

光大保德信品质生活混合型证券投资基金
2021 年第 4 季度报告
2021 年 12 月 31 日

基金管理人：光大保德信基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年一月二十四日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 光大保德信品质生活混合 |
| 基金主代码 | 012744 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 7 月 19 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 902,076,221.93 份 |
| 投资目标 | 本基金在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，精选具有竞争优势或潜力的优质上市公司，力争获得超越业绩比较基准的收益。 |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将通过研究宏观经济基本面及证券市场双层面的数据，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</p> |

| | |
|--|---|
| | <p>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）品质生活主题的界定</p> <p>随着经济的不断发展，人民的生活观念和生活品质正在发生日新月异的变化。随着居民可支配收入显著提升、中产人群规模扩大、新生代成为消费的主要力量，人们在生活用品及服务、教育文化娱乐等服务类消费上的支出比重日益提高。同时 5G 通信等一系列新兴科技的快速进步，驱动更多新模式、新产品不断涌现，并将在互联网、云计算、人工智能、数据服务等领域催生出众多千亿级别的企业。此外，人口老龄化大潮带来的医疗需求也将带动一批创新型医药企业进入高速增长轨道。以上，均将推动人们生活品质的持续提高。</p> <p>本基金界定的品质生活主题主要包括以下细分行业：一方面，是与生活品质提高相关的领域，包括：食品饮料、纺织服装、汽车、家用电器、轻工制造、商业零售、农林牧渔、休闲服务、医药生物、传媒、电子、房地产、非银金融等行业；另一方面，是与前述领域上下游相关并能提供基础资源、技术以及应用支持的领域，包括：电子、半导体、信息服务、5G 通信、云计算、新能源、人工智能、机械设备、轻工制造、交通运输等行业。</p> |
|--|---|

| | |
|--|---|
| | <p>本基金将重点关注代表生活品质提升的细分板块中具有较强竞争力的上市公司，把握中国经济增长和居民消费升级过程中的投资机会。本基金将对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，品质生活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品质生活主题的界定标准。</p> <p>(2) 行业配置策略</p> <p>本基金将通过自上而下的分析方式，并综合考虑行业景气度、行业周期、估值水平、盈利趋势、竞争格局、技术进步、政策条件、投资者结构变化等因素，对行业进行配置。</p> <p>(3) 个股选择策略</p> <p>本基金将通过自下而上的研究方式，结合定性和定量分析，深入挖掘上市公司的投资价值，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：</p> <p>1) 定量分析</p> <p>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。</p> <p>2) 定性分析</p> <p>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 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。</p> <p>根据上述定性定量分析的结果，本基金进一步从价值和成</p> |
|--|---|

| | |
|--|--|
| | <p>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。</p> <p>(4) 港股通标的股票投资策略</p> <p>本基金关注互联互通机制下港股市场投资机会，将重点关注以下几个方面：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) 基金管理人的研究团队重点覆盖的行业中，精选港股通中有代表性的行业龙头公司； 2) 具有行业稀缺性的香港本地和外资公司； 3) 与 A 股同类公司相比具有估值优势的公司。 <p>3、存托凭证的投资策略</p> <p>本基金将根据投资目标和股票投资策略，通过定性分析和定量分析相结合的方式，对存托凭证的发行企业和所属行业进行深入研究判断，在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，精选出具备投资价值的存托凭证进行投资。</p> <p>4、债券投资策略</p> <p>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。</p> <p>5、可转换债券投资策略</p> <p>本基金在分析宏观经济运行特征和证券市场趋势判断的前提下，在综合分析可转换债券的债性特征、股性特征等因素的基础上，选择其中安全边际较高、股性活跃并具有较高上涨潜力的品种进行投资。结合行业分析和个券选择，对成长前景较好的行业和上市公司的可转换债券进行</p> |
|--|--|

重点关注，选择投资价值较高的个券进行投资。

6、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。

7、衍生品投资策略

（1）股指期货投资策略

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，以套期保值为目的，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

