断,以及各类其它金融衍生品种的投资特性,在进行充分风险控制和遵守中国证监会相关法律法规规定的基础上,适当投资,为基金持有人谋求收益,减少风险。 本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则,根据证券市场实际情况对上述投资策略及投资组合构建流程进行非实质性的调整,此类变更不需经过基金份额持有人大会通过。
业绩比较基准	75%×沪深 300 指数+25%×中证全债指数。
风险收益特征	本基金为主动操作的混合型证券投资基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。本基金力争在科学的风险管理的前提下,谋求实现基金财产的安全和增值。

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王许利	张燕
	联系电话	(021) 80262888	0755-83199084
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4008-202-888	95555
传真		(021) 80262468	0755-83195201
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		200010	518040
法定代表人		刘翔	缪建民

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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、招商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）
本期已实现收益	-55,500,002.57
本期利润	31,109,248.47
加权平均基金份额本期利润	0.0248
本期加权平均净值利润率	2.38%
本期基金份额净值增长率	2.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	152,441,072.86
期末可供分配基金份额利润	0.1268
期末基金资产净值	1,354,951,325.59
期末基金份额净值	1.1268
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	68.38%

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

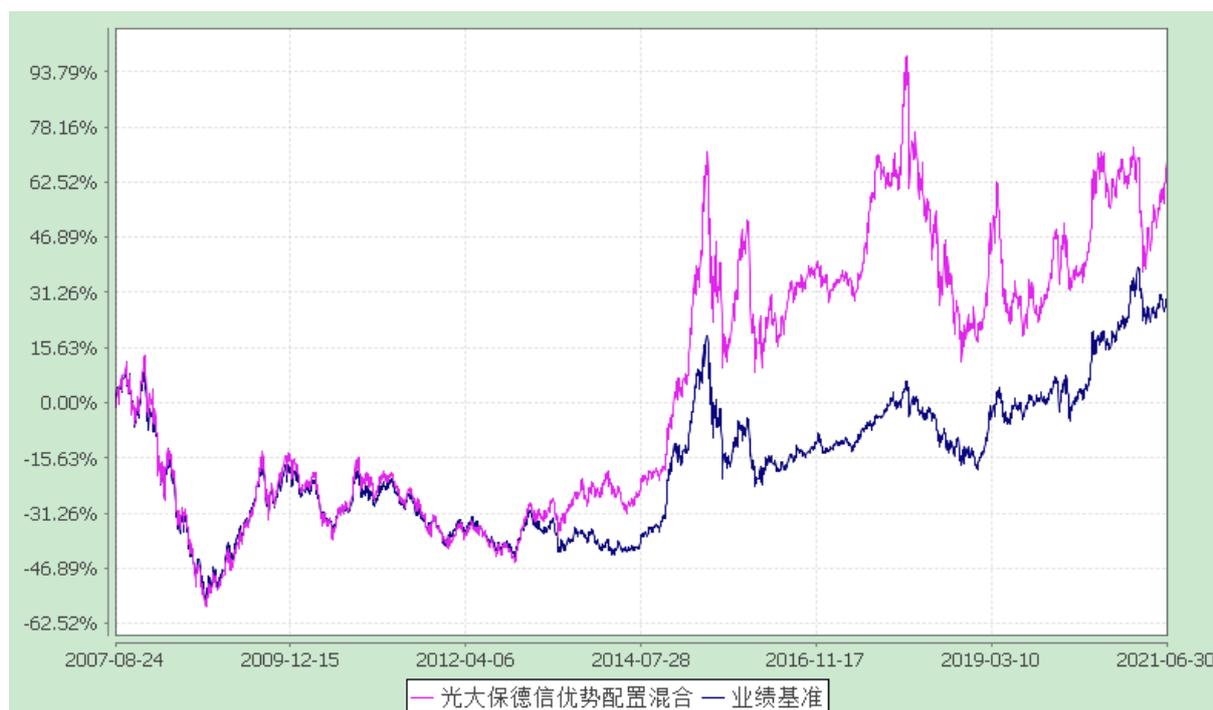
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	6.10%	0.93%	-1.46%	0.60%	7.56%	0.33%
过去三个月	15.13%	1.03%	2.99%	0.73%	12.14%	0.30%
过去六个月	2.37%	1.42%	0.95%	0.99%	1.42%	0.43%
过去一年	13.93%	1.30%	19.87%	1.00%	-5.94%	0.30%
过去三年	22.73%	1.48%	41.50%	1.02%	-18.77%	0.46%
自基金合同生效起至今	68.38%	1.56%	28.65%	1.26%	39.73%	0.30%

注：为更好地反映债券市场整体运行情况和本基金管理人旗下相关基金投资组合的运作情况，经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，自 2014 年 1 月 1 日起，将本基金的业绩比较基准

由原“75%×沪深 300 指数+25%×天相国债全价指数”变更为“75%×沪深 300 指数+25%×中证全债指数”。

### 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

光大保德信优势配置混合型证券投资基金  
 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  
 (2007 年 8 月 24 日至 2021 年 6 月 30 日)



注：1、为更好地反映债券市场整体运行情况和本基金管理人旗下相关基金投资组合的运作情况，经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，自 2014 年 1 月 1 日起，将本基金的业绩比较基准由原“75%×沪深 300 指数+25%×天相国债全价指数”变更为“75%×沪深 300 指数+25%×中证全债指数”。

