

光大保德信量化核心证券投资基金
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：中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大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	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	14
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	15
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	16
5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	16
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	16
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	16
6 中期财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	20
7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
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	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	52
9 开放式基金份额变动	52
10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
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	55
11 影响投资者决策的其他重要信息	56
12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
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	光大保德信量化核心证券投资基金
基金简称	光大保德信量化股票
基金主代码	360001
交易代码	360001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 8 月 27 日
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,631,118,789.67 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金追求长期持续稳定超出业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金借鉴了外方股东保德信投资的量化投资管理理念和长期经验，结合中国市场现行特点加以改进，形成光大保德信独特的量化投资策略；正常市场情况下不作主动资产配置，采用自下而上与自上而下相结合的方式选择股票；并通过投资组合优化器构建并动态优化投资组合，确保投资组合风险收益特征符合既定目标。 本基金在正常市场情况下不作主动资产配置，股票及存托凭证资产的基准比例为基金资产净值的 90%，浮动范围为 85—95%；现金的基准比例为基金资产净值的 10%，浮动范围为 5—15%。 本基金建仓时间为 6 个月，基金在合同生效后 6 个月内达到上述比例限制。针对开放式基金申购/赎回的异常流动性需求，资产配置可不受上述比例限制，但基金管理人将在合理期限内调整投资组合，使基金资产配置比例恢复至正常市场情况下的水平，上述合理期限指 10 个交易日，法律法规另有规定时，从其规定。 本基金通过光大保德信特有的以量化投资为核心的多重优化保障体系构建处于或接近有效边际曲线的投资组合。该体系在构建投资组合时综合考量收益因素及风险因素，一方面通过光大保德信独特的多因素数量模型对所有股票的预期收益率进行估算，个股预期收益率的高低直接决定投资组合是否持有该股票；另一方面投资团队从风险控制的角度出发，重点关注数据以外的信息，通过行业分析和个股分析对多因素数量模型形成有效补充，由此形成的行业评级和个股评级将决定行业及个股权重相对业绩基准的偏离范围；然后由投资组合优化器通过一定的量化技术综合考虑个股预期收益率，行业评级和个股评级等参数，根据预先设定的风险目标构建投资组合，并对投资组合进行动态持续优化，使投资组合风险收益特征符合既定目标；最后由交易员根据具体投资方案进行交易。 1. 多因素数量模型的运用 本基金借鉴保德信投资的量化投资管理经验，根据中国市场运行特征从股票估值，成长趋势及数据质量三方面选取对 A 股股价波动具有较强解释度

的共同指标作为多因素数量模型的参数，通过一定的量化技术估算出共同指标的收益贡献率，并按一定权重加总得出个股预期收益率，作为投资组合构建的重要依据。估值类指标主要判断股票价格是否正确反映了公司基本面状况；趋势类指标说明股票现有估值是否能够持续；质量类指标判断是否存在暗示现行基本面趋势可能逆转的警戒信号。同时数量小组还将根据市场变化趋势定期或不定期地对模型参数及相关系数进行复核，并做相应调整以确保参数的有效性。

2. 行业评级

行业评级首先根据行业特性的不同对行业进行划分，我们将行业划分为周期性行业，防御性行业及增长性行业，并根据行业动向和实际发展状况对行业划分进行动态调整；在此基础上通过行业景气定位图对行业的周期性变化特征进行分析，并判断每个行业目前所处的景气阶段；然后通过树状集群行业评价体系对行业进行系统性评价；最终确定行业评级及行业权重相对业绩基准的偏离范围，为投资组合优化提供行业层面的决策建议。

3. 个股评级

研究团队采用定量分析与定性分析相结合的股票评估模型对上市公司进行综合评级，为投资组合优化提供个股层面的决策建议。研究团队着重关注上市公司数据可靠性及消息面对股价的潜在影响，从财务评分模型及公司质量评分模型两方面着手对公司基本面进行全面系统的分析和判断，得出股票综合评级，并根据股票评级确定投资组合中单个股票相对业绩基准的偏离范围。

4. 投资组合优化器的运用

投资组合优化器以风险收益配比原则为核心，通过一定的量化技术综合考虑个股预期收益率，行业评级和个股评级等参数，对投资组合进行前瞻性的风险配置，根据预先设定的风险目标构建符合参数设置并处于有效边际曲线上的投资组合，即一定风险水平下收益最高的投资组合。投资组合优化器还通过量化模型预测投资组合整体风险程度，对投资组合进行动态持续优化。如果由于股价波动等因素造成事前跟踪误差超出我们预先设定的风险区域，投资团队将在优化器中根据风险归因分析对边际风险贡献率最大的股票进行调整，以降低事前跟踪误差，使投资组合所承担的风险程度符合既定目标，并使风险尽量集中分布在投资团队对该风险因素的把握具有高置信度的区域。

