

光大保德信消费主题股票型证券投资基金

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：中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生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

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
2 基金简介	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.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	9
4 管理人报告	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.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	14
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
5 托管人报告	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
6 中期财务会计报告（未经审计）	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
7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	51
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.....	51
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.....	51
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 投资组合报告附注.....	51
8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	53
9 开放式基金份额变动	54
10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	54
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
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	54
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.9 其他重大事件	56
11 影响投资者决策的其他重要信息	56
12 备查文件目录	57
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	光大保德信消费主题股票型证券投资基金
基金简称	光大保德信消费股票
基金主代码	008234
交易代码	008234
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 4 月 23 日
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	170,773,984.92 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将在充分控制风险的前提下，通过把握消费主题股票的投资机会，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将通过分析宏观经济基本面及证券市场双层面的数据进行研究，并通过定性定量分析、风险测算及组合优化，最终形成大类资产配置决策。具体包括以下几个方面：</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基金管理人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、股票投资策略</p> <p>（1）消费主题的界定</p> <p>本基金所界定的消费主题股票主要包括：</p> <p>1）申万一级行业分类中的食品饮料、家用电器、纺织服装、商业贸易、农林牧渔、医药生物、轻工制造、休闲服务、传媒、汽车等行业的上市公司；</p> <p>2）港交所一级行业分类中的消费品制造业、消费者服务业等行业的上市公司；</p> <p>本基金将对消费主题相关行业及上市公司进行密切跟踪，随着经济增长及产业转型的进一步发展变化，消费行业的外延将可能会不断扩大，相关上市公司的范围也会相应改变。在履行适当必要的程序后，本基金将根据实际情况调整消费主题的界定标准。</p> <p>（2）个股选择策略</p> <p>本基金将通过自下而上研究入库的方式，对以上各个行业中涉及消费主题</p>

的上市公司进行深入研究，挖掘企业的投资价值，并将这些股票组成本基金的核心股票库。在核心股票库的基础上，本基金以定性和定量相结合的方式、从价值和成长等因素对个股进行选择，综合考虑上市公司的增长潜力与市场估值水平，精选估值合理且成长性良好的上市公司进行投资。具体包括以下几个方面：

1) 定量分析

本基金结合盈利增长指标、现金流量指标、负债比率指标、估值指标、盈利质量指标等与上市公司经营有关的重要定量指标，对目标上市公司的价值进行深入挖掘，并对上市公司的盈利能力、财务质量和经营效率进行评析，为个股选择提供依据。

2) 定性分析

本基金认为股票价格的合理区间并非完全由其财务数据决定，还必须结合企业学习与创新能力、企业发展战略、技术专利优势、市场拓展能力、公司治理结构和管理水平、公司的行业地位、公司增长的可持续性 etc 等定性因素，给予股票一定的折溢价水平，并最终决定股票合理的价格区间。根据上述定性定量分析的结果，本基金进一步从价值和成长两个纬度对备选股票进行评估。对于价值被低估且成长性良好的股票，本基金将重点关注；对于价值被高估但成长性良好，或价值被低估但成长性较差的股票，本基金将通过深入的调研和缜密的分析，有选择地进行投资；对于价值被高估且成长性较差的股票，本基金不予考虑投资。

(3) 港股通标的股票投资策略

本基金将通过上述自下而上研究入库的个股投资策略，着重考察并优选香港联合交易所上市的股票中消费主题相关的投资标的，力求对 A 股市场投资进行有效补充。本基金将仅通过港股通投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者 (QDII) 境外投资额度进行境外投资。

(4) 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、债券投资策略

本基金密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率变动走势，自上而下地确定投资组合久期，并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合，配置能够提供稳定收益的债券品种。

4、证券公司短期公司债券投资策略

本基金将通过证券行业分析、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。

5、资产支持证券投资策略

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。

6、衍生品投资策略

为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货、股票期权等金融衍生品。本基金利用金融衍生

	<p>品合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，提高投资组合的运作效率。</p> <p>本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其理估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。</p> <p>本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，参与股票期权的投资。本基金将在有效控制风险的前提下，选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资。本基金将基于对证券市场的预判，并结合股票期权定价模型，选择估值合理的期权合约。基金管理人将根据审慎原则，建立股票期权交易决策部门或小组，按照有关要求做好人员培训工作，确保投资、风控等核心岗位人员具备股票期权业务知识和相应的专业能力，同时授权特定的管理人员负责股票期权的投资审批事项，以防范期权投资的风险。</p> <p>7、其他品种投资策略</p> <p>法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，本基金若认为有助于基金进行风险管理和组合优化的，可依据法律法规的规定履行适当程序后，运用金融衍生产品进行投资风险管理。</p>
业绩比较基准	中证内地消费主题指数收益率×80%+中证全债指数收益率×10%+中证港股通主要消费综合指数收益率×5%+中证港股通可选消费综合指数收益率×5%。
风险收益特征	<p>本基金为股票型基金，其预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。</p> <p>本基金还可投资港股通标的股票。除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