2、根据基金合同的规定，本基金建仓期为 2007 年 8 月 24 日至 2008 年 2 月 23 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

## 4 管理人报告

### 4.1 基金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		
金昉毅	权益管理总部量化投资团队团队长、基金经理	2021-02-06	-	10 年	金昉毅先生，2002 年毕业于同济大学，2004 年获得德国康斯坦茨大学国际企业经济学硕士学位，2008 年获得德国康斯坦茨大学数量金融学博士学位。2008 年 8 月至 2010 年 12 月在中央财经大学中国金融发展研究院任职助理教授；2011 年 1 月至 2018 年 3 月在申万菱信基金管理有限公司历任量化高级研究员、专户投资经理、量化投资部负责人、基金经理；2018 年 4 月加入光大保德信基金管理有限公司，历任量化投资部负责人，现任权益管理总部量化投资团队团队长，2019 年 5 月至今担任光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信创业板量化优选股票型证券投资基金、光大保德信风格轮动混合型证券投资基金的基金经理，2019 年 5 月至 2020 年 7 月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，2019 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 8 月至 2021 年 8 月担任光大保德信

					产业新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2021 年 2 月至今担任光大保德信优势配置混合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锦弘混合型证券投资基金的基金经理。
戴奇雷	基金经理	2019-11-19	2021-02-06	18 年	戴奇雷先生，1995 年毕业于华中理工大学生物医学工程专业，1998 年获得华中理工大学生物技术专业硕士学位，2002 年获得中欧国际工商学院工商管理专业硕士学位。2002 年 11 月至 2004 年 4 月在上海融昌资产管理有限公司先后担任行业研究员、研究总监助理；2004 年 5 月至 2006 年 5 月在广州金骏资产管理有限公司先后担任研究副总监、研究总监；2006 年 6 月至 2010 年 4 月在诺德基金管理有限公司先后担任行业研究员、基金经理助理、基金经理；2010 年 5 月加入光大保德信基金管理有限公司至今，历任研究副总监、研究总监、权益投资部总监，2016 年 4 月至 2017 年 12 月担任光大保德信红利混合型证券投资基金的基金经理，2013 年 5 月至 2020 年 1 月担任光大保德信中小盘混合型证券投资基金的基金经理，2014 年 7 月至 2021 年 7 月担任光大保德信均衡精选混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 5 月至 2019 年 12 月担任光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2019 年 11 月至 2021 年 2 月担任光大保德信优势配置混合型证券投资基金的基金经理。

注：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。

#### 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

2021 年上半年，市场宽幅震荡。海外疫情的反复与国内的一系列宏观和产业政策交织在一起，不仅仅形成了大盘的波动，也促成了各个板块之间的相对波动，选股难度加大。在此宏观背景下，市场从担忧通胀到担忧通缩，这造成了一季度行情以周期股为主，到了在二季度的反弹中，又以新能源和半导体为代表的新兴产业反弹居前，以消费为主的核心资产反弹稍弱。最终沪深 300 指数在上半年微涨 0.24%。从市场结构来看同时期的中证 500 指数上涨 6.93%，中小盘股票相比大盘蓝筹股表现更佳。

本基金以寻找各产业中的优势龙头企业为主要的选股逻辑，在 2021 年上半年该策略较为有效，基金的收益率战胜了业绩基准。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内份额净值增长率为 2.37%，业绩比较基准收益率为 0.95%。

## 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 2021 年下半年，宏观和货币政策将延续“稳中有进”的基调。从实体经济来看，下半年或许

有趋弱的压力，出口对于经济的拉动也在环比降低。因此政策面以“托”为主，保民生，促改革。在产业政策方面可能有比较大的空间，争取在一些“卡脖子”的环节有所突破。股票市场对于这些改革措施以及融资环境的边际改善都做出了正面的反应，表现出股市结构化特征愈加明显。但另一发面，估值的压力也愈加凸显。高估值的公司受到负面信息和情绪以及基本面的利空影响时股价的下跌相对会更大，这是下半年投资于高估值股票需要关注的。周期板块最好的时刻可能已经过去，但在一些供给受限的行业可能还有机会；消费板块的压力主要来自于公司盈利和持股集中度；科技成长板块无疑是近 2 年以来的市场热点，它的阻力来自于公司的基本面，不断兑现业绩的科技股是自下而上选股的主要逻辑。

总体而言，权益市场仍然处于上升的趋势中。本基金将在中长期具备优势竞争地位的公司中精选出估值合理成长空间大的公司，力争获取超越基准的收益。

#### 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历，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，本基金本报告期内未进行利润分配。

#### **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**

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### **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**

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### **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**

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## 6 中期财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：光大保德信优势配置混合型证券投资基金