5. 权证的投资

(1) 权证的投资策略

在控制投资风险和保障基金财产安全的前提下，本公司对权证进行积极主动投资，获取较高的投资组合收益水平。权证投资策略主要包括以下几个方面：

- A. 本公司主要采用 Black-Scholes 定价公式和二叉树模型对权证进行定价，并根据市场实际情况，调整权证定价模型及其参数，得到权证的理论价值，作为权证投资的价值基准。
- B. 权证价格的对于决定其风险因素的敏感度，本基金通过风险参数的形式进行衡量。
- C. 本基金通过权证与证券的组合投资，进行基金财产的止损保护。
- D. 本基金通过采取现金套利（Cash extraction）策略，兑现投资收益，保留未来获利空间。

	E. 同时,本基金还将采用二叉树模型对美式权证以及各类复杂型权证进行理论定价。 F. 基金经理通过对理论价格和隐含波动率的合理性分析,基于对证券价格的未来表现和预期波动率变化的分析判断,主动投资于价值被市场低估的权证品种。 (2) 权证的投资决策流程 A. 权证的投资研究过程 研究人员对于基础股票进行深入的调研和分析,并将结果通过量化模型,对股票进行估值;数量分析小组负责构建和维护权证定价模型,在股票估值的基础上,对于权证的价值进行分析。投资组合委员会在研究分析的基础上,结合基金的实际确定投资策略。风险分析小组则通过独立的系统,对权证的风险进行测算,在各种可能的情景下,对权证进行估价,从而确定权证的投资风险,为投资组合委员会的投资策略确定提供参考。 B. 权证的投资决策过程 a. 权证投资方案的制定 投资组合委员会在研究人员和数量分析人员的工作基础上,结合基金的实际确定投资方案。 b. 权证投资的授权和审批 凡单个品种累计投资额度不超过基金资产净值的 5% (暂定) 的权证投资,可由基金经理自主执行,并向投资总监备案。 凡单个品种累计投资额度超过基金资产净值的 5% (暂定) 的权证投资,由投资组合委员会向公司投资决策委员会申请审批。投资方案得到批准后,由基金经理在授权的范围内实施。 c. 投资计划调整 投资组合委员会根据市场变化、投资计划的实施情况和执行效果、投资分析报告(包括投资表现评估报告、风险分析报告)等,进一步分析判断,并据此进行调整。如果遇有重大变化需要修改投资方案,须按相应程序批准后方可实施。
业绩比较基准	90%×沪深 300 指数+10%×同业存款利率。
风险收益特征	本基金为股票型基金,其预期收益和风险高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。按照风险收益配比原则对投资组合进行严格的风险管理,在风险限制范围内追求收益最大化。

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	中国光大银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王许利	石立平
	联系电话	(021) 80262888	010-63639180
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		4008-202-888	95595
传真		(021) 80262468	010-63639132
注册地址		上海市黄浦区中山东二路558	北京市西城区太平桥大街25

	号外滩金融中心1幢，6层	号、甲25号中国光大中心
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	北京市西城区太平桥大街25号 中国光大中心
邮政编码	200010	100033
法定代表人	刘翔	李晓鹏

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、中国光大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	374,557,471.29
本期利润	222,743,423.86
加权平均基金份额本期利润	0.1262
本期加权平均净值利润率	8.44%
本期基金份额净值增长率	7.68%
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	1,561,787,603.93
期末可供分配基金份额利润	0.9575
期末基金资产净值	2,537,216,488.71
期末基金份额净值	1.5555
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	591.08%

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	2.71%	0.84%	-1.81%	0.72%	4.52%	0.12%
过去三个月	9.19%	0.92%	3.16%	0.88%	6.03%	0.04%
过去六个月	7.68%	1.40%	0.33%	1.18%	7.35%	0.22%
过去一年	32.70%	1.34%	22.93%	1.20%	9.77%	0.14%
过去三年	68.29%	1.29%	44.13%	1.23%	24.16%	0.06%
自基金合同生效起至今	591.08%	1.63%	307.69%	1.50%	283.39%	0.13%

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，经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致，自 2014 年 4 月 1 日起，将本基金的业绩比较基准由原“90%×富时中国 A200 指数+10%×同业存款利率”变更为“90%×沪深 300 指数+10%×同业存款利率”。

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

光大保德信量化核心证券投资基金

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

(2004 年 8 月 27 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，经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致，自 2014 年 4 月 1 日起，将本基金的业绩比较基准由原“90%×富时中国 A200 指数+10%×同业存款利率”变更为“90%×沪深 300 指数+10%×同业存款利率”。

