

光大保德信消费主题股票型证券投资基金
2022 年中期报告
2022 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：二〇二二年八月三十一日

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 2022 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 2022 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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
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	14
6 中期财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53
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	53
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	53
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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	54
8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	56
9 开放式基金份额变动	56
10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	57
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	57
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.9 其他重大事件	59
11 影响投资者决策的其他重要信息	59
12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

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	162,547,057.45 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	1、资产配置策略 本基金将通过对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： （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； （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； （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。 2、股票投资策略 （1）消费主题的界定 本基金所界定的消费主题股票主要包括： 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； 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； 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。 （2）个股选择策略 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

	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 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
--	--

	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。 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。 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。 7、其他品种投资策略 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。
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	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。 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。

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	高顺平	罗菲菲
	联系电话	(021) 80262888	010-58560666
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话		4008-202-888	95568
传真		(021) 80262468	010-57093382
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（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-19,780,659.34
本期利润	-19,861,443.48
加权平均基金份额本期利润	-0.1152
本期加权平均净值利润率	-8.26%
本期基金份额净值增长率	-5.28%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	87,058,058.60
期末可供分配基金份额利润	0.5356
期末基金资产净值	249,605,116.05
期末基金份额净值	1.5356
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	53.56%

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	11.93%	1.33%	11.34%	1.22%	0.59%	0.11%
过去三个月	20.18%	1.71%	17.33%	1.44%	2.85%	0.27%
过去六个月	-5.28%	1.71%	-3.13%	1.57%	-2.15%	0.14%
过去一年	-3.65%	1.50%	-10.96%	1.46%	7.31%	0.04%
自基金合同生效起至今	53.56%	1.49%	36.94%	1.43%	16.62%	0.06%

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 2022 年 6 月 30 日)



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 2022 年 6 月 30 日，光大保德信旗下管理着 70 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、光大保德信品质生活混合型证券投资基金、光大保德信健康优加混合型证券投资基金、光大保德信睿盈混合型证券投资基金、光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金、光大保德信创新生活混合型证券投资基金、光大保德信纯债债券型证券投资基金、光大保德信恒鑫混合型证券投资基金、光大保德信中短期利率债债券型证券投资基金、光大保德信核心资产混合型证券投资基金、光大保德信尊利纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金。

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	-	10 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。

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

回顾上半年，中证内地消费指数下跌 3.51%。按照流通市值加权平均看各消费行业涨跌幅，社会服务上涨 4.88%，汽车上涨 2.32%，美容护理上涨 0.89%，商贸零售下跌 0.04%，食品饮料下跌 1.87%，农林牧渔下跌 3.06%，家电下跌 5.35%，纺织服装下跌 7.49%。

上半年消费板块在外资变动、俄乌冲突、稳增长等多重因素的影响下，经历了大幅的波动，期间不同阶段虽有不同的市场偏好，但回头会发现，最终行业的发展阶段和企业的发展势能决定了公司的价值。消费虽会受经济预期的影响有所波动，但结合人口数量、收支结构、美好生活的向往看，消费中长期的韧性依然很好。能够不断推陈出新，满足市场真正需求的消费品和服务将会逐步走出差异化的企业发展态势，其品牌力也将伴随着企业的发展而不断提升。

上半年组合维持了高仓位运作，行业较为分散，个股较为集中。结构有所调整，向顺周期方向做了倾斜。在个股的选择中，在增长空间和估值之间寻求平衡点。考虑到经济复苏的节奏，适当提

高了个股的时间成本。

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-5.28%，业绩比较基准收益率为-3.13%，

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，随着稳增长各种措施的逐步推进和疫情防控的持续优化，经济有望逐步向好，虽很难预测经济复苏的斜率，但经济复苏的方向是确定的。经济的复苏未必是一帆风顺，需用积极的心态面对和接受现实。市场在上半年的各种利空影响下已经有所回调，预计下半年相对来说影响市场的利空因素较小，随着复苏的推进，业绩对股价的影响预计会强于估值的波动。在下半年的复苏或者通胀两个维度下，消费均可能有所受益。在组合的构建上继续维持行业较为分散，个股相对集中的策略进行配置。