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	49,494,488.65	214,677,832.52
结算备付金		5,442,922.24	3,830,166.52
存出保证金		548,161.92	834,058.92
交易性金融资产	6.4.7.2	1,298,580,835.16	1,400,520,334.92
其中：股票投资		1,203,580,331.26	1,309,284,114.02
基金投资		-	-
债券投资		95,000,503.90	91,236,220.90
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	-	84,500,000.00
应收证券清算款		32,775,872.73	-
应收利息	6.4.7.5	1,622,557.03	1,528,897.17
应收股利		-	-
应收申购款		161,435.69	32,418.61
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>1,388,626,273.42</b>	<b>1,705,923,708.66</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 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		-	-
应付证券清算款		24,524,734.62	149,388,178.88
应付赎回款		5,232,801.40	13,537,647.83
应付管理人报酬	6.4.10.2.1	1,605,650.04	1,999,998.71
应付托管费	6.4.10.2.2	267,608.36	333,333.14
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,926,508.50	2,475,515.90
应交税费		1,706.55	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	115,938.36	221,802.38
<b>负债合计</b>		<b>33,674,947.83</b>	<b>167,956,476.84</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	1,202,510,252.73	1,397,270,866.33
未分配利润	6.4.7.10	152,441,072.86	140,696,365.49
<b>所有者权益合计</b>		<b>1,354,951,325.59</b>	<b>1,537,967,231.82</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>1,388,626,273.42</b>	<b>1,705,923,708.66</b>

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1268 元，基金份额总额 1,202,510,252.73 份。

## 6.2 利润表

会计主体：光大保德信优势配置混合型证券投资基金

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 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
<b>一、收入</b>		<b>51,971,504.21</b>	<b>96,827,831.16</b>
1.利息收入		1,931,503.39	3,483,412.66
其中：存款利息收入	6.4.7.11	215,502.38	768,581.07
债券利息收入		1,706,065.68	2,318,871.47
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		9,935.33	395,960.12
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-36,601,453.02	197,705,734.56
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-44,192,368.50	183,497,301.54
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-32,014.42	900,693.87
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	7,622,929.90	13,307,739.15
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	86,609,251.04	-104,649,663.48
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	32,202.80	288,347.42
<b>减：二、费用</b>		<b>20,862,255.74</b>	<b>26,424,009.38</b>

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,782,515.56	13,308,069.11
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,630,419.27	2,218,011.52
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.21	9,312,923.87	10,761,673.20
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		567.24	710.63
7. 其他费用	6.4.7.22	135,829.80	135,544.92
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>31,109,248.47</b>	<b>70,403,821.78</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>31,109,248.47</b>	<b>70,403,821.78</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：光大保德信优势配置混合型证券投资基金

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）	1,397,270,866.33	140,696,365.49	1,537,967,231.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	31,109,248.47	31,109,248.47
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）	-194,760,613.60	-19,364,541.10	-214,125,154.70
其中：1.基金申购款	21,954,547.68	583,804.03	22,538,351.71
2.基金赎回款	-216,715,161.28	-19,948,345.13	-236,663,506.41
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,202,510,252.73	152,441,072.86	1,354,951,325.59
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）	2,138,837,578.75	-108,040,450.16	2,030,797,128.59
二、本期经营活动产生的	-	70,403,821.78	70,403,821.78

基金净值变动数（本期利润）			
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）	-390,051,826.42	18,362,297.71	-371,689,528.71
其中：1.基金申购款	58,223,796.77	-3,238,326.70	54,985,470.07
2.基金赎回款	-448,275,623.19	21,600,624.41	-426,674,998.78
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,748,785,752.33	-19,274,330.67	1,729,511,421.66

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

光大保德信优势配置混合型证券投资基金（原名光大保德信优势配置股票型证券投资基金）（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”）证监基金字[2007]223 号文《关于同意光大保德信优势配置股票型证券投资基金募集的批复》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发行募集，基金合同于 2007 年 8 月 24 日正式生效，首次设立募集规模为 9,905,973,604.86 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据 2014 年 8 月 8 日实行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》，经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，自 2015 年 7 月 17 日起将本基金变更为光大保德信优势配置混合型证券投资基金。

本基金投资范围包括国内依法发行、上市的股票、债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。股票资产占基金资产不少于 60%，最高可达基金资产的 90%，现金或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证不超过基金资产净值的 3%。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。今后在有关法律法规许可时，本基金资产配置比例可作相应调整，股票资产投资比例可达到法律法规有关规定的限

额。

本基金的业绩比较基准为：75%×沪深 300 指数+25%×中债全债指数。

#### 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 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年度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相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 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  
人，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	49,494,488.65
定期存款	-
其他存款	-
合计	49,494,488.65

**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	1,100,201,669.30	1,203,580,331.26	103,378,661.96
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	66,256,080.95	64,949,503.90
	银行间市场	30,015,570.41	30,051,000.00
	合计	96,271,651.36	95,000,503.90
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,196,473,320.66	1,298,580,835.16	102,107,514.50

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

**6.4.7.4 买入返售金融资产**

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

**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	4,974.23
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	2,449.40
应收债券利息	1,614,886.70
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
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	246.70
合计	1,622,557.03

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 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	1,926,508.50
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,926,508.50

#### 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	6,147.39
应付证券出借违约金	-
应付转出费	695.03
预提审计费	49,588.57
预提信息披露费	59,507.37
合计	115,938.36

#### 6.4.7.9 实收基金

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（份）	账面金额
上年度末	1,397,270,866.33	1,397,270,866.33

本期申购	21,954,547.68	21,954,547.68
本期赎回（以“-”号填列）	-216,715,161.28	-216,715,161.28
本期末	1,202,510,252.73	1,202,510,252.73