2、根据基金合同的规定，本基金建仓期为 2004 年 8 月 27 日至 2005 年 2 月 26 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		
翟云飞	基金经理	2016-12-09	-	11 年	翟云飞先生，2005 年毕业于中国科学技术大学自动化系，2010 年获得中国科学技术大学统计与金融系博士学位。2010 年 6 月至 2014 年 3 月在大成基金管理有限公司任职，其中 2010 年 6 月至 2011 年 5 月任职金融工程师(负责量化投资研究)，2011 年 5 月至 2012 年 7 月任职产品设计师，2012 年 7 月至 2014 年 3 月任职量化投资研究员、行业投资研究员；2014 年 4 月加入光大保德信基金管理有限公司，历任金融工程师(负责量化投资研究)、高级量化研究员，现任权益管理总部量化投资团队基金经理，2016 年 2 月至今担任光大保德信风格轮动混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至今担任光大保德信量化核心证券投资基金的基金经理，2017 年 1 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，2018 年 2 月至今担任光大保德信创业板量化优选股票型证券投资基金的基金经理，2019 年 6 月至今担任光大保德信诚鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2019 年 7 月至今担任光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2019 年 8 月至 2020 年 8 月担任光大保德信永鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
金昉毅	权益管理总部 量化投资团队 团队长、基金 经理	2019-05-11	-	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。
--	--	--	--	--	--

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。

本基金采用的量化投资策略主要选择在沪深 300 指数的成分股中寻找流动性佳、盈利能力强且估值低的股票。在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 7.68%，业绩比较基准收益率为 0.33%。

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。总体来看，本基金将继续保持主要在沪深 300 指数成分股中选股，寻找估值较

低且盈利能持续的股票，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、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，对需采用特别估值程序的证券，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议定特别估值方案并与托管行、审计师沟通后形成建议，经公司管理层批准后由运营部具体执行。估值委员会向公司管理层提交推荐建议前，应审慎平衡托管行、审计师和基金同业的意见，并必须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；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

中国光大银行股份有限公司在光大保德信量化核心证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定,依法安全托管了基金的全部资产,对光大保德信量化核心证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督,对发现的问题及时提出了意见和建议。按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告,没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为,诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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,中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定,对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督,未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求,各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人——光大保德信基金管理有限公司编制的《光大保德信量化核心证券投资基金 2021 年中期报告》进行了复核,认为报告中相关财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等内容真实、准确。

6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：光大保德信量化核心证券投资基金

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	208,177,889.15	218,912,139.32
结算备付金		12,353,463.01	14,893,597.26
存出保证金		640,648.68	950,473.63
交易性金融资产	6.4.7.2	2,318,352,754.72	2,786,074,270.83
其中：股票投资		2,318,352,754.72	2,786,074,270.83
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
应收证券清算款		9,335,175.00	5,953,824.92
应收利息	6.4.7.5	44,053.04	56,402.76
应收股利		-	-
应收申购款		87,560.37	116,449.02
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,548,991,543.97	3,026,957,157.74
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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	32,672,686.17
应付赎回款		4,061,395.95	8,581,322.44
应付管理人报酬		3,058,025.84	3,674,089.13
应付托管费		509,670.97	612,348.20
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,035,843.14	5,881,338.70
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	110,119.36	222,271.25
负债合计		11,775,055.26	51,644,055.89
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	596,893,237.11	753,719,397.17
未分配利润	6.4.7.10	1,940,323,251.60	2,221,593,704.68
所有者权益合计		2,537,216,488.71	2,975,313,101.85
负债和所有者权益总计		2,548,991,543.97	3,026,957,157.74

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5555 元，基金份额总额 1,631,118,789.67 份。

6.2 利润表

会计主体：光大保德信量化核心证券投资基金

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
一、收入		264,482,163.18	440,383,041.41
1.利息收入		982,514.51	1,212,963.60
其中：存款利息收入	6.4.7.11	982,514.51	1,212,963.60
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		414,917,038.64	302,780,953.87
其中：股票投资收益	6.4.7.12	395,611,719.12	275,232,734.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	19,305,319.52	27,548,218.95
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-151,814,047.43	136,050,557.72
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	396,657.46	338,566.22
减：二、费用		41,738,739.32	46,874,021.65

1. 管理人报酬	6.4.10.2	19,725,358.83	26,514,836.70
2. 托管费	6.4.10.2	3,287,559.78	4,419,139.44
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	18,616,724.77	15,830,647.13
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.21	109,095.94	109,398.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		222,743,423.86	393,509,019.76
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		222,743,423.86	393,509,019.76