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，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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	4,182,100.21	1,748,998.24
结算备付金		221,179.86	2,112,869.20
存出保证金		100,184.32	228,392.64
交易性金融资产	6.4.7.2	246,328,377.79	275,354,174.87
其中：股票投资		233,675,289.93	260,364,521.07
基金投资		-	-
债券投资		12,653,087.86	14,989,653.80
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	877,763.47
应收股利		50,736.00	-
应收申购款		2,534,875.61	32,520.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	223,427.00
资产总计		253,417,453.79	280,578,146.17
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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		-	-
应付清算款		2,523,085.38	999,342.98
应付赎回款		465,465.00	935,936.14
应付管理人报酬		288,845.17	314,059.49
应付托管费		48,140.87	52,343.26
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	486,801.32	1,311,546.37
负债合计		3,812,337.74	3,613,228.24
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	162,547,057.45	170,837,202.46
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	87,058,058.60	106,127,715.47
净资产合计		249,605,116.05	276,964,917.93
负债和净资产总计		253,417,453.79	280,578,146.17

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5356 元，基金份额总额 162,547,057.45 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-17,670,346.31	4,083,742.38
1.利息收入		22,591.15	305,526.20
其中：存款利息收入	6.4.7.9	22,591.15	35,457.55
债券利息收入		-	237,802.79
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	32,265.86
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-17,677,883.09	57,665,634.43
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-19,415,925.20	56,438,889.11
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	164,035.32	-197,956.40
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,574,006.79	1,424,701.72
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-80,784.14	-55,357,574.16
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	65,729.77	1,470,155.91
减：二、营业总支出		2,191,097.17	4,802,567.66
1. 管理人报酬		1,791,992.89	2,479,273.85

2. 托管费		298,665.41	413,212.39
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		193.53	-
其中：卖出回购金融资产支出		193.53	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		-	0.13
8. 其他费用	6.4.7.19	100,245.34	1,910,081.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-19,861,443.48	-718,825.28
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-19,861,443.48	-718,825.28
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-19,861,443.48	-718,825.28

6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	170,837,202.46	-	106,127,715.47	276,964,917.93
二、本期期初净资产（基金净值）	170,837,202.46	-	106,127,715.47	276,964,917.93
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-8,290,145.01	-	-19,069,656.87	-27,359,801.88
（一）、综合收益总额	-	-	-19,861,443.48	-19,861,443.48
（二）、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）	-8,290,145.01	-	791,786.61	-7,498,358.40
其中：1.基金申购	26,687,342.18	-	12,968,918.09	39,656,260.27

款				
2.基金赎回款	-34,977,487.19	-	-12,177,131.48	-47,154,618.67
(三)、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)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	162,547,057.45	-	87,058,058.60	249,605,116.05
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	318,641,566.20	-	200,797,523.90	519,439,090.10
二、本期期初净资产(基金净值)	318,641,566.20	-	200,797,523.90	519,439,090.10
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-147,867,581.28	-	-99,407,321.21	-247,274,902.49
(一)、综合收益总额	-	-	-718,825.28	-718,825.28
(二)、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
(三)、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)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	170,773,984.92	-	101,390,202.69	272,164,187.61

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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

除下述变更后的会计政策外，本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自

2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 1,748,998.24 元、2,112,869.20 元、228,392.64 元、223,427.00 元、877,763.47 元和 32,520.75 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 1,750,063.55 元、2,113,915.08 元、228,505.72 元、0.00 元、877,763.47 元和 32,520.75 元。原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 275,354,174.87 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 275,575,377.60 元。原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 999,342.98 元、935,936.14 元、314,059.49 元、52,343.26 元、1,081,012.85 元和 533.52 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 999,342.98 元、935,936.14 元、314,059.49 元、52,343.26 元、1,081,012.85 元和 533.52 元。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	4,182,100.21
等于：本金	4,181,084.51
加：应计利息	1,015.70
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	4,182,100.21

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		223,872,784.22	-	233,675,289.93	9,802,505.71
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所		58,993.22		
	市场	2,537,595.45		2,594,526.22	-2,062.45
	银行间		67,561.64		
	市场	9,965,420.00		10,058,561.64	25,580.00
合计		12,503,015.45	126,554.86	12,653,087.86	23,517.55
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		236,375,799.67	126,554.86	246,328,377.79	9,826,023.26

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	1,151.33
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	166,389.84
其中：交易所市场	166,214.84
银行间市场	175.00
应付利息	-
预提审计费	89,752.78
预提信息披露费	229,507.37
合计	486,801.32

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	170,837,202.46	170,837,202.46
本期申购	26,687,342.18	26,687,342.18
本期赎回（以“-”号填列）	-34,977,487.19	-34,977,487.19
本期末	162,547,057.45	162,547,057.45