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	中国民生银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王许利	罗菲菲
	联系电话	(021) 80262888	010-58560666
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		4008-202-888	95568
传真		(021) 80262468	010-58560798
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	北京市西城区复兴门内大街2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	北京市西城区复兴门内大街2号
邮政编码		200010	100031

法定代表人	刘翔	高迎欣
-------	----	-----

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、中国民生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	54,638,748.88
本期利润	-718,825.28
加权平均基金份额本期利润	-0.0035
本期加权平均净值利润率	-0.22%
本期基金份额净值增长率	-2.24%
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	101,390,202.69
期末可供分配基金份额利润	0.5937
期末基金资产净值	272,164,187.61
期末基金份额净值	1.5937
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	59.37%

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	-1.21%	0.72%	-3.83%	0.81%	2.62%	-0.09%
过去三个月	5.06%	1.04%	2.02%	1.13%	3.04%	-0.09%
过去六个月	-2.24%	1.66%	-2.97%	1.59%	0.73%	0.07%
过去一年	45.60%	1.58%	36.73%	1.46%	8.87%	0.12%
自基金合同生效起至今	59.37%	1.48%	53.80%	1.39%	5.57%	0.09%

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

光大保德信消费主题股票型证券投资基金

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

(2020年4月23日至2021年6月30日)



注：根据基金合同的规定，本基金建仓期为 2020 年 4 月 23 日至 2020 年 10 月 22 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		
马鹏飞	基金经理	2020-04-24	-	9 年	马鹏飞先生，浙江大学食品科学专业硕士。曾任浙江康恩贝健康产品有限公司研发工程师和项目经理，浙江核新同花顺网络信息股份有限公司项目经理；2012 年 1 月至 2013 年 11 月在浙江同花顺投资咨询有限公司担任行业研究员；2013 年 12 月至 2017 年 5 月在财通证券股份有限公司担任行业研究员；2017 年 5 月加入光大保德信基金管理有限公司，担任高级研究员。2020 年 4 月至今担任光大保德信消费主题股票型证券投资基金的基金经理，2020 年 6 月至 2021 年 8 月担任光大保德信瑞和混合型证券投资基金的基金经理。
魏晓雪	权益管理总部股票研究团队团队长、基金经理	2020-04-23	-	14 年	魏晓雪女士毕业于浙江大学金融学专业，2015 年获得复旦大学金融学的硕士学位。2006 年至 2009 年在鹏远（北京）管理咨询有限公司上海分公司（原凯基管理咨询）担任研究员；2009 年 10 月加入光大保德信基金管理有限公司，担任高级研究员，现任总经理助理、权益管理总部权益投资团队基金经理、股票研究团队团队长，2012

				<p>年 11 月至 2014 年 2 月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，2013 年 2 月至今担任光大保德信新增长混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 5 月至 2017 年 1 月担任光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金的基金经理，2020 年 3 月至今担任光大保德信研究精选混合型证券投资基金的基金经理，2020 年 4 月至 2021 年 7 月担任光大保德信消费主题股票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中国制造 2025 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智能汽车主题股票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新机遇混合型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	---

注：1、对基金的首任基金经理，其任职日期按基金合同生效日填写，离任日期为公司决定确定的解聘日期；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、魏晓雪女士由于公司安排，于 2021 年 7 月 17 日离任，由马鹏飞先生继续担任本基金基金经理。

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

2021 年上半年，国内经济延续复苏态势，运行稳中加固，但疫情的反复也对消费复苏带来了波动。上半年我国社会消费品零售总额 21.2 万亿，同比增长 23%，较 2019 年 1-6 月份增长复合增长 4.19%，其中 Q1 两年复合增长 3.72%，Q2 增长 4.64%。其中商品零售额上半年同比增长 20.6%，与 2019 年同期相比两年复合增长 4.57%，Q2 增长 4.94%，比 Q1 加快 0.7 个百分点。服务消费方面，餐饮收入仍受疫情反复的影响尚未完全恢复，上半年同比增长 48.6%，而与 2019 年同期相比两年复合仅增长 1%，其中 Q2 两年复合增长 2.23%，增速比 Q1 加快 2.5 个百分点。分品类来看，食品、饮料、日用品、化妆品等消费频次较高的品类增速较快，今年上半年两年复合增速分别为 11.7%、19.5%、13.7%、12.4%；而从边际上看，家电、家具、建材等地产后周期累计增速较一季度增速提升明显。

回顾上半年，以创业板指为代表的成长风格上涨 17.22%，以沪深 300、上证 50 为代表的大市值权重指数分别上涨 0.24%、-3.90%，上证指数和深证成指分别上涨 3.40%、4.78%。中证内地消费指数上涨 -4.26%，按照申万行业各细分消费赛道的表现看，汽车板块、纺织服装、休闲服务、轻工涨幅居前，分别上涨 8.76%、8.76%、5.51%、5.03%。家电、农林牧渔、食品饮料涨幅居后，分别上涨 -12.10%、-9.97%、0.34%。