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：光大保德信量化核心证券投资基金

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）	753,719,397.17	2,221,593,704.68	2,975,313,101.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	222,743,423.86	222,743,423.86
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）	-156,826,160.06	-504,013,876.94	-660,840,037.00
其中：1.基金申购款	23,607,736.29	71,909,674.35	95,517,410.64
2.基金赎回款	-180,433,896.35	-575,923,551.29	-756,357,447.64
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）	596,893,237.11	1,940,323,251.60	2,537,216,488.71
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,153,931,842.44	2,275,388,362.41	3,429,320,204.85
二、本期经营活动产生的	-	393,509,019.76	393,509,019.76

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）	-32,110,539.94	-91,357,214.14	-123,467,754.08
其中：1.基金申购款	153,686,349.90	281,242,052.27	434,928,402.17
2.基金赎回款	-185,796,889.84	-372,599,266.41	-558,396,156.25
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）	-	-105,910,972.62	-105,910,972.62
五、期末所有者权益（基金净值）	1,121,821,302.50	2,471,629,195.41	3,593,450,497.91

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

光大保德信量化核心证券投资基金（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[2004]85 号文《关于同意光大保德信量化核心证券投资基金设立的批复》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 2004 年 8 月 27 日正式生效，首次设立募集规模为 2,544,287,215.94 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和注册登记机构为光大保德信基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括在国内依法公开发行上市的股票、法律法规及证监会允许基金投资的其他金融工具。其中股票投资对象重点为基本面良好且具有持续增长潜力，股价处于合理区间的优质股票。本基金在正常市场情况下不作主动资产配置，股票资产的基准比例为基金资产净值的 90%，浮动范围为 85-95%；现金的基准比例为基金资产净值的 10%，浮动范围为 5-15%。本基金的业绩比较基准为 90%×沪深 300 指数+10%×同业存款利率。

2007 年 5 月 8 日，本基金管理人光大保德信基金管理有限公司对本基金进行了基金份额拆分。拆分后基金份额面值为人民币 0.3618 元。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年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	208,177,889.15
定期存款	-
其他存款	-
合计	208,177,889.15

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		2,155,194,363.74	2,318,352,754.72	163,158,390.98
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,155,194,363.74	2,318,352,754.72	163,158,390.98

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有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	38,790.38
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	5,003.19
应收债券利息	-
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	259.47
合计	44,053.04

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

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	4,035,843.14
银行间市场应付交易费用	-
合计	4,035,843.14

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	1,023.42
应付证券出借违约金	-
预提审计费	49,588.57
预提信息披露费	59,507.37
合计	110,119.36

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	2,059,675,847.46	753,719,397.17
本期申购	64,510,611.03	23,607,736.29
本期赎回（以“-”号填列）	-493,067,668.82	-180,433,896.35
本期末	1,631,118,789.67	596,893,237.11

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	1,571,970,451.96	649,623,252.72	2,221,593,704.68
本期利润	374,557,471.29	-151,814,047.43	222,743,423.86
本期基金份额交易产生的变动数	-384,740,319.32	-119,273,557.62	-504,013,876.94
其中：基金申购款	52,124,009.93	19,785,664.42	71,909,674.35
基金赎回款	-436,864,329.25	-139,059,222.04	-575,923,551.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,561,787,603.93	378,535,647.67	1,940,323,251.60

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	898,258.94
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	78,472.25
其他	5,783.32
合计	982,514.51

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	6,588,249,585.32
减：卖出股票成本总额	6,192,637,866.20
买卖股票差价收入	395,611,719.12

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

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

本基金本报告期无衍生工具收益。

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	19,305,319.52
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	19,305,319.52

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	-151,814,047.43
——股票投资	-151,814,047.43
——债券投资	-
——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	-151,814,047.43

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	378,449.81
转换费收入	18,207.65
合计	396,657.46

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	18,616,724.77
银行间市场交易费用	-
合计	18,616,724.77

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	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	109,095.94

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

本报告期内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
中国光大银行股份有限公司（简称“光大银行”）	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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
光大证券	3,336,343,346.53	26.79%	2,304,285,181.62	21.29%

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

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	3,081,332.47	28.30%	1,916,297.51	47.48%
关联方名称	上年度可比期间			

	2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
光大证券	2,137,316.43	22.96%	961,082.31	18.89%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方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	19,725,358.83	26,514,836.70
其中：支付销售机构的客户维护费	4,285,203.97	2,990,207.25

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，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，由基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财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	3,287,559.78	4,419,139.44

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，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，由基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 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**

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行	208,177,889.15	898,258.94	247,453,213.94	1,141,361.13

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
30061	百川	2021-0	2021-1	新股	9.19	40.38	329.00	3,023.	13,285	-

4	畅银	5-18	1-25	流通受限				51	.02	
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-07	新股流通受限	10.76	22.20	359.00	3,862.84	7,969.80	-
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	28.28	115.71	360.00	10,180.80	41,655.60	-

				受限						
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	-
30100	德迈	2021-0	2021-1	新股	5.29	14.44	303.00	1,602.	4,375.	-