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 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	152,150,539.01	-46,022,823.54	106,127,715.47
本期利润	-19,780,659.34	-80,784.14	-19,861,443.48
本期基金份额交易产生的变动数	-6,962,453.77	7,754,240.38	791,786.61
其中：基金申购款	22,563,464.20	-9,594,546.11	12,968,918.09
基金赎回款	-29,525,917.97	17,348,786.49	-12,177,131.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	125,407,425.90	-38,349,367.30	87,058,058.60

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	16,131.24
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	4,881.66
其他	1,578.25
合计	22,591.15

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	235,699,805.29
减：卖出股票成本总额	254,465,554.56
减：交易费用	650,175.93
买卖股票差价收入	-19,415,925.20

6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	135,736.15
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	28,299.17
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	164,035.32

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	15,399,447.25
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	15,062,426.76
减：应计利息总额	308,538.45
减：交易费用	182.87
买卖债券差价收入	28,299.17

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 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。

6.4.7.15.2 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。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,574,006.79
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	1,574,006.79

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	-80,784.14
——股票投资	-76,586.49
——债券投资	-4,197.65
——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	-80,784.14

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	63,779.43
转换费收入	1,950.34
合计	65,729.77

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022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	-
沪港通证券组合费	362.95
银行汇划费	1,622.24
账户维护费	9,000.00
合计	100,245.34

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	143,588,105.51	31.58%	504,577,955.16	43.69%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期末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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	0.00	0.00%	368,647.22	1.24%

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期末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 2022年1月1日至2022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	131,401.90	37.15%	64,375.50	38.73%
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期	占当期佣金	期末应付佣金余额	占期末应付佣金

	佣金	总量的比例		金总额的比例
光大证券	460,056.33	49.45%	99,107.70	47.14%

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 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,791,992.89	2,479,273.85
其中：支付销售机构的客户维护费	638,445.09	1,055,488.45

注：支付基金管理人光大保德信基金管理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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	298,665.41	413,212.39

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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 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 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
期初持有的基金份额	10,004,850.00	10,004,850.00
期间申购/买入总份额	0.00	0.00
期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：期间赎回/卖出总份额	4,000,000.00	0.00
期末持有的基金份额	6,004,850.00	10,004,850.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	3.69%	5.86%

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
中国民生银行	4,182,100.21	16,131.24	1,084,175.86	21,180.68

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（2022 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	受限期	流通受限类	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

				型						
688170	德龙激光	2022-04-22	6 个月	新股锁定 期内	30.18	47.04	4,281.00	129,200.58	201,378.24	-
688326	经纬恒润	2022-04-11	6 个月	新股锁定 期内	121.00	134.07	1,290.00	156,090.00	172,950.30	-
688322	奥比中光	2022-06-30	1 个月 以内	新股未上 市	30.99	30.99	4,461.00	138,246.39	138,246.39	-
688045	必易微	2022-05-19	6 个月	新股锁定 期内	55.15	61.98	2,127.00	117,304.05	131,831.46	-
301139	元道通信	2022-06-30	1 个月 以内	新股未上 市	38.46	38.46	2,745.00	105,572.70	105,572.70	-
688237	超卓航科	2022-06-24	1 个月 以内	新股未上 市	41.27	41.27	2,268.00	93,600.36	93,600.36	-
688400	凌云光	2022-06-27	1 个月 以内	新股未上 市	21.93	21.93	4,114.00	90,220.02	90,220.02	-
301239	普瑞眼科	2022-06-22	1 个月 以内	新股未上 市	33.65	33.65	2,672.00	89,912.80	89,912.80	-
688207	格灵深瞳	2022-03-09	6 个月	新股锁定 期内	39.49	26.38	3,125.00	123,406.25	82,437.50	-
688125	安达智能	2022-04-08	6 个月	新股锁定 期内	60.55	43.43	1,887.00	114,257.85	81,952.41	-
688150	莱特光电	2022-03-10	6 个月	新股锁定 期内	22.05	19.60	4,099.00	90,382.95	80,340.40	-
688259	创耀科技	2022-01-05	6 个月	新股锁定 期内	66.60	79.22	798.00	53,146.80	63,217.56	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	1 个月 以内	新股未上 市	41.52	41.52	1,418.00	58,875.36	58,875.36	-
301215	中汽股份	2022-02-28	6 个月	新股锁定 期内	3.80	6.39	3,357.00	12,756.60	21,451.23	-