上半年消费板块整体呈现出了大幅波动的态势，年初受永煤债带来的流动性以及新发基金等因素影响，板块整体快速拉升，估值大幅上行。春节后受美债收益率上行等因素影响，估值承压大幅调整，进入二季度，分子端景气度维度消费不占优叠加去年基数因素，整体表现弱势。回顾上半年的市场，消费行情有过极致也有过平淡，有过分母端的流动性催化，也有过分子端的业绩相对平庸。作为消费主题基金，春节前的行情有所斩获。节后市场回调中，持仓结构虽有调整，但变化不够明显，净值也有明显回落。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内净值增长率为-2.24%，业绩比较基准收益率为-2.97%，

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，我认为调整后的消费值得战略性配置，一方面估值已经回落，消费的核心资产的性价比已经开始显现。另一方面消费对经济社会的重要性开始愈发凸显。短期可能会有板块横向景气度比较的偏好带来资金的外流，但改革的持续推进，支出结构的加速调整有望带来可支配收入的提升，从而促使“消费-创新-消费升级-再创新”的内循环回路的形成，可以说消费新时代就要来临，注定会来临！疫情的扰动对消费数据会有影响，但一次次的考验之后，坚信我们总会有办法去平衡疫情防控和经济发展。

消费主题基金整体维持高仓位运作，结构方面会平衡行业景气度、业绩预期、估值以及品牌影响力进行平衡配置。

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

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：光大保德信消费主题股票型证券投资基金

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
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	1,084,175.86	6,312,976.00
结算备付金		692,097.47	953,433.19
存出保证金		226,934.96	425,924.24
交易性金融资产	6.4.7.2	257,686,575.18	516,317,927.06
其中：股票投资		243,505,575.18	490,275,597.06
基金投资		-	-
债券投资		14,181,000.00	26,042,330.00
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	12,500,000.00	-
应收证券清算款		13,650,843.75	27,259,801.29
应收利息	6.4.7.5	137,240.62	626,061.60
应收股利		76,725.61	-
应收申购款		175,691.43	448,514.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		286,230,284.88	552,344,638.16
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		11,789,018.92	2.84
应付赎回款		1,451,713.32	30,313,298.56
应付管理人报酬		344,411.92	642,021.36
应付托管费		57,402.00	107,003.56
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.6	210,548.60	1,680,843.18
应交税费		-	0.74

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	213,002.51	162,377.82
负债合计		14,066,097.27	32,905,548.06
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	170,773,984.92	318,641,566.20
未分配利润	6.4.7.10	101,390,202.69	200,797,523.90
所有者权益合计		272,164,187.61	519,439,090.10
负债和所有者权益总计		286,230,284.88	552,344,638.16

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5937 元，基金份额总额 170,773,984.92 份。

6.2 利润表

会计主体：光大保德信消费主题股票型证券投资基金

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 4 月 23 日（基 金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		4,083,742.38	92,922,564.24
1.利息收入		305,526.20	1,745,616.71
其中：存款利息收入	6.4.7.11	35,457.55	338,440.01
债券利息收入		237,802.79	371,227.80
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		32,265.86	1,035,948.90
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		57,665,634.43	44,333,549.27
其中：股票投资收益	6.4.7.12	56,438,889.11	37,253,838.25
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-197,956.40	-172,064.11
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	1,424,701.72	7,251,775.13
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-55,357,574.16	44,511,145.60
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	1,470,155.91	2,332,252.66
减：二、费用		4,802,567.66	5,500,679.90

1. 管理人报酬		2,479,273.85	2,944,113.77
2. 托管费		413,212.39	490,685.65
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.21	1,807,327.35	2,020,380.72
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		0.13	0.13
7. 其他费用	6.4.7.22	102,753.94	45,499.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-718,825.28	87,421,884.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-718,825.28	87,421,884.34

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：光大保德信消费主题股票型证券投资基金

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）	318,641,566.20	200,797,523.90	519,439,090.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-718,825.28	-718,825.28
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）	-147,867,581.28	-98,688,495.93	-246,556,077.21
其中：1.基金申购款	89,886,868.51	61,082,248.91	150,969,117.42
2.基金赎回款	-237,754,449.79	-159,770,744.84	-397,525,194.63
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）	170,773,984.92	101,390,202.69	272,164,187.61
项目	上年度可比期间 2020 年 4 月 23 日（基金合同生效日）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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的	-	87,421,884.34	87,421,884.34

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）	617,860,523.10	-28,966,945.01	588,893,578.09
其中：1.基金申购款	1,208,220,997.71	820,259.39	1,209,041,257.10
2.基金赎回款	-590,360,474.61	-29,787,204.40	-620,147,679.01
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）	617,860,523.10	58,454,939.33	676,315,462.43

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

光大保德信消费主题股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2019]2127 号《关于准予光大保德信消费主题股票型证券投资基金注册的批复》核准，由光大保德信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《光大保德信消费主题股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,191,261,534.02 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 0271 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《光大保德信消费主题股票型证券投资基金基金合同》于 2020 年 4 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,191,461,813.75 份，其中认购资金利息折合 200,279.73 份基金份额。本基金的基金管理人为光大保德信基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《光大保德信消费主题股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市的股票(含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准/注册上市的股票)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、金融债、公司债、证券公司短期公司债券、企业债、地方政府债、次级债、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、