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

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	785,105,665.86	-644,409,300.37	140,696,365.49
本期利润	-55,500,002.57	86,609,251.04	31,109,248.47
本期基金份额交易产生的变动数	-107,740,344.72	88,375,803.62	-19,364,541.10
其中：基金申购款	11,995,393.08	-11,411,589.05	583,804.03
基金赎回款	-119,735,737.80	99,787,392.67	-19,948,345.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	621,865,318.57	-469,424,245.71	152,441,072.86

#### 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	164,570.69
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	44,924.35
其他	6,007.34
合计	215,502.38

#### 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	3,162,017,379.36
减：卖出股票成本总额	3,206,209,747.86
买卖股票差价收入	-44,192,368.50

#### 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	-32,014.42
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	-32,014.42

##### 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	27,111,766.86
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	26,913,766.18
减：应收利息总额	230,015.10
买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-32,014.42

#### 6.4.7.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末未进行资产支持证券投资。

#### 6.4.7.16 贵金属投资收益

本基金本报告期末未进行贵金属投资。

#### 6.4.7.17 衍生工具收益

本基金本报告期末未进行衍生工具投资。

#### 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	7,622,929.90
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	7,622,929.90

#### 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	86,609,251.04
——股票投资	86,785,772.27
——债券投资	-176,521.23
——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	86,609,251.04

#### 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	31,133.28
基金转换费收入	1,069.52
合计	32,202.80

#### 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	9,312,698.87
银行间市场交易费用	225.00
合计	9,312,923.87

### 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	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	8,133.86
账户维护费	18,000.00
其他费用	600.00
合计	135,829.80

### 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，本基金无需要披露的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影响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
招商银行股份有限公司(简称“招商银行”)	基金托管人、基金代销机构
光大证券股份有限公司(简称“光大证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构

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	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	
	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	1,199,061,775.01	19.45%	209,605,248.67	3.01%

#### 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通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 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	14,098,333.50	58.16%	-	-

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 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	占期末应付佣金总额的比例
光大证券	1,116,684.39	20.05%	340,099.86	17.65%
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	占期末应付佣金总额的比例
光大证券	195,208.77	3.08%	0.00	0.00%

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	9,782,515.56	13,308,069.11
其中：支付销售机构的客户维护费	3,488,553.32	3,363,451.73

注：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：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付,由基金管理人于次月首日起三个工作日内向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人在收到计算结果当日完成复核,并于当日从基金资产中一次性支付给基金管理人。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 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托管费	1,630,419.27	2,218,011.52

注：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：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付,基金管理人应于次月首日起三个工作日内将上月基金托管费的计算结果书面通知基金托管人并作出划付指令,基金托管人复核后于当日从基金资产中一次性支取。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

本基金本报告期以及上年度可比期间未做银行间市场债券(含回购)的关联交易。

### 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自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**

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本基金。

**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		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	49,494,488.65	164,570.69	248,246,999.51	704,067.14

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金在本报告期和上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

**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**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**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**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股流通受限	9.19	40.38	329.00	3,023.51	13,285.02	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-07	新股流通	10.76	22.20	359.00	3,862.84	7,969.80	-

				受限						
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股流通受限	13.39	30.10	217.00	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-20	新股流通受限	13.87	29.55	183.00	2,538.21	5,407.65	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	新股流通受限	13.11	24.48	322.00	4,221.42	7,882.56	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	新股流通受限	4.31	13.11	672.00	2,896.32	8,809.92	-
300932	三友联众	2021-01-15	2021-07-22	新股流通受限	24.69	31.71	492.00	12,147.48	15,601.32	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	新股流通受限	3.37	10.44	1,112.00	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	新股流通受限	12.25	53.71	244.00	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新股流通受限	12.76	43.38	307.00	3,917.32	13,317.66	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	新股流通受限	21.31	49.94	399.00	8,502.69	19,926.06	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股流通受限	5.31	28.52	443.00	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股流通受限	9.79	23.01	255.00	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股流通受限	4.56	18.88	474.00	2,161.44	8,949.12	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股流通受限	8.41	39.13	219.00	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股流通受限	11.72	27.08	340.00	3,984.80	9,207.20	-
300955	震裕	2021-03-03	2021-09-13	新股	28.77	99.85	240.00	6,904.00	23,964.00	-

3	科技	3-11	9-22	流通受限				80	.00	
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股流通受限	16.53	46.07	232.00	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股流通受限	12.85	25.80	371.00	4,767.35	9,571.80	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	新股流通受限	8.53	27.22	300.00	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股流通受限	12.08	23.06	234.00	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股流通受限	8.48	22.07	394.00	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股流通受限	3.40	16.37	576.00	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	新股流通受限	12.13	22.49	283.00	3,432.79	6,364.67	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	新股流通受限	8.24	31.54	286.00	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	新股流通受限	4.54	11.54	507.00	2,301.78	5,850.78	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股流通受限	6.87	12.07	1,162.00	7,982.94	14,025.34	-
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	新股流通受限	18.24	28.29	245.00	4,468.80	6,931.05	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新股流通受限	7.19	12.65	430.00	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股流通受限	28.28	115.71	360.00	10,180.80	41,655.60	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股流通受限	5.48	13.03	492.00	2,696.16	6,410.76	-