7	仕	6-04	2-16	流通受限				87	32	
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股流通受限	7.83	17.61	218.00	1,706.94	3,838.98	-
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	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	-
688113	联测科技	2021-04-26	2021-11-08	新股流通受限	19.14	49.29	1,415.00	27,083.10	69,745.35	-
688195	腾景科技	2021-03-18	2021-09-27	新股流通受限	13.60	19.87	2,693.00	36,624.80	53,509.91	-

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	3,486.00	126,716.10	277,067.28	-
688345	博力威	2021-06-03	2021-12-13	新股流通受限	25.91	55.53	2,332.00	60,422.12	129,495.96	-
688655	迅捷兴	2021-04-28	2021-11-11	新股流通受限	7.59	15.77	3,083.00	23,399.97	48,618.91	-
688661	和林微纳	2021-03-19	2021-09-29	新股流通受限	17.71	84.01	1,452.00	25,714.92	121,982.52	-
688665	四方光电	2021-02-02	2021-08-09	新股流通受限	29.53	129.46	1,687.00	49,817.11	218,399.02	-
688689	银河微电	2021-01-15	2021-07-27	新股流通受限	14.01	35.62	3,258.00	45,644.58	116,049.96	-

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

本基金本报告期末无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

本基金管理人的风险管理体系包括三个层次：第一层次是基于自我评估和管理的业务/职能部门；

第二层次是公司经营层的风险管理工作委员会；第三层次是董事会下设的风险管理委员会。

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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 0.00%(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上市公司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。本基金持有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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。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	208,177,889.15	-	-	-	-	-	208,177,889.15
结算备付金	12,353,463.01	-	-	-	-	-	12,353,463.01
存出保证金	640,648.68	-	-	-	-	-	640,648.68
交易性金融资产	-	-	-	-	-	2,318,352,754.72	2,318,352,754.72
应收证券清算款	-	-	-	-	-	9,335,175.00	9,335,175.00
应收利息	-	-	-	-	-	44,053.04	44,053.04
应收申购款	-	-	-	-	-	87,560.37	87,560.37

资产总计	221,172,00 0.84	-	-	-	-	2,327,819,5 43.13	2,548,991,5 43.97
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,061,395.9 5	4,061,395.9 5
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,058,025.8 4	3,058,025.8 4
应付托管费	-	-	-	-	-	509,670.97	509,670.97
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,035,843.1 4	4,035,843.1 4
其他负债	-	-	-	-	-	110,119.36	110,119.36
负债总计	-	-	-	-	-	11,775,055. 26	11,775,055. 26
利率敏感度缺口	221,172,00 0.84	-	-	-	-	2,316,044,4 87.87	2,537,216,4 88.71
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	218,912,13 9.32	-	-	-	-	-	218,912,13 9.32
结算备付金	14,893,597. 26	-	-	-	-	-	14,893,597. 26
存出保证金	950,473.63	-	-	-	-	-	950,473.63
交易性金融资产	-	-	-	-	-	2,786,074,2 70.83	2,786,074,2 70.83
应收证券清算款	-	-	-	-	-	5,953,824.9 2	5,953,824.9 2
应收利息	-	-	-	-	-	56,402.76	56,402.76
应收申购款	-	-	-	-	-	116,449.02	116,449.02
资产总计	234,756,21 0.21	-	-	-	-	2,792,200,9 47.53	3,026,957,1 57.74
负债							
应付证券清算	-	-	-	-	-	32,672,686.	32,672,686.

款						17	17
应付赎回款	-	-	-	-	-	8,581,322.44	8,581,322.44
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,674,089.13	3,674,089.13
应付托管费	-	-	-	-	-	612,348.20	612,348.20
应付交易费用	-	-	-	-	-	5,881,338.70	5,881,338.70
其他负债	-	-	-	-	-	222,271.25	222,271.25
负债总计	-	-	-	-	-	51,644,055.89	51,644,055.89
利率敏感度缺口	234,756,210.21	-	-	-	-	2,740,556,891.64	2,975,313,101.85

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

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	2,318,352,754.72	91.37	2,786,074,270.83	93.64
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	2,318,352,754.72	91.37	2,786,074,270.83	93.64

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其过去一年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 28,789,835.86	增加约 30,413,093.20
	业绩比较基准下降 1%	减少约 28,789,835.86	减少约 30,413,093.20

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。

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	2,318,352,754.72	90.95
	其中：股票	2,318,352,754.72	90.95
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	220,531,352.16	8.65
8	其他各项资产	10,107,437.09	0.40
9	合计	2,548,991,543.97	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	102,227,408.93	4.03
C	制造业	1,499,624,175.69	59.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	47,617,255.93	1.88
F	批发和零售业	889,956.58	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	97,910,453.00	3.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	96,870,822.39	3.82
J	金融业	324,377,399.30	12.78
K	房地产业	723,840.00	0.03
L	租赁和商务服务业	95,258,738.98	3.75
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,315,822.25	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	45,376,455.00	1.79