中期票据、央行票据及其他经中国证监会允许投资的债券)、货币市场工具、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%；其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%；投资于本基金界定的消费主题范围内股票不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%。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。本基金的业绩比较基准为：中证内地消费主题指数收益率×80%+中证全债指数收益率×10%+中证港股通主要消费综合指数收益率×5%+中证港股通可选消费综合指数收益率×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《光大保德信消费主题股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%

的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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	1,084,175.86
定期存款	-
其他存款	-
合计	1,084,175.86

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	212,864,936.54	243,505,575.18	30,640,638.64

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	4,217,114.87	4,214,000.00	-3,114.87
	银行间市场	9,961,440.00	9,967,000.00	5,560.00
	合计	14,178,554.87	14,181,000.00	2,445.13
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		227,043,491.41	257,686,575.18	30,643,083.77

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

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	12,500,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	12,500,000.00	-

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	481.94
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	311.50
应收债券利息	134,617.40
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	1,727.68
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	102.10
合计	137,240.62

注：其他应收利息为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 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	210,223.60
银行间市场应付交易费用	325.00
合计	210,548.60

6.4.7.7 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	3,742.36
应付证券出借违约金	-
预提审计费	99,752.78
预提信息披露费	109,507.37
合计	213,002.51

6.4.7.8 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	318,641,566.20	318,641,566.20
本期申购	89,886,868.51	89,886,868.51
本期赎回（以“-”号填列）	-237,754,449.79	-237,754,449.79
本期末	170,773,984.92	170,773,984.92

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 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	155,991,636.81	44,805,887.09	200,797,523.90

本期利润	54,638,748.88	-55,357,574.16	-718,825.28
本期基金份额交易产生的变动数	-84,782,159.67	-13,906,336.26	-98,688,495.93
其中：基金申购款	50,776,882.35	10,305,366.56	61,082,248.91
基金赎回款	-135,559,042.02	-24,211,702.82	-159,770,744.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	125,848,226.02	-24,458,023.33	101,390,202.69

6.4.7.10 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	21,180.68
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	10,941.02
其他	3,335.85
合计	35,457.55

6.4.7.11 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	704,869,202.86
减：卖出股票成本总额	648,430,313.75
买卖股票差价收入	56,438,889.11

6.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 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	-197,956.40
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	-197,956.40

6.4.7.13.2 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	37,721,392.18
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	37,011,896.45
减：应收利息总额	907,452.13
买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-197,956.40

6.4.7.14 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。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.17 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	1,424,701.72
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	1,424,701.72

6.4.7.18 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	-55,357,574.16
——股票投资	-55,569,442.11
——债券投资	211,867.95
——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	-55,357,574.16

6.4.7.19 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	1,461,564.49
转换费收入	8,591.42
合计	1,470,155.91

6.4.7.20 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	1,807,002.35
银行间市场交易费用	325.00
合计	1,807,327.35

6.4.7.21 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	29,752.78

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	4,493.79
帐户维护费	9,000.00
合计	102,753.94

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

截至资产负债表日，本基金无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
中国民生银行股份有限公司（简称“民生银行”）	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4月23日（基金合同生效日） 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	504,577,955.16	43.69%	869,392,248.53	56.06%
------	----------------	--------	----------------	--------

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期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4月23日（基金合同生效日） 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	368,647.22	1.24%	-	-

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。

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	460,056.33	49.45%	99,107.70	47.14%
关联方名称	上年度可比期间 2020年4月23日（基金合同生效日）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	792,278.11	59.14%	792,278.11	59.14%

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4月23日(基金合同生 效日)至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,479,273.85	2,944,113.77
其中: 支付销售机构的客户维护费	1,055,488.45	1,915,048.34

注: 支付基金管理人光大保德信基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付。其计算公式为:

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

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4月23日(基金合同生 效日)至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	413,212.39	490,685.65

注: 支付基金托管人中国民生银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付。其计算公式为:

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付的销售服务费。

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均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

份额单位: 份

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4月23日(基金合同生效日)至 2020年6月30日
基金合同生效日 (2020年4月23日) 持有的基金份额	-	10,004,850.00
期初持有的基金份 额	10,004,850.00	-
期间申购/买入总份 额	0.00	-
期间因拆分变动份 额	0.00	-

额		
减：期间赎回/卖出总 份额	0.00	-
期末持有的基金份 额	10,004,850.00	10,004,850.00
期末持有的基金份 额 占基金总份额比例	5.86%	1.62%

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年4月23日（基金合同生效 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
民生银行	1,084,175.86	21,180.68	11,077,585.71	255,985.86

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。

6.4.11 利润分配情况

本基金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	-
30092	博俊	2020-1	2021-0	新股	10.76	22.20	359.00	3,862.	7,969.	-