300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	新股流通受限	8.42	13.60	593.00	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股流通受限	33.22	87.50	925.00	30,728.50	80,937.50	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新股流通受限	15.83	45.29	317.00	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股流通受限	24.90	24.81	295.00	7,345.50	7,318.95	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股流通受限	14.79	30.57	264.00	3,904.56	8,070.48	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	新股流通受限	13.06	26.51	254.00	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股流通受限	9.36	20.32	200.00	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	新股流通受限	12.10	19.29	410.00	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股流通受限	14.72	23.32	191.00	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股流通受限	20.81	42.23	241.00	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股流通受限	4.94	13.05	928.00	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股流通受限	6.02	21.32	201.00	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股流通受限	18.71	57.62	201.00	3,760.71	11,581.62	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股流通受限	5.29	14.44	303.00	1,602.87	4,375.32	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股流通	7.83	17.61	218.00	1,706.94	3,838.98	-

				受限						
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	新股流通受限	14.20	33.84	175.00	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新股流通受限	8.05	24.26	170.00	1,368.50	4,124.20	-
301013	C利和兴	2021-06-21	2021-12-29	新股流通受限	8.72	27.11	471.00	4,107.12	12,768.81	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新股流通受限	7.64	38.83	462.00	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股流通受限	13.75	32.98	275.00	3,781.25	9,069.50	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	10.64	10.64	3,789.00	40,314.96	40,314.96	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	新股流通受限	10.64	10.64	421.00	4,479.44	4,479.44	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,609.00	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股流通受限	9.46	9.46	290.00	2,743.40	2,743.40	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377.00	8,358.39	8,358.39	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,469.00	54,219.24	54,219.24	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	2,693.00	17,289.06	17,289.06	-
688269	凯立新材	2021-06-01	2021-12-09	新股流通受限	18.94	100.92	1,941.00	36,762.54	195,885.72	-
688316	青云科技	2021-03-05	2021-09-16	新股流通受限	63.70	65.00	1,396.00	88,925.20	90,740.00	-
68861	奥精	2021-0	2021-1	新股	16.43	63.50	2,617.	42,997	166,17	-

3	医疗	5-13	1-22	流通受限			00	.31	9.50	
688621	阳光诺和	2021-06-11	2021-12-21	新股流通受限	26.89	63.99	1,485.00	39,931.65	95,025.15	-
688633	星球石墨	2021-03-17	2021-09-24	新股流通受限	33.62	53.14	1,558.00	52,379.96	82,792.12	-
688662	富信科技	2021-03-25	2021-04-01	新股流通受限	15.61	29.51	2,556.00	39,899.16	75,427.56	-
688681	科汇股份	2021-06-04	2021-12-16	新股流通受限	9.56	14.54	1,899.00	18,154.44	27,611.46	-

注：以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

#### 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

本基金本报告期末未有银行间市场债券正回购，因此无正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未有交易所市场债券正回购，因此无正回购交易中作为抵押的债券。

#### 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。

于本报告期末，本基金持有的除国债、地方政府债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 2.22%(上年末：0.00%)。

#### 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、外汇风险及其他价格风险。

##### 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、结算备付金、存出保证金及债券投资等。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	49,494,488.65	-	-	-	-	-	49,494,488.65
结算备付金	5,442,922.24	-	-	-	-	-	5,442,922.24
存出保证金	548,161.92	-	-	-	-	-	548,161.92
交易性金融资产	30,051,000.00	64,949,503.90	-	-	-	1,203,580,331.26	1,298,580,835.16
应收证券清算款	-	-	-	-	-	32,775,872.73	32,775,872.73
应收利息	-	-	-	-	-	1,622,557.03	1,622,557.03
应收申购款	-	-	-	-	-	161,435.69	161,435.69
资产总计	85,536,572.81	64,949,503.90	-	-	-	1,238,140,196.71	1,388,626,273.42
负债							

应付证券清算款	-	-	-	-	-	24,524,734.62	24,524,734.62
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,232,801.40	5,232,801.40
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,605,650.04	1,605,650.04
应付托管费	-	-	-	-	-	267,608.36	267,608.36
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,926,508.50	1,926,508.50
其他负债	-	-	-	-	-	115,938.36	115,938.36
应交税费	-	-	-	-	-	1,706.55	1,706.55
负债总计	-	-	-	-	-	33,674,947.83	33,674,947.83
利率敏感度缺口	85,536,572.81	64,949,503.90	-	-	-	1,204,465.248.88	1,354,951.325.59
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	214,677,832.52	-	-	-	-	-	214,677,832.52
结算备付金	3,830,166.52	-	-	-	-	-	3,830,166.52
存出保证金	834,058.92	-	-	-	-	-	834,058.92
交易性金融资产	-	-	91,236,220.90	-	-	1,309,284.14.02	1,400,520.334.92
买入返售金融资产	84,500,000.00	-	-	-	-	-	84,500,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	1,528,897.17	1,528,897.17
应收申购款	-	-	-	-	-	32,418.61	32,418.61
资产总计	303,842,057.96	-	91,236,220.90	-	-	1,310,845.429.80	1,705,923.708.66
负债							