301120	新特电气	2022-04-11	6 个月	新股锁定 期内	13.73	15.49	990.00	13,592.70	15,335.10	-
301112	信邦智能	2022-06-20	6 个月	新股锁定 期内	27.53	45.04	332.00	9,139.96	14,953.28	-
301122	采纳股份	2022-01-19	6 个月	新股锁定 期内	50.31	70.37	193.00	9,709.83	13,581.41	-
301263	泰恩康	2022-03-22	6 个月	新股锁定 期内	19.93	31.38	405.00	8,071.65	12,708.90	-
301217	铜冠铜箔	2022-01-20	6 个月	新股锁定 期内	17.27	14.83	846.00	14,610.42	12,546.18	-
301259	艾布鲁	2022-04-18	6 个月	新股锁定 期内	18.39	24.94	483.00	8,882.37	12,046.02	-
301268	铭利达	2022-03-29	6 个月	新股锁定 期内	28.50	34.87	339.00	9,661.50	11,820.93	-
301235	华康医疗	2022-01-21	6 个月	新股锁定 期内	39.30	37.93	311.00	12,222.30	11,796.23	-
301139	元道通信	2022-06-30	6 个月	新股未上 市	38.46	38.46	306.00	11,768.76	11,768.76	-
301256	华融化学	2022-03-14	6 个月	新股锁定 期内	8.05	10.08	1,144.00	9,209.20	11,531.52	-
301212	联盛化学	2022-04-07	6 个月	新股锁定 期内	29.67	33.28	333.00	9,880.11	11,082.24	-
301153	中科江南	2022-05-10	6 个月	新股锁定 期内	33.68	43.98	229.00	7,712.72	10,071.42	-
301239	普瑞眼科	2022-06-22	6 个月	新股未上 市	33.65	33.65	297.00	9,994.05	9,994.05	-
301137	哈焊华通	2022-03-14	6 个月	新股锁定 期内	15.37	15.99	609.00	9,360.33	9,737.91	-
301162	国能日新	2022-04-19	6 个月	新股锁定	45.13	54.11	178.00	8,033.14	9,631.58	-

				期内						
301116	益客食品	2022-01-10	6 个月	新股锁定 期内	11.40	20.46	469.00	5,346.60	9,595.74	-
301200	大族数控	2022-02-18	6 个月	新股锁定 期内	76.56	51.92	183.00	14,010.48	9,501.36	-
301236	软通动力	2022-03-08	6 个月	新股锁定 期内	48.51	31.38	302.00	14,648.88	9,476.76	-
301248	杰创智能	2022-04-13	6 个月	新股锁定 期内	39.07	29.87	307.00	11,994.49	9,170.09	-
301288	清研环境	2022-04-14	6 个月	新股锁定 期内	19.09	19.98	452.00	8,628.68	9,030.96	-
301103	何氏眼科	2022-03-14	6 个月	新股锁定 期内	32.67	32.02	281.00	9,180.00	8,997.62	-
301163	宏德股份	2022-04-11	6 个月	新股锁定 期内	26.27	32.33	277.00	7,276.79	8,955.41	-
301130	西点药业	2022-02-16	6 个月	新股锁定 期内	22.55	37.70	237.00	5,344.35	8,934.90	-
301206	三元生物	2022-01-26	6 个月	新股锁定 期内	72.87	45.69	195.00	14,209.00	8,909.55	-
301216	万凯新材	2022-03-21	6 个月	新股锁定 期内	35.68	29.84	276.00	9,847.68	8,235.84	-
301109	军信股份	2022-04-06	6 个月	新股锁定 期内	23.23	16.14	505.00	11,730.97	8,150.70	-
301148	嘉戎技术	2022-04-14	6 个月	新股锁定 期内	38.39	23.90	329.00	12,630.31	7,863.10	-
301158	德石股份	2022-01-07	6 个月	新股锁定 期内	15.64	20.38	379.00	5,927.56	7,724.02	-
301228	实朴检测	2022-01-21	6 个月	新股锁定 期内	20.08	20.34	373.00	7,489.84	7,586.82	-
30120	华兰	2022-0	6 个月	新股	56.88	56.42	134.00	7,621.	7,560.	-