6	科技	2-29	7-07	流通受限				84	80	
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	-

300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新股流通受限	28.77	99.85	240.00	6,904.80	23,964.00	-
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	255.00	7,211.40	29,506.05	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股流通	5.48	13.03	492.00	2,696.16	6,410.76	-

				受限						
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	361.00	11,992.42	31,587.50	-
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	-
301011	晶雪	2021-0	2021-1	新股	7.83	17.61	218.00	1,706.	3,838.	-

0	节能	6-09	2-20	流通受限				94	98	
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	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	2022-01-06	新股流通受限	10.64	10.64	421.00	4,479.44	4,479.44	-
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	-
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	-
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	-
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	-
688079	美迪凯	2021-02-23	2021-09-02	新股流通受限	10.19	18.40	10,622.00	108,238.18	195,444.80	-
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	-
688276	百克生物	2021-06-17	2021-12-27	新股流通受限	36.35	79.48	1,930.00	70,155.50	153,396.40	-

68834 5	博力威	2021-0 6-03	2021-1 2-13	新股 流通 受限	25.91	55.53	2,332. 00	60,422 .12	129,49 5.96	-
68860 7	康众 医疗	2021-0 1-25	2021-0 8-02	新股 流通 受限	23.21	44.50	1,890. 00	43,866 .90	84,105 .00	-
68861 3	奥精 医疗	2021-0 5-13	2021-1 1-22	新股 流通 受限	16.43	63.50	2,617. 00	42,997 .31	166,17 9.50	-
68862 8	优利 德	2021-0 1-22	2021-0 8-02	新股 流通 受限	19.11	32.62	2,789. 00	53,297 .79	90,977 .18	-
68866 0	电气 风电	2021-0 5-11	2021-1 1-19	新股 流通 受限	5.44	7.26	16,772 .00	91,239 .68	121,76 4.72	-
68866 7	菱电 电控	2021-0 3-03	2021-0 9-13	新股 流通 受限	75.42	103.88	1,135. 00	85,601 .70	117,90 3.80	-

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。

于本报告期末，本基金持有的除国债、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 0.00%(上年末：0.06%)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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%。于本报告期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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。于本报告期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期末流动性情况良好。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、清算备付金、存出保证金、债券投资、买入返售证券。

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	1,084,175.86	-	-	-	-	-	1,084,175.86
结算备付金	692,097.47	-	-	-	-	-	692,097.47
存出保证金	226,934.96	-	-	-	-	-	226,934.96
交易性金融资产	4,214,000.00	-	9,967,000.00	-	-	243,505,575.18	257,686,575.18
买入返售金融资产	12,500,000.00	-	-	-	-	-	12,500,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	13,650,843.75	13,650,843.75
应收股利	-	-	-	-	-	76,725.61	76,725.61
应收利息	-	-	-	-	-	137,240.62	137,240.62
应收申购款	-	-	-	-	-	175,691.43	175,691.43
资产总计	18,717,208.29	-	9,967,000.00	-	-	257,546,076.59	286,230,284.88
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	11,789,018.92	11,789,018.92
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,451,713.32	1,451,713.32
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	344,411.92	344,411.92
应付托管费	-	-	-	-	-	57,402.00	57,402.00
应付交易费用	-	-	-	-	-	210,548.60	210,548.60
其他负债	-	-	-	-	-	213,002.51	213,002.51
负债总计	-	-	-	-	-	14,066,097.27	14,066,097.27
利率敏感度缺口	18,717,208.29	-	9,967,000.00	-	-	243,479,979.32	272,164,187.61
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	6,312,976.00	-	-	-	-	-	6,312,976.00
结算备付金	953,433.19	-	-	-	-	-	953,433.19
存出保证金	425,924.24	-	-	-	-	-	425,924.24

交易性金融资产	15,698,430.00	-	10,049,000.00	-	294,900.00	490,275,597.06	516,317,927.06
应收证券清算款	-	-	-	-	-	27,259,801.29	27,259,801.29
应收利息	-	-	-	-	-	626,061.60	626,061.60
应收申购款	-	-	-	-	-	448,514.78	448,514.78
资产总计	23,390,763.43	-	10,049,000.00	-	294,900.00	518,609,974.73	552,344,638.16
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	30,313,298.56	30,313,298.56
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	642,021.36	642,021.36
应付托管费	-	-	-	-	-	107,003.56	107,003.56
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,680,843.18	1,680,843.18
其他负债	-	-	-	-	-	162,377.82	162,377.82
应交税费	-	-	-	-	-	0.74	0.74
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2.84	2.84
负债总计	-	-	-	-	-	32,905,548.06	32,905,548.06
利率敏感度缺口	23,390,763.43	-	10,049,000.00	-	294,900.00	485,704,426.67	519,439,090.10

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

于本报告期末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 5.21%(上年末：5.01%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年末：同)。