（2）国债期货投资策略

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

（3）股票期权投资策略

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，

| | | |
|-----------------|---|-----------------|
| | <p>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>8、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 | <p>沪深 300 指数收益率×50%+恒生指数收益率×25%+中证全债指数收益率×25%</p> | |
| 风险收益特征 | <p>本基金为混合型基金，其预期收益和预期风险高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。</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> | |
| 基金管理人 | 光大保德信基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 光大保德信品质生活混合 A | 光大保德信品质生活混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 012744 | 012758 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 867,110,702.71 份 | 34,965,519.22 份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| | |
|--------|-----|
| 主要财务指标 | 报告期 |
|--------|-----|

| | (2021 年 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日) | |
|----------------|------------------------------------|---------------|
| | 光大保德信品质生活混合 A | 光大保德信品质生活混合 C |
| 1.本期已实现收益 | 1,213,607.47 | 8,648.63 |
| 2.本期利润 | -18,273,374.30 | -796,246.13 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0199 | -0.0207 |
| 4.期末基金资产净值 | 834,220,099.19 | 33,578,426.18 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9621 | 0.9603 |

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

1、光大保德信品质生活混合 A：

| 阶段 | 净值增长率 ① | 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 |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -1.89% | 0.92% | -0.06% | 0.57% | -1.83% | 0.35% |
| 自基金合同 生效起至今 | -3.79% | 0.82% | -5.11% | 0.76% | 1.32% | 0.06% |

2、光大保德信品质生活混合 C：

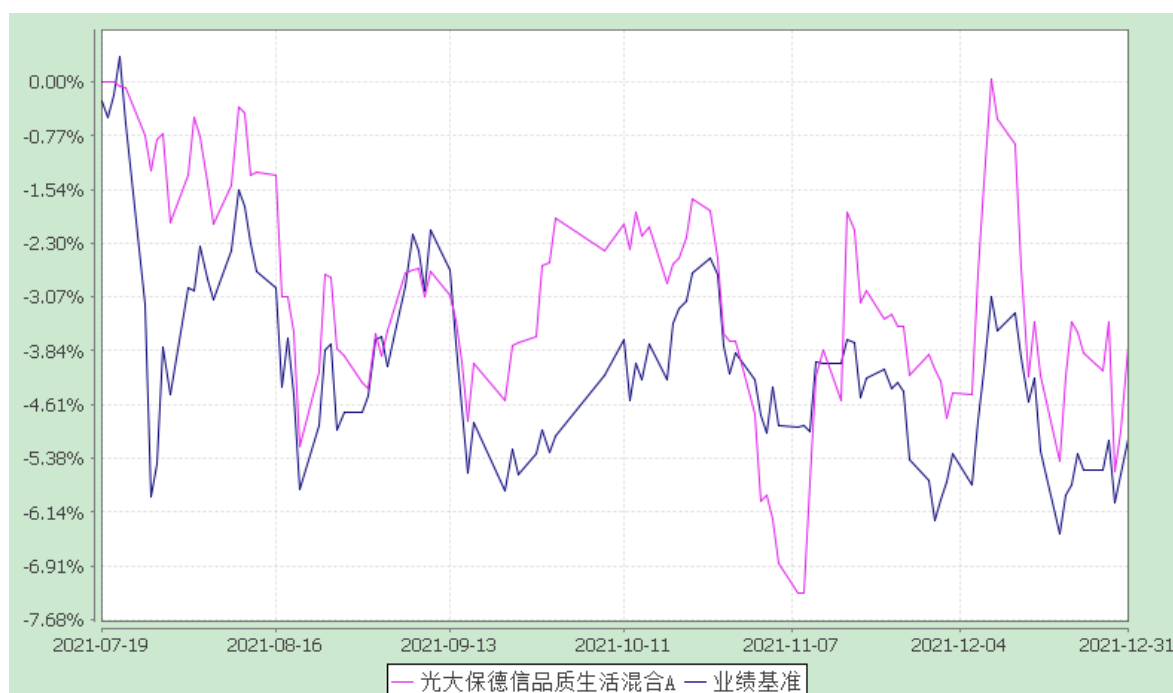
| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -1.99% | 0.92% | -0.06% | 0.57% | -1.93% | 0.35% |
| 自基金合同 生效起至今 | -3.97% | 0.82% | -5.11% | 0.76% | 1.14% | 0.06% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