应付证券清算款	-	-	-	-	-	149,388,178.88	149,388,178.88
应付赎回款	-	-	-	-	-	13,537,647.83	13,537,647.83
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,999,998.71	1,999,998.71
应付托管费	-	-	-	-	-	333,333.14	333,333.14
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,475,515.90	2,475,515.90
其他负债	-	-	-	-	-	221,802.38	221,802.38
负债总计	-	-	-	-	-	167,956,476.84	167,956,476.84
利率敏感度缺口	303,842,057.96	-	91,236,220.90	-	-	1,142,888,952.96	1,537,967,231.82

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末及上年度末持有的交易性固定收益类投资比例较低，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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	1,203,580,331.26	88.83	1,309,284,114.02	85.13
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	1,203,580,331.26	88.83	1,309,284,114.02	85.13

注：债券投资包含可交换债券，可转换债券。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金未来业绩表现相对业绩基准的波动性与本报告期的整体水平保持一致		
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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 1%	增加约 17,128,103.28	增加约 15,973,374.87
	业绩比较基准下降 1%	减少约 17,128,103.28	减少约 15,973,374.87

注：上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金无需要说明的其他事项。

## 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	1,203,580,331.26	86.67
	其中：股票	1,203,580,331.26	86.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	95,000,503.90	6.84
	其中：债券	95,000,503.90	6.84
	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	-	-
	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	54,937,410.89	3.96
8	其他各项资产	35,108,027.37	2.53
9	合计	1,388,626,273.42	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	11,290.28	0.00
B	采矿业	71,676,579.60	5.29
C	制造业	971,905,228.21	71.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,009,137.51	0.74
E	建筑业	10,418,917.93	0.77
F	批发和零售业	965,124.58	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	54,445,328.78	4.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,153,034.03	1.04
J	金融业	53,630,201.80	3.96
K	房地产业	721,648.00	0.05

L	租赁和商务服务业	7,371,155.00	0.54
M	科学研究和技术服务业	95,025.15	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	35,554.25	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	8,142,106.14	0.60
S	综合	-	-
	合计	1,203,580,331.26	88.83

### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期及上年度可比期间均未投资沪港通股票。

### 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	002415	海康威视	859,492	55,437,234.00	4.09
2	300124	汇川技术	683,282	50,740,521.32	3.74
3	600885	宏发股份	768,809	48,204,324.30	3.56
4	601919	中远海控	1,453,193	44,380,514.22	3.28
5	603486	科沃斯	188,572	43,009,501.76	3.17
6	688016	心脉医疗	92,434	42,021,420.74	3.10
7	600809	山西汾酒	92,544	41,459,712.00	3.06
8	002138	顺络电子	1,067,825	41,399,575.25	3.06
9	601799	星宇股份	181,855	41,048,310.60	3.03
10	002179	中航光电	508,908	40,213,910.16	2.97
11	601166	兴业银行	1,886,154	38,760,464.70	2.86
12	600309	万华化学	351,200	38,217,584.00	2.82
13	300725	药石科技	238,825	37,951,680.75	2.80
14	002080	中材科技	1,393,951	36,479,697.67	2.69
15	002430	杭氧股份	1,041,677	36,031,607.43	2.66
16	002876	三利谱	546,475	35,356,932.50	2.61
17	002078	太阳纸业	2,639,691	35,239,874.85	2.60
18	600315	上海家化	585,888	35,235,304.32	2.60
19	601088	中国神华	1,783,705	34,817,921.60	2.57
20	600426	华鲁恒升	1,111,661	34,405,907.95	2.54
21	600966	博汇纸业	2,609,800	34,057,890.00	2.51

22	600298	安琪酵母	622,600	33,856,988.00	2.50
23	601677	明泰铝业	1,463,589	28,613,164.95	2.11
24	002064	华峰化学	1,972,510	28,009,642.00	2.07
25	600028	中国石化	5,962,800	25,997,808.00	1.92
26	603195	公牛集团	128,044	25,864,888.00	1.91
27	600887	伊利股份	677,900	24,967,057.00	1.84
28	000799	酒鬼酒	79,816	20,400,969.60	1.51
29	600496	精工钢构	4,942,510	20,165,440.80	1.49
30	002139	拓邦股份	842,442	15,155,531.58	1.12
31	600019	宝钢股份	1,922,200	14,685,608.00	1.08
32	002311	海大集团	169,700	13,847,520.00	1.02
33	300379	东方通	400,486	11,409,846.14	0.84
34	601898	中煤能源	1,519,000	10,860,850.00	0.80
35	601668	中国建筑	2,237,540	10,404,561.00	0.77
36	600377	宁沪高速	1,031,231	10,064,814.56	0.74
37	600900	长江电力	484,308	9,996,117.12	0.74
38	601939	建设银行	1,453,400	9,665,110.00	0.71
39	601100	恒立液压	111,749	9,601,474.08	0.71
40	601928	凤凰传媒	1,140,351	8,142,106.14	0.60
41	601888	中国中免	20,000	6,002,000.00	0.44
42	601636	旗滨集团	278,500	5,168,960.00	0.38
43	000001	平安银行	151,300	3,422,406.00	0.25
44	603260	合盛硅业	36,200	2,784,142.00	0.21
45	688369	致远互联	40,600	2,594,340.00	0.19
46	002027	分众传媒	145,500	1,369,155.00	0.10
47	601658	邮储银行	230,000	1,154,600.00	0.09
48	603337	杰克股份	36,000	962,280.00	0.07
49	000026	飞亚达	66,000	918,720.00	0.07
50	000961	中南建设	121,900	721,648.00	0.05
51	601328	交通银行	121,000	592,900.00	0.04
52	688269	凯立新材	1,941	195,885.72	0.01
53	688613	奥精医疗	2,617	166,179.50	0.01
54	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
55	688621	阳光诺和	1,485	95,025.15	0.01
56	688316	青云科技	1,396	90,740.00	0.01
57	688633	星球石墨	1,558	82,792.12	0.01
58	300979	华利集团	925	80,937.50	0.01
59	688662	富信科技	2,556	75,427.56	0.01
60	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
61	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
62	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
63	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
64	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
65	688681	科汇股份	1,899	27,611.46	0.00