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	上年度末 2020年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	57,471,387.40	57,471,387.40
应收证券清算款	-	6,873,197.83	6,873,197.83
资产合计	-	64,344,585.23	64,344,585.23
以外币计价的负债			
应付证券清算款	-	2.84	2.84
负债合计	-	2.84	2.84
资产负债表 外汇风险敞 口净额	-	64,344,582.39	64,344,582.39

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除港币汇率以外的其他市场变量保持不变。		
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
	港币相对人民币升值 1%	增加约 513,581.27	增加约 643,445.82
	港币相对人民币贬值 1%	减少约 513,581.27	减少约 643,445.82

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他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，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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	243,505,575.18	89.47	490,275,597.06	94.39
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	294,900.00	0.06
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	243,505,575.18	89.47	490,570,497.0	94.44

			6	
--	--	--	---	--

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变。		
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 2,786,117.81	增加约 5,083,822.31
	业绩比较基准下降 1%	减少约 2,786,117.81	减少约 5,083,822.31

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	243,505,575.18	85.07
	其中：股票	243,505,575.18	85.07
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	14,181,000.00	4.95
	其中：债券	14,181,000.00	4.95
	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	12,500,000.00	4.37
	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	1,776,273.33	0.62
8	其他各项资产	14,267,436.37	4.98
9	合计	286,230,284.88	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为人民币 52,380,787.30 元，占期末净值比例 19.25%。

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	8,885,596.39	3.26
B	采矿业	-	-
C	制造业	168,512,800.35	61.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	14,356.93	0.01
F	批发和零售业	46,404.58	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	1,435,140.00	0.53
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,333.89	0.02
J	金融业	34,721.10	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,762,960.00	1.75
M	科学研究和技术服务业	1,278,720.00	0.47
N	水利、环境和公共设施管理业	35,554.25	0.01
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	6,063,180.00	2.23
S	综合	-	-
	合计	191,124,787.88	70.22

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
日常消费	22,099,212.72	8.12
医疗保健	9,459,085.44	3.48
可选消费	20,822,489.14	7.65
合计	52,380,787.30	19.25

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	000858	五粮液	71,306.00	21,241,344.34	7.80
2	600519	贵州茅台	10,300.00	21,184,010.00	7.78
3	H00291	华润啤酒	300,000.00	17,411,274.00	6.40
4	002594	比亚迪	51,500.00	12,926,500.00	4.75
5	H02333	长城汽车	520,000.00	10,860,308.16	3.99
6	000333	美的集团	140,000.00	9,991,800.00	3.67
7	600690	海尔智家	380,000.00	9,845,800.00	3.62
8	000596	古井贡酒	36,824.00	8,819,348.00	3.24
9	000651	格力电器	160,059.00	8,339,073.90	3.06
10	H01691	J S 环球生活	440,000.00	7,999,617.12	2.94
11	601966	玲珑轮胎	180,000.00	7,873,200.00	2.89
12	300616	尚品宅配	70,000.00	6,195,700.00	2.28
13	H01066	威高股份	400,000.00	6,030,915.84	2.22
14	600887	伊利股份	160,000.00	5,892,800.00	2.17
15	H02319	蒙牛乳业	120,000.00	4,687,938.72	1.72
16	600132	重庆啤酒	23,400.00	4,632,030.00	1.70
17	002714	牧原股份	70,000.00	4,257,400.00	1.56
18	603288	海天味业	33,000.00	4,255,350.00	1.56
19	600600	青岛啤酒	36,600.00	4,232,790.00	1.56
20	002304	洋河股份	19,300.00	3,998,960.00	1.47
21	000625	长安汽车	148,700.00	3,907,836.00	1.44
22	688169	石头科技	3,000.00	3,783,000.00	1.39
23	S01302	先健科技	800,000.00	3,428,169.60	1.26
24	603317	天味食品	104,418.00	3,073,021.74	1.13
25	002461	珠江啤酒	269,100.00	2,943,954.00	1.08
26	601888	中国中免	9,600.00	2,880,960.00	1.06
27	300144	宋城演艺	153,800.00	2,583,840.00	0.95
28	603517	绝味食品	30,000.00	2,528,700.00	0.93
29	002458	益生股份	232,663.00	2,319,650.11	0.85
30	002299	圣农发展	96,200.00	2,297,256.00	0.84
31	603180	金牌厨柜	45,260.00	2,158,449.40	0.79
32	002508	老板电器	46,000.00	2,139,000.00	0.79
33	300829	金丹科技	32,440.00	2,124,820.00	0.78
34	H01999	敏华控股	126,400.00	1,962,563.86	0.72
35	002311	海大集团	23,100.00	1,884,960.00	0.69
36	002027	分众传媒	200,000.00	1,882,000.00	0.69
37	300413	芒果超媒	25,400.00	1,742,440.00	0.64
38	002739	万达电影	110,000.00	1,736,900.00	0.64