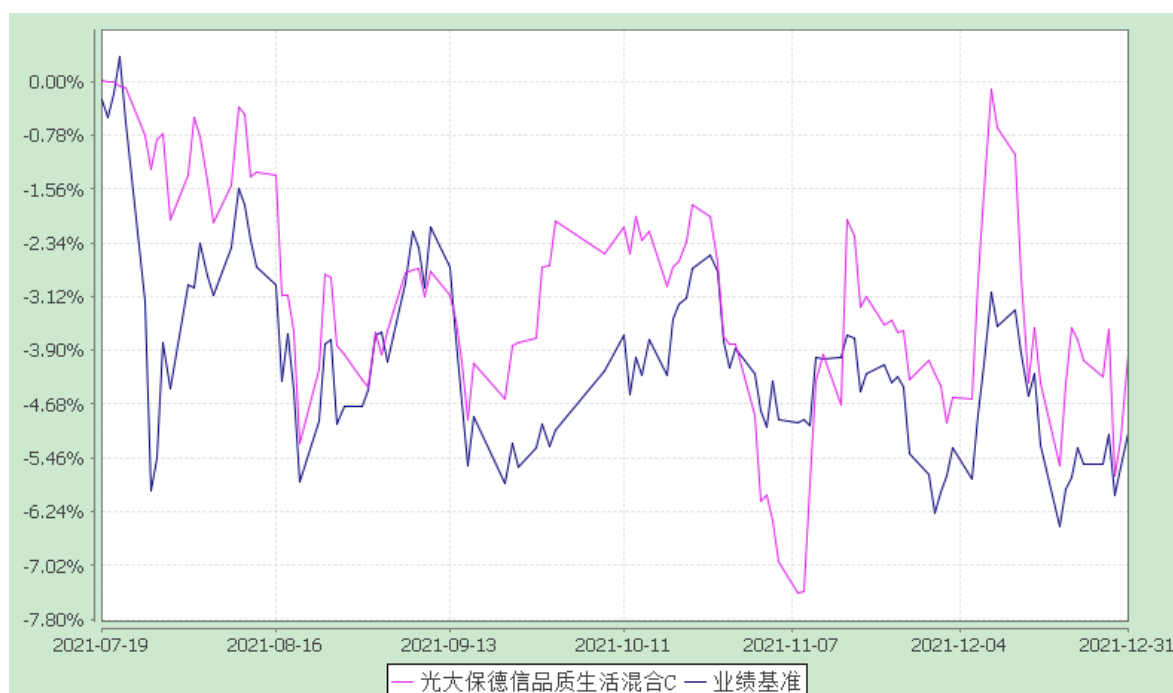
光大保德信品质生活混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2021 年 7 月 19 日至 2021 年 12 月 31 日)

1. 光大保德信品质生活混合 A:



2. 光大保德信品质生活混合 C:



注：根据基金合同的规定，本基金建仓期为 2021 年 7 月 19 日至 2022 年 1 月 18 日。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期内。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|---------------------|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 詹佳 | 权益管理总部国际业务团队队长、基金经理 | 2021-07-19 | - | 12 年 | 詹佳先生于 2008 年获得香港科技大学运营管理学学士学位，2013 年获得香港大学金融学硕士学位。2008 年 6 月至 2011 年 6 月在忠利保险有限公司担任研究分析师；2011 年 7 月至 2013 年 6 月在香港富通投资管理有限公司担任中国股票主管、投资分析师；2013 年 7 月至 2017 年 12 月在建银国际资产管理有限公司担任董事、组合管理部门代理负责人；2017 年 12 月加入光大保德信基金管理有限公司，任职权益管理总部国际业务团队团队队长一职。2018 年 6 月至今担任光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 7 月至 2020 年 10 月担任光大保德信红利混合型证券投资基金的基金经理，2019 年 12 月至今担任光大保德信先进服务业灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2020 年 5 月至今担任光大保德信永鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2020 年 6 月至今担任光大保德信裕鑫混合型证券投资基金的基金经理，2020 年 10 月至今担任光大保德信行业轮动混合型证券投资基金的基金经理，2021 年 7 月至今担任光大保德信品质生活混合型证券投资基金的基金经理，2021 年 8 月至今担任光大保德信安和债券型证券投资基金的基金经理，2021 年 11 月至今担任光大保德信创新生活混合型证券投资基金的基金经理。 |

注：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。

4.1.1 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 公平交易专项说明

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。本报告期内，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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度宏观方面，国内经济复苏节奏略有放缓。从领先指标观察，四季度中国制造业采购经理人指数 PMI 在荣枯线位置徘徊，显示制造业景气度呈弱复苏状态。房地产投资在楼市调控政策下，增速出现下滑。政策方面，中央经济工作会议提出以稳经济为主要的政策目标，为国内经济的保持宏观政策连续性、稳定性、可持续性提供了保障。国际方面，美联储受通胀压力影响，对减少买债方案速度略有提速，加息预期略有提前，大致符合市场预期，国际金融市场表现基本稳定。