66	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
67	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
68	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
69	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
70	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
71	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
72	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
73	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
74	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
75	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
76	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
77	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
78	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
79	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
80	301013	C利和兴	471	12,768.81	0.00
81	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
82	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
83	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
84	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
85	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
86	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
87	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
88	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
89	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
90	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
91	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
92	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
93	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
94	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
95	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
96	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
97	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
98	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
99	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
100	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
101	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
102	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
103	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
104	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
105	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
106	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
107	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
108	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
109	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00

110	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
111	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
112	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
113	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
114	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
115	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
116	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
117	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
118	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
119	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
120	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
121	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
122	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

## 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	300124	汇川技术	76,188,175.90	4.95
2	600315	上海家化	66,478,972.24	4.32
3	300274	阳光电源	66,007,174.51	4.29
4	600885	宏发股份	62,027,216.69	4.03
5	601166	兴业银行	59,532,051.28	3.87
6	603259	药明康德	57,514,919.38	3.74
7	002415	海康威视	55,212,389.46	3.59
8	601601	中国太保	52,684,513.39	3.43
9	601919	中远海控	52,271,444.68	3.40
10	002179	中航光电	51,342,318.41	3.34
11	601888	中国中免	49,499,249.00	3.22
12	002568	百润股份	46,681,082.77	3.04
13	601100	恒立液压	45,347,783.37	2.95
14	002064	华峰化学	45,273,377.90	2.94
15	000661	长春高新	44,436,307.87	2.89
16	002078	太阳纸业	43,924,505.70	2.86
17	603288	海天味业	43,710,408.40	2.84
18	002138	顺络电子	42,606,014.33	2.77
19	603345	安井食品	42,497,940.46	2.76
20	601088	中国神华	42,015,319.05	2.73
21	603486	科沃斯	41,215,475.60	2.68
22	603416	信捷电气	40,493,091.62	2.63

23	002027	分众传媒	40,453,388.60	2.63
24	600809	山西汾酒	39,609,045.11	2.58
25	600966	博汇纸业	39,469,270.00	2.57
26	600298	安琪酵母	39,296,203.93	2.56
27	300101	振芯科技	39,263,190.12	2.55
28	603806	福斯特	39,094,232.00	2.54
29	000733	振华科技	38,986,341.82	2.53
30	603833	欧派家居	38,616,161.85	2.51
31	603712	七一二	38,508,776.78	2.50
32	300496	中科创达	38,375,648.65	2.50
33	601689	拓普集团	37,575,039.41	2.44
34	300593	新雷能	37,031,663.00	2.41
35	002508	老板电器	36,973,938.77	2.40
36	600426	华鲁恒升	36,401,641.15	2.37
37	002430	杭氧股份	36,090,146.18	2.35
38	002841	视源股份	35,684,610.43	2.32
39	002876	三利谱	35,499,590.73	2.31
40	600887	伊利股份	35,465,001.00	2.31
41	300725	药石科技	35,354,955.18	2.30
42	601799	星宇股份	34,951,095.24	2.27
43	002013	中航机电	34,839,399.52	2.27
44	300413	芒果超媒	34,415,830.56	2.24
45	688016	心脉医疗	34,407,671.38	2.24
46	002080	中材科技	34,399,215.72	2.24
47	002050	三花智控	33,651,561.17	2.19
48	002714	牧原股份	33,060,847.80	2.15
49	002271	东方雨虹	32,722,798.96	2.13

#### 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	002001	新和成	104,416,638.63	6.79
2	600104	上汽集团	101,343,749.28	6.59
3	601166	兴业银行	99,480,887.96	6.47
4	601088	中国神华	98,056,126.26	6.38
5	601318	中国平安	91,757,875.54	5.97
6	600547	山东黄金	85,124,405.11	5.53
7	600309	万华化学	79,778,501.41	5.19
8	002064	华峰化学	74,240,746.90	4.83
9	601668	中国建筑	73,125,504.38	4.75
10	600048	保利地产	72,857,196.59	4.74