R	文化、体育和娱乐业	6,136,116.00	0.24
S	综合	-	-
	合计	2,318,352,754.72	91.37

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	1,656,559	106,848,055.50	4.21
2	300124	汇川技术	1,222,782	90,803,791.32	3.58
3	601919	中远海控	2,840,150	86,738,181.00	3.42
4	600809	山西汾酒	187,251	83,888,448.00	3.31
5	002179	中航光电	977,608	77,250,584.16	3.04
6	600887	伊利股份	1,954,285	71,976,316.55	2.84
7	600426	华鲁恒升	2,286,539	70,768,382.05	2.79
8	603195	公牛集团	346,478	69,988,556.00	2.76
9	601088	中国神华	3,178,654	62,047,326.08	2.45
10	000725	京东方 A	8,707,500	54,334,800.00	2.14
11	601100	恒立液压	592,082	50,871,685.44	2.01
12	601658	邮储银行	10,113,900	50,771,778.00	2.00
13	601888	中国中免	165,532	49,676,153.20	1.96
14	000858	五粮液	166,558	49,615,962.62	1.96
15	603392	万泰生物	185,948	48,194,002.64	1.90
16	688111	金山办公	118,724	46,872,235.20	1.85
17	601288	农业银行	15,201,200	46,059,636.00	1.82
18	002027	分众传媒	4,844,058	45,582,585.78	1.80
19	601211	国泰君安	2,651,772	45,451,372.08	1.79
20	600763	通策医疗	110,405	45,376,455.00	1.79
21	600111	北方稀土	2,170,400	44,927,280.00	1.77
22	603659	璞泰来	327,063	44,676,805.80	1.76
23	601668	中国建筑	9,540,680	44,364,162.00	1.75
24	601799	星宇股份	196,075	44,258,049.00	1.74
25	600309	万华化学	396,677	43,166,391.14	1.70
26	601939	建设银行	6,325,300	42,063,245.00	1.66
27	300529	健帆生物	461,161	39,825,863.96	1.57
28	601398	工商银行	7,691,600	39,765,572.00	1.57
29	002230	科大讯飞	560,790	37,898,188.20	1.49
30	600885	宏发股份	562,187	35,249,124.90	1.39
31	688016	心脉医疗	74,018	33,649,322.98	1.33
32	002138	顺络电子	850,900	32,989,393.00	1.30
33	601336	新华保险	687,997	31,585,942.27	1.24

34	601988	中国银行	9,859,400	30,366,952.00	1.20
35	300725	药石科技	184,550	29,326,840.50	1.16
36	002876	三利谱	452,184	29,256,304.80	1.15
37	002064	华峰化学	2,031,444	28,846,504.80	1.14
38	002080	中材科技	1,091,246	28,557,907.82	1.13
39	600315	上海家化	468,740	28,190,023.60	1.11
40	002430	杭氧股份	804,759	27,836,613.81	1.10
41	603486	科沃斯	121,900	27,802,952.00	1.10
42	600966	博汇纸业	1,954,900	25,511,445.00	1.01
43	002078	太阳纸业	1,903,600	25,413,060.00	1.00
44	600298	安琪酵母	449,900	24,465,562.00	0.96
45	600028	中国石化	5,457,800	23,796,008.00	0.94
46	601677	明泰铝业	1,094,016	21,388,012.80	0.84
47	600496	精工钢构	4,834,280	19,723,862.40	0.78
48	300595	欧普康视	188,260	19,494,323.00	0.77
49	601166	兴业银行	804,804	16,538,722.20	0.65
50	601898	中煤能源	2,291,479	16,384,074.85	0.65
51	000799	酒鬼酒	57,500	14,697,000.00	0.58
52	000100	TCL 科技	1,744,352	13,344,292.80	0.53
53	601328	交通银行	2,581,600	12,649,840.00	0.50
54	603517	绝味食品	133,600	11,261,144.00	0.44
55	600377	宁沪高速	1,144,700	11,172,272.00	0.44
56	300379	东方通	324,260	9,238,167.40	0.36
57	002139	拓邦股份	392,969	7,069,512.31	0.28
58	002311	海大集团	85,000	6,936,000.00	0.27
59	601928	凤凰传媒	859,400	6,136,116.00	0.24
60	603898	好莱客	384,768	5,271,321.60	0.21
61	600036	招商银行	89,835	4,868,158.65	0.19
62	601636	旗滨集团	246,100	4,567,616.00	0.18
63	600019	宝钢股份	431,200	3,294,368.00	0.13
64	601186	中国铁建	435,900	3,238,737.00	0.13
65	000776	广发证券	206,000	3,118,840.00	0.12
66	688369	致远互联	43,883	2,804,123.70	0.11
67	603260	合盛硅业	23,000	1,768,930.00	0.07
68	002159	三特索道	116,600	1,280,268.00	0.05
69	601998	中信银行	216,200	1,102,620.00	0.04
70	000026	飞亚达	60,600	843,552.00	0.03
71	601155	新城控股	17,400	723,840.00	0.03
72	000933	神火股份	50,000	472,500.00	0.02
73	688276	百克生物	3,486	277,067.28	0.01
74	688665	四方光电	1,687	218,399.02	0.01
75	688345	博力威	2,332	129,495.96	0.01
76	688661	和林微纳	1,452	121,982.52	0.00
77	688689	银河微电	3,258	116,049.96	0.00