7	疫苗	2-10		锁定 期内				92	28	
30110 2	兆讯 传媒	2022-0 3-15	6 个月	新股 锁定 期内	39.88	31.09	243.00	9,690. 84	7,554. 87	-
30122 2	浙江 恒威	2022-0 3-02	6 个月	新股 锁定 期内	33.98	28.96	258.00	8,766. 84	7,471. 68	-
30115 0	中一 科技	2022-0 4-14	6 个月	新股 锁定 期内	109.04	82.76	87.00	9,486. 48	7,200. 12	-
30118 1	标榜 股份	2022-0 2-11	6 个月	新股 锁定 期内	40.25	30.59	235.00	9,458. 75	7,188. 65	-
30112 3	奕东 电子	2022-0 1-14	6 个月	新股 锁定 期内	37.23	25.39	273.00	10,163 .79	6,931. 47	-
30125 8	富士 莱	2022-0 3-21	6 个月	新股 锁定 期内	48.30	41.68	162.00	7,824. 60	6,752. 16	-
30123 3	盛帮 股份	2022-0 6-24	6 个月	新股 未上 市	41.52	41.52	158.00	6,560. 16	6,560. 16	-
30115 1	冠龙 节能	2022-0 3-30	6 个月	新股 锁定 期内	30.82	21.46	305.00	9,400. 10	6,545. 30	-
30123 7	和顺 科技	2022-0 3-16	6 个月	新股 锁定 期内	56.69	41.86	144.00	8,163. 36	6,027. 84	-
30127 9	金道 科技	2022-0 4-06	6 个月	新股 锁定 期内	31.20	22.81	261.00	8,143. 20	5,953. 41	-
30121 9	腾远 钴业	2022-0 3-10	6 个月	新股 锁定 期内	96.36	87.82	65.00	6,263. 28	5,708. 30	-
301110	青木 股份	2022-0 3-04	6 个月	新股 锁定 期内	63.10	39.85	136.00	8,581. 60	5,419. 60	-
30083 4	星辉 环材	2022-0 1-06	6 个月	新股 锁定 期内	55.57	30.03	144.00	8,002. 08	4,324. 32	-
30119 6	唯科 科技	2022-0 1-04	6 个月	新股 锁定 期内	64.08	37.52	87.00	5,574. 96	3,264. 24	-

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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

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：0.00%)。

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上述比例限制)。

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清算备付金、债券投资、存出保证金、银行存款。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	4,182,100.21	-	-	-	-	-	4,182,100.21
结算备付金	221,179.86	-	-	-	-	-	221,179.86
存出保证金	100,184.32	-	-	-	-	-	100,184.32
交易性金融资产	-	2,594,526.22	10,058,561.64	-	-	233,675,289.93	246,328,377.79
应收股利	-	-	-	-	-	50,736.00	50,736.00
应收申购款	-	-	-	-	-	2,534,875.61	2,534,875.61
资产总计	4,503,464.39	2,594,526.22	10,058,561.64	-	-	236,260,901.54	253,417,453.79
负债							
应付证券清算	-	-	-	-	-	2,523,085.3	2,523,085.3

款						8	8
应付赎回款	-	-	-	-	-	465,465.00	465,465.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	288,845.17	288,845.17
应付托管费	-	-	-	-	-	48,140.87	48,140.87
应付交易费用	-	-	-	-	-	166,389.84	166,389.84
其他负债	-	-	-	-	-	320,411.48	320,411.48
负债总计	-	-	-	-	-	3,812,337.74	3,812,337.74
利率敏感度缺口	4,503,464.39	2,594,526.22	10,058,561.64	-	-	232,448,563.80	249,605,116.05
上年度末 2021 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	1,748,998.24	-	-	-	-	-	1,748,998.24
结算备付金	2,112,869.20	-	-	-	-	-	2,112,869.20
存出保证金	228,392.64	-	-	-	-	-	228,392.64
交易性金融资产	-	-	14,989,653.80	-	-	260,364,521.07	275,354,174.87
应收证券清算款	-	-	-	-	-	877,763.47	877,763.47
应收利息	-	-	-	-	-	223,427.00	223,427.00
应收申购款	-	-	-	-	-	32,520.75	32,520.75
资产总计	4,090,260.08	-	14,989,653.80	-	-	261,498,232.29	280,578,116.17
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	999,342.98	999,342.98
应付赎回款	-	-	-	-	-	935,936.14	935,936.14
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	314,059.49	314,059.49
应付托管费	-	-	-	-	-	52,343.26	52,343.26
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,081,012.85	1,081,012.85