基金在四季度权益投资方面，以大盘及中盘股配置为主，并在物业管理、消费、医药及其他稳经济方向的板块做了主要的配置。在选股方面，继续保持对标的估值要求，继续为基金追求稳健的收益目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内光大保德信品质生活 A 份额净值增长率为-1.89%，业绩比较基准收益率为-0.06%，光大保德信品质生活 C 份额净值增长率为-1.99%，业绩比较基准收益率为-0.06%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 694,064,750.81 | 79.57 |
| | 其中：股票 | 694,064,750.81 | 79.57 |
| 2 | 固定收益投资 | 135,096,051.50 | 15.49 |
| | 其中：债券 | 135,096,051.50 | 15.49 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 39,509,672.52 | 4.53 |
| 7 | 其他各项资产 | 3,561,700.99 | 0.41 |
| 8 | 合计 | 872,232,175.82 | 100.00 |

注：报告期末本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为293,570,934.89元，占基金资产净值比例为33.83%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 337,913,025.29 | 38.94 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,555,254.42 | 0.41 |
| E | 建筑业 | 20,329.28 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 142,855.48 | 0.02 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | 4,608.00 | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 39,818.75 | 0.00 |
| J | 金融业 | 17,835,066.00 | 2.06 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 12,258,822.52 | 1.41 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 28,641,969.66 | 3.30 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 34,387.07 | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 18,161.78 | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 29,517.67 | 0.00 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 400,493,815.92 | 46.15 |

5.2.2 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（%） |
|-------|----------------|--------------|
| 日常消费品 | 30,173,773.28 | 3.48 |
| 金融 | 4,691,405.15 | 0.54 |
| 医疗保健 | 19,030,723.32 | 2.19 |
| 可选消费 | 23,409,572.26 | 2.70 |
| 房地产 | 216,265,460.88 | 24.92 |
| 合计 | 293,570,934.89 | 33.83 |

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|--------------|---------------|--------------|
| 1 | 06049 | 保利物业 | 1,611,400.00 | 80,761,563.23 | 9.31 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 27,200.00 | 55,760,000.00 | 6.43 |
| 3 | 01755 | 新城悦服务 | 5,841,000.00 | 53,391,225.89 | 6.15 |
| 4 | 06098 | 碧桂园服务 | 1,241,000.00 | 47,383,762.72 | 5.46 |
| 5 | 00291 | 华润啤酒 | 578,000.00 | 30,173,773.28 | 3.48 |
| 6 | 603259 | 药明康德 | 218,740.00 | 25,938,189.20 | 2.99 |
| 7 | 000858 | 五粮液 | 114,700.00 | 25,539,102.00 | 2.94 |
| 8 | 01691 | J S 环球生活 | 2,179,000.00 | 23,409,572.26 | 2.70 |
| 9 | 02869 | 绿城服务 | 3,654,000.00 | 21,510,074.88 | 2.48 |
| 10 | 600690 | 海尔智家 | 657,590.00 | 19,655,365.10 | 2.26 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 135,096,051.50 | 15.57 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 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 | 135,096,051.50 | 15.57 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 019658 | 21 国债 10 | 1,352,990 | 135,096,051.50 | 15.57 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

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合理的估值水平。

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。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**5.10.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 173,401.34 |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,041,213.20 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,222,663.51 |
| 5 | 应收申购款 | 124,422.94 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 3,561,700.99 |

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 光大保德信品质生活混 合A | 光大保德信品质生活混 合C |
|--------------|------------------|------------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 975,407,315.88 | 41,724,364.13 |

| | | |
|----------------|----------------|---------------|
| 报告期期间基金总申购份额 | 3,037,294.35 | 1,013,473.86 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 111,333,907.52 | 7,772,318.77 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 867,110,702.71 | 34,965,519.22 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期内基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在持有、申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准光大保德信品质生活混合型证券投资基金设立的文件
- 2、光大保德信品质生活混合型证券投资基金基金合同
- 3、光大保德信品质生活混合型证券投资基金招募说明书
- 4、光大保德信品质生活混合型证券投资基金托管协议
- 5、光大保德信品质生活混合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品质生活混合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

9.2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。

9.3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

二〇二二年一月二十四日