78	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
79	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
80	688113	联测科技	1,415	69,745.35	0.00
81	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
82	688195	腾景科技	2,693	53,509.91	0.00
83	688655	迅捷兴	3,083	48,618.91	0.00
84	688618	三旺通信	1,117	47,718.24	0.00
85	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
86	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
87	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
88	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
89	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
90	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
91	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
92	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
93	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
94	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
95	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
96	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
97	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
98	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
99	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
100	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
101	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
102	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
103	301013	C 利和兴	471	12,768.81	0.00
104	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
105	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
106	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
107	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
108	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
109	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
110	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
111	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
112	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
113	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
114	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
115	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
116	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
117	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
118	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
119	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
120	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
121	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00

122	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
123	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
124	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
125	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
126	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
127	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
128	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
129	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
130	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
131	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
132	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
133	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
134	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
135	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
136	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
137	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
138	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
139	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
140	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
141	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
142	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
143	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
144	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
145	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	601166	兴业银行	124,151,288.73	4.17
2	603259	药明康德	113,341,290.78	3.81
3	600309	万华化学	113,135,457.05	3.80
4	002415	海康威视	109,885,622.51	3.69
5	300529	健帆生物	108,415,326.94	3.64
6	601398	工商银行	99,960,527.00	3.36
7	002594	比亚迪	99,245,057.91	3.34
8	002410	广联达	87,549,806.21	2.94
9	600887	伊利股份	85,437,721.65	2.87
10	002179	中航光电	82,260,847.67	2.76
11	600036	招商银行	81,827,617.69	2.75

12	601318	中国平安	77,241,052.04	2.60
13	002841	视源股份	77,206,629.63	2.59
14	002271	东方雨虹	77,097,840.05	2.59
15	300413	芒果超媒	75,571,633.19	2.54
16	000661	长春高新	75,525,681.97	2.54
17	601799	星宇股份	73,943,523.58	2.49
18	601336	新华保险	71,738,960.14	2.41
19	603195	公牛集团	71,712,327.59	2.41
20	600426	华鲁恒升	70,563,068.08	2.37
21	300274	阳光电源	66,252,302.79	2.23
22	603501	韦尔股份	65,879,135.22	2.21
23	601088	中国神华	65,807,028.92	2.21
24	688036	传音控股	65,104,998.28	2.19
25	601888	中国中免	64,966,840.82	2.18
26	000510	新金路	64,833,467.86	2.18
27	000725	京东方 A	62,686,687.00	2.11
28	000671	阳光城	62,343,812.32	2.10
29	601658	邮储银行	62,024,653.48	2.08

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	600036	招商银行	177,909,274.62	5.98
2	002508	老板电器	138,490,509.93	4.65
3	300059	东方财富	137,432,087.78	4.62
4	000568	泸州老窖	135,127,916.31	4.54
5	603288	海天味业	131,097,093.40	4.41
6	002714	牧原股份	130,169,887.96	4.37
7	601919	中远海控	125,361,163.96	4.21
8	603259	药明康德	122,984,154.96	4.13
9	002493	荣盛石化	119,760,119.89	4.03
10	300015	爱尔眼科	114,479,180.38	3.85
11	000786	北新建材	113,963,486.38	3.83
12	600660	福耀玻璃	113,417,059.84	3.81
13	601398	工商银行	112,582,874.00	3.78
14	002410	广联达	111,705,832.19	3.75
15	002027	分众传媒	111,087,745.18	3.73
16	601336	新华保险	110,939,598.12	3.73
17	603501	韦尔股份	107,189,915.13	3.60
18	600900	长江电力	105,726,103.23	3.55
19	002241	歌尔股份	104,257,086.28	3.50