11	600406	国电南瑞	61,357,126.40	3.99
12	601919	中远海控	58,304,238.05	3.79
13	601899	紫金矿业	54,483,153.60	3.54
14	300274	阳光电源	53,239,234.24	3.46
15	603259	药明康德	49,980,757.64	3.25
16	300593	新雷能	47,530,539.60	3.09
17	601601	中国太保	47,301,601.53	3.08
18	000538	云南白药	46,446,402.50	3.02
19	002568	百润股份	43,868,634.44	2.85
20	600315	上海家化	43,117,647.00	2.80
21	600900	长江电力	42,750,623.19	2.78
22	000661	长春高新	42,267,409.61	2.75
23	002714	牧原股份	41,281,042.39	2.68
24	002508	老板电器	39,261,226.57	2.55
25	603833	欧派家居	37,960,021.58	2.47
26	601888	中国中免	37,814,329.88	2.46
27	603288	海天味业	37,521,535.44	2.44
28	603345	安井食品	37,264,539.22	2.42
29	300413	芒果超媒	36,927,689.42	2.40
30	300496	中科创达	35,422,318.41	2.30
31	002271	东方雨虹	34,884,606.80	2.27
32	603712	七一二	34,879,849.16	2.27
33	002841	视源股份	34,455,809.00	2.24
34	603806	福斯特	34,436,045.42	2.24
35	002027	分众传媒	33,913,557.93	2.21
36	300695	兆丰股份	33,031,927.74	2.15
37	300676	华大基因	32,931,535.00	2.14
38	000733	振华科技	32,710,558.14	2.13
39	300101	振芯科技	31,778,295.73	2.07
40	601689	拓普集团	31,537,246.43	2.05
41	002050	三花智控	31,470,473.06	2.05

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	3,013,720,192.83
卖出股票的收入（成交）总额	3,162,017,379.36

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	43,615,056.00	3.22
2	央行票据	-	-
3	金融债券	21,334,447.90	1.57
	其中：政策性金融债	21,334,447.90	1.57
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	30,051,000.00	2.22
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	95,000,503.90	7.01

#### 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	010107	21 国债(7)	435,280	43,615,056.00	3.22
2	012100810	21 中石化 SCP002	300,000	30,051,000.00	2.22
3	108604	国开 1805	212,770	21,334,447.90	1.57

#### 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投资股指期货。

**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**

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

**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。

**7.12 本报告期投资基金情况****7.12.1 投资政策及风险说明**

本基金本报告期末未持有基金。

**7.12.2 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 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 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。

**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	548,161.92
2	应收证券清算款	32,775,872.73
3	应收股利	-
4	应收利息	1,622,557.03
5	应收申购款	161,435.69

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,108,027.37

#### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 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。

### 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

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
91,686	13,115.53	4,424,106.90	0.37%	1,198,086,145.83	99.63%

#### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	173,526.64	0.01%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金的基金经理均未持有本基金的份额。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007 年 8 月 24 日）基金份额总额	9,905,973,604.86
本报告期期初基金份额总额	1,397,270,866.33
本报告期基金总申购份额	21,954,547.68
减：本报告期基金总赎回份额	216,715,161.28
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,202,510,252.73

## 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，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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

本基金在本报告期内的投资策略未发生改变。

### 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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		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	
海通证券	1	304,711.34	0.00%	283.79	0.01%	-
中金公司	1	394,650.26	0.01%	359.65	0.01%	-
兴业证券	1	40,366,129.05	0.65%	37,592.07	0.67%	-
招商证券	1	139,933,381.69	2.27%	130,321.80	2.34%	-
华泰证券	3	140,773,454.26	2.28%	128,286.97	2.30%	-
国泰君安	1	244,504,196.76	3.97%	222,817.90	4.00%	-
天风证券	2	283,701,858.95	4.60%	145,057.57	2.60%	-
国金证券	2	305,022,272.76	4.95%	280,837.99	5.04%	-
东方证券	2	370,936,259.74	6.02%	338,035.21	6.07%	-
中信建投证券	2	698,596,902.36	11.33%	639,093.81	11.47%	-
申万宏源	1	1,128,659,484.56	18.31%	1,028,550.62	18.46%	-
光大证券	1	1,199,061,775.01	19.45%	1,116,684.39	20.05%	-
国信证券	1	1,613,558,516.93	26.17%	1,502,695.80	26.98%	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中信证券华南	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
方正证券已退租	2	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：（1）报告期内租用证券公司交易单元变更情况

本报告期内本基金未新增租用证券交易单元。

本报告期内本基金未撤销租用证券交易单元。

（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情况稳定；

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
海通证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	1,257,907.00	5.19%	-	-	-	-
光大证券	14,098,333.5	58.16%	-	-	-	-

	0					
国信证券	8,883,754.00	36.65%	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中信证券华南	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
方正证券已退租	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

### 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	光大保德信优势配置混合型证券投资基金 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	光大保德信优势配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	同上	2021-02-06
6	光大保德信优势配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	同上	2021-02-09
7	光大保德信优势配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)	同上	2021-02-09
8	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
9	光大保德信优势配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	同上	2021-03-25
10	光大保德信优势配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)	同上	2021-03-25

11	光大保德信优势配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告	同上	2021-03-31
12	光大保德信优势配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	同上	2021-04-22

## 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优势配置混合型证券投资基金设立的文件
- 2、光大保德信优势配置混合型证券投资基金基金合同
- 3、光大保德信优势配置混合型证券投资基金招募说明书
- 4、光大保德信优势配置混合型证券投资基金托管协议
- 5、光大保德信优势配置混合型证券投资基金法律意见书
- 6、光大保德信优势配置混合型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

### 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。公司网址：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