39	600737	中粮糖业	164,800.00	1,649,648.00	0.61
40	601238	广汽集团	123,400.00	1,598,030.00	0.59
41	002847	盐津铺子	15,900.00	1,585,548.00	0.58
42	600963	岳阳林纸	145,200.00	1,534,764.00	0.56
43	600298	安琪酵母	28,000.00	1,522,640.00	0.56
44	600754	锦江酒店	25,200.00	1,435,140.00	0.53
45	603833	欧派家居	10,000.00	1,419,600.00	0.52
46	300577	开润股份	62,700.00	1,343,661.00	0.49
47	601965	中国汽研	74,000.00	1,278,720.00	0.47
48	300979	华利集团	9,061.00	1,022,517.50	0.38
49	002481	双塔食品	78,400.00	906,304.00	0.33
50	688079	美迪凯	10,622.00	195,444.80	0.07
51	688613	奥精医疗	2,617.00	166,179.50	0.06
52	688161	威高骨科	1,547.00	164,059.35	0.06
53	688276	百克生物	1,930.00	153,396.40	0.06
54	688345	博力威	2,332.00	129,495.96	0.05
55	688660	电气风电	16,772.00	121,764.72	0.04
56	688667	菱电电控	1,135.00	117,903.80	0.04
57	688628	优利德	2,789.00	90,977.18	0.03
58	300919	中伟股份	534.00	87,042.00	0.03
59	688607	康众医疗	1,890.00	84,105.00	0.03
60	300985	致远新能	2,945.00	83,877.45	0.03
61	688087	英科再生	2,469.00	54,219.24	0.02
62	301020	密封科技	4,210.00	44,794.40	0.02
63	300894	火星人	628.00	42,704.00	0.02
64	601528	瑞丰银行	2,230.00	34,721.10	0.01
65	300973	立高食品	255.00	29,506.05	0.01
66	301021	英诺激光	2,899.00	27,424.54	0.01
67	300953	震裕科技	240.00	23,964.00	0.01
68	001207	联科科技	682.00	22,581.02	0.01
69	300941	创识科技	399.00	19,926.06	0.01
70	301015	百洋医药	462.00	17,939.46	0.01
71	688226	威腾电气	2,693.00	17,289.06	0.01
72	300932	三友联众	492.00	15,601.32	0.01
73	300982	苏文电能	317.00	14,356.93	0.01
74	300968	格林精密	1,162.00	14,025.34	0.01
75	001208	华菱线缆	1,754.00	13,558.42	0.00
76	300940	南极光	307.00	13,317.66	0.00
77	300614	百川畅银	329.00	13,285.02	0.00
78	300937	药易购	244.00	13,105.24	0.00
79	301013	利和兴	471.00	12,768.81	0.00
80	300942	易瑞生物	443.00	12,634.36	0.00
81	603171	税友股份	637.00	12,230.40	0.00
82	300997	欢乐家	928.00	12,110.40	0.00

83	300933	中辰股份	1,112.00	11,609.28	0.00
84	301002	崧盛股份	201.00	11,581.62	0.00
85	300955	嘉亨家化	232.00	10,688.24	0.00
86	300996	普联软件	241.00	10,177.43	0.00
87	300956	英力股份	371.00	9,571.80	0.00
88	300962	中金辐照	576.00	9,429.12	0.00
89	300952	恒辉安防	340.00	9,207.20	0.00
90	301016	雷尔伟	275.00	9,069.50	0.00
91	300966	共同药业	286.00	9,020.44	0.00
92	300945	曼卡龙	474.00	8,949.12	0.00
93	300931	通用电梯	672.00	8,809.92	0.00
94	300961	深水海纳	394.00	8,695.58	0.00
95	300950	德固特	219.00	8,569.47	0.00
96	605162	新中港	1,377.00	8,358.39	0.00
97	300958	建工修复	300.00	8,166.00	0.00
98	300986	志特新材	264.00	8,070.48	0.00
99	300978	东箭科技	593.00	8,064.80	0.00
100	300926	博俊科技	359.00	7,969.80	0.00
101	300993	玉马遮阳	410.00	7,908.90	0.00
102	300930	屹通新材	322.00	7,882.56	0.00
103	300971	博亚精工	245.00	6,931.05	0.00
104	300991	创益通	254.00	6,733.54	0.00
105	300927	江天化学	217.00	6,531.70	0.00
106	300975	商络电子	492.00	6,410.76	0.00
107	300963	中洲特材	283.00	6,364.67	0.00
108	301011	华立科技	175.00	5,922.00	0.00
109	300943	春晖智控	255.00	5,867.55	0.00
110	300967	晓鸣股份	507.00	5,850.78	0.00
111	300972	万辰生物	430.00	5,439.50	0.00
112	300929	华骐环保	183.00	5,407.65	0.00
113	300960	通业科技	234.00	5,396.04	0.00
114	605011	杭州热电	525.00	4,662.00	0.00
115	300995	奇德新材	191.00	4,454.12	0.00
116	301007	德迈仕	303.00	4,375.32	0.00
117	300998	宁波方正	201.00	4,285.32	0.00
118	301012	扬电科技	170.00	4,124.20	0.00
119	300992	泰福泵业	200.00	4,064.00	0.00
120	301010	晶雪节能	218.00	3,838.98	0.00
121	605189	富春染织	23.00	554.07	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	002714	牧原股份	20,544,109.16	3.96
2	603369	今世缘	19,774,492.06	3.81
3	002594	比亚迪	14,478,497.92	2.79
4	000333	美的集团	13,030,032.93	2.51
5	002299	圣农发展	11,875,352.54	2.29
6	000596	古井贡酒	11,723,065.00	2.26
7	600779	水井坊	11,371,274.32	2.19
8	600887	伊利股份	10,980,986.51	2.11
9	600809	山西汾酒	10,436,610.00	2.01
10	600600	青岛啤酒	9,981,991.04	1.92
11	002304	洋河股份	9,973,451.00	1.92
12	000100	TCL 科技	9,894,546.00	1.90
13	300829	金丹科技	9,476,307.00	1.82
14	06862	海底捞	9,011,996.27	1.73
15	603317	天味食品	8,872,485.79	1.71
16	01691	J S 环球生活	8,655,064.67	1.67
17	603517	绝味食品	8,056,748.71	1.55
18	603313	梦百合	6,990,277.00	1.35
19	300894	火星人	6,905,270.44	1.33
20	01066	威高股份	6,588,305.45	1.27