20	601166	兴业银行	103,446,985.50	3.48
21	601658	邮储银行	101,730,591.16	3.42
22	002607	中公教育	100,727,059.55	3.39
23	002179	中航光电	97,471,263.48	3.28
24	688036	传音控股	97,030,830.94	3.26
25	600438	通威股份	96,364,844.45	3.24
26	601939	建设银行	96,220,106.47	3.23
27	002271	东方雨虹	92,898,489.60	3.12
28	002594	比亚迪	90,236,322.59	3.03
29	601155	新城控股	84,217,981.98	2.83
30	601225	陕西煤业	84,010,836.41	2.82
31	300413	芒果超媒	81,306,979.53	2.73
32	601318	中国平安	81,185,465.96	2.73
33	000661	长春高新	78,773,719.38	2.65
34	600276	恒瑞医药	74,787,698.30	2.51
35	601100	恒立液压	74,587,963.37	2.51
36	300274	阳光电源	74,117,985.86	2.49
37	002841	视源股份	74,083,870.79	2.49
38	300124	汇川技术	70,857,093.72	2.38
39	601066	中信建投	70,784,241.94	2.38
40	300529	健帆生物	69,514,753.69	2.34
41	600309	万华化学	69,423,311.10	2.33
42	300408	三环集团	68,870,956.58	2.31
43	600809	山西汾酒	68,117,240.76	2.29
44	002236	大华股份	64,083,309.86	2.15
45	000510	新金路	62,545,662.87	2.10
46	300033	同花顺	62,055,500.43	2.09
47	000671	阳光城	59,590,243.20	2.00

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	5,876,730,397.52
卖出股票的收入（成交）总额	6,588,249,585.32

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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投资贵金属。

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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 公牛集团（603195）的发行主体公牛集团股份有限公司于 2021 年 5 月 11 日收到浙江省市场监督管理局《浙江省市场监督管理局关于上报公牛集团股份有限公司涉嫌与交易相对人达成并实施垄断协议行为立案报备的函》，浙江省市场监督管理局决定对公牛集团股份有限公司涉嫌与交易相对人达成并实施垄断协议行为进行立案调查。

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，本基金本报告期末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	640,648.68
2	应收证券清算款	9,335,175.00
3	应收股利	-
4	应收利息	44,053.04
5	应收申购款	87,560.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,107,437.09

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的情况。

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	持有份额	占总份额

			比例		比例
90,271	18,069.13	474,199,097.54	29.07%	1,156,919,692.13	70.93%

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	183,502.43	0.01%

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	0~10
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（2004 年 8 月 27 日）基金份额总额	2,544,287,215.94
本报告期期初基金份额总额	2,059,675,847.46
本报告期基金总申购份额	64,510,611.03
减：本报告期基金总赎回份额	493,067,668.82
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,631,118,789.67

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	
申万宏源	2	252,073,829.10	2.02%	128,890.40	1.18%	-
长江证券	1	422,268,312.27	3.39%	393,256.23	3.61%	-
安信证券	1	718,120,799.29	5.77%	668,786.76	6.14%	-
海通证券	1	750,855,772.72	6.03%	684,257.27	6.28%	-
国泰君安	2	835,208,333.64	6.71%	777,831.92	7.14%	-
平安证券	1	922,671,415.35	7.41%	840,831.04	7.72%	-
中泰证券	1	987,366,515.10	7.93%	919,523.99	8.45%	-
兴业证券	1	1,138,560,311.55	9.14%	1,060,337.67	9.74%	-
中信建投证券	3	1,209,557,043.24	9.71%	618,439.05	5.68%	-
国信证券	1	1,881,496,754.07	15.11%	1,714,613.46	15.75%	-
光大证券	3	3,336,343,346.53	26.79%	3,081,332.47	28.30%	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-

中信证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

注：（1）报告期内租用证券公司交易单元变更情况

本基金本报告期无新增或退租的交易单元。

（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。

董事会已做出决议，授权总经理依照公司对各券商的评价结果全权处理并决定公司旗下基金租用专用交易席位的事宜。

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
申万宏源	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

注：本报告期内本基金未通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

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	同上	2021-01-18

	招商银行直付通服务办理直销网上交易部分业务的公告		
3	光大保德信量化核心证券投资基金 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	光大保德信量化核心证券投资基金基金产品资料概要更新	同上	2021-03-26
7	光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书(更新)	同上	2021-03-26
8	光大保德信量化核心证券投资基金 2020 年年度报告	同上	2021-03-31
9	光大保德信量化核心证券投资基金 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量化核心证券投资基金设立的文件
- 2、 光大保德信量化核心证券投资基金基金合同
- 3、 光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书
- 4、 光大保德信量化核心证券投资基金托管协议
- 5、 光大保德信量化核心证券投资基金法律意见书
- 6、 报告期内光大保德信量化核心证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告
- 7、 基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
- 8、 基金托管人业务资格批件和营业执照
- 9、 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。客户服务中心电话：4008-202-888。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