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	603369	今世缘	42,426,989.62	8.17
2	000333	美的集团	33,008,637.83	6.35
3	000651	格力电器	29,270,697.60	5.64
4	600690	海尔智家	24,659,107.17	4.75
5	600519	贵州茅台	22,591,550.00	4.35
6	002714	牧原股份	21,551,694.05	4.15
7	000858	五粮液	19,781,739.00	3.81
8	000729	燕京啤酒	19,266,295.41	3.71
9	002594	比亚迪	16,872,718.84	3.25
10	601966	玲珑轮胎	16,404,135.10	3.16
11	600600	青岛啤酒	15,823,622.46	3.05
12	000568	泸州老窖	15,717,795.75	3.03
13	603317	天味食品	14,145,083.55	2.72
14	600779	水井坊	13,828,538.90	2.66

15	603288	海天味业	12,723,491.56	2.45
16	300298	三诺生物	12,329,876.56	2.37
17	300829	金丹科技	12,103,822.96	2.33
18	600741	华域汽车	11,165,564.20	2.15
19	02238	广汽集团	10,816,461.95	2.08
20	002100	天康生物	10,506,913.93	2.02

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	457,229,733.98
卖出股票的收入（成交）总额	704,869,202.86

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	4,214,000.00	1.55
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,967,000.00	3.66
	其中：政策性金融债	9,967,000.00	3.66
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	14,181,000.00	5.21

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	200302	20 进出 02	100,000	9,967,000.00	3.66
2	019640	20 国债 10	42,140	4,214,000.00	1.55

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

本基金将在风险可控的前提下，以套期保值为目的，根据对现货和期货市场的分析，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。

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。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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.118 国开 08 (180208.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。

7.12.2 本基金未投资超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 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	226,934.96
2	应收证券清算款	13,650,843.75
3	应收股利	76,725.61
4	应收利息	137,240.62
5	应收申购款	175,691.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	14,267,436.37

7.12.4 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。

7.12.5 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
5,147	33,179.32	10,009,790.71	5.86%	160,764,194.21	94.14%

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	687,226.92	0.40%

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	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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 4 月 23 日）基金份额总额	1,191,461,813.75
本报告期期初基金份额总额	318,641,566.20
本报告期基金总申购份额	89,886,868.51
减：本报告期基金总赎回份额	237,754,449.79
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	170,773,984.92

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	
东方证券	1	85,946,800.16	7.44%	68,757.41	7.39%	-
光大证券	1	504,577,955.16	43.69%	460,056.33	49.45%	-
中信建投证券	2	564,383,679.08	48.87%	401,445.72	43.15%	-

注：（1）报告期内租用证券公司交易单元变更情况：

报告期内未新增租用证券公司交易单元，停止租用交易单元：中泰证券（38659、399028）。

（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
东方证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	368,647.22	1.24%	-	-	-	-
中信建投证券	29,422,609.50	98.76%	256,200,000.00	100.00%	-	-

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	光大保德信消费主题股票型证券投资基金 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	光大保德信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	同上	2021-02-26
6	光大保德信消费主题股票型证券投资基金 2020 年年度报告	同上	2021-03-31
7	光大保德信消费主题股票型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	同上	2021-04-22
8	光大保德信消费主题股票型证券投资基金基金产品资料概要更新	同上	2021-05-21
9	光大保德信消费主题股票型证券投资基金招募说明书（更新）	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消费主题股票型证券投资基金设立的文件
- 2、光大保德信消费主题股票型证券投资基金基金合同
- 3、光大保德信消费主题股票型证券投资基金招募说明书
- 4、光大保德信消费主题股票型证券投资基金托管协议
- 5、光大保德信消费主题股票型证券投资基金法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 8、报告期内光大保德信消费主题股票型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告
- 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。

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。

光大保德信基金管理有限公司

二〇二一年八月三十一日