其他负债	-	-	-	-	-	230,533.52	230,533.52
负债总计	-	-	-	-	-	3,613,228.24	3,613,228.24
利率敏感度缺口	4,090,260.08	-	14,989,653.80	-	-	257,885.004.05	276,964.917.93

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 5.07%(上年末：5.41%)，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	本期末 2022年6月30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	-	10,506,009.15	10,506,009.15
资产合计	-	10,506,009.15	10,506,009.15
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表	-	10,506,009.15	10,506,009.15

外汇风险敞口净额			
项目	上年度末 2021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	-	10,962,789.60	10,962,789.60
资产合计	-	10,962,789.60	10,962,789.60
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表 外汇风险敞口净额	-	10,962,789.60	10,962,789.60

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
		港币相对人民币升值 1%	增加约 105,060.09
	港币相对人民币贬值 1%	减少约 105,060.09	减少约 109,627.90

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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	233,675,289.93	93.62	260,364,521.07	94.01
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	233,675,289.93	93.62	260,364,521.07	94.01

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 1%	增加约 2,487,379.76	增加约 2,585,226.39
	业绩比较基准下降 1%	减少约 2,487,379.76	减少约 2,585,226.39

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 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日
第一层次	231,868,102.40
第二层次	13,229,515.49
第三层次	1,230,759.90
合计	246,328,377.79

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价

值相差很小。

6.4.15 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	233,675,289.93	92.21
	其中：股票	233,675,289.93	92.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,653,087.86	4.99
	其中：债券	12,653,087.86	4.99
	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	4,403,280.07	1.74
8	其他各项资产	2,685,795.93	1.06
9	合计	253,417,453.79	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 10506009.15 元，占期末净值比例 4.21%。

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	12,588,296.00	5.04
B	采矿业	-	-
C	制造业	179,260,628.01	71.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	12,708.90	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	438,597.43	0.18
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	30,691,251.87	12.30
M	科学研究和技术服务业	40,834.28	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	28,059.82	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	108,904.47	0.04
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	223,169,280.78	89.41

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（%）
日常消费品	10,506,009.15	4.21
合计	10,506,009.15	4.21

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	600600	青岛啤酒	187,100.00	19,443,432.00	7.79
2	603317	天味食品	658,175.00	18,738,242.25	7.51
3	600702	舍得酒业	76,900.00	15,686,831.00	6.28
4	002304	洋河股份	85,200.00	15,604,380.00	6.25
5	300662	科锐国际	296,400.00	15,380,196.00	6.16
6	601888	中国中免	65,700.00	15,303,501.00	6.13
7	000858	五粮液	74,500.00	15,043,785.00	6.03
8	600195	中牧股份	1,047,300.00	12,839,898.00	5.14

9	000998	隆平高科	755,600.00	12,588,296.00	5.04
10	603129	春风动力	95,800.00	10,894,376.00	4.36
11	00291	华润啤酒	210,000.00	10,506,009.15	4.21
12	600809	山西汾酒	30,800.00	10,003,840.00	4.01
13	603187	海容冷链	266,741.00	9,749,383.55	3.91
14	002154	报喜鸟	2,238,000.00	9,668,160.00	3.87
15	603529	爱玛科技	156,100.00	8,176,518.00	3.28
16	605007	五洲特纸	405,200.00	7,877,088.00	3.16
17	000729	燕京啤酒	812,800.00	7,851,648.00	3.15
18	300673	佩蒂股份	392,500.00	6,782,400.00	2.72
19	002852	道道全	378,300.00	4,880,070.00	1.96
20	603801	志邦家居	178,400.00	4,813,232.00	1.93
21	688170	德龙激光	4,281.00	201,378.24	0.08
22	688326	经纬恒润	1,290.00	172,950.30	0.07
23	688322	奥比中光	4,461.00	138,246.39	0.06
24	688045	必易微	2,127.00	131,831.46	0.05
25	301139	元道通信	3,051.00	117,341.46	0.05
26	301239	普瑞眼科	2,969.00	99,906.85	0.04
27	688237	超卓航科	2,268.00	93,600.36	0.04
28	688400	凌云光	4,114.00	90,220.02	0.04
29	688207	格灵深瞳	3,125.00	82,437.50	0.03
30	688125	安达智能	1,887.00	81,952.41	0.03
31	688150	莱特光电	4,099.00	80,340.40	0.03
32	301233	盛帮股份	1,576.00	65,435.52	0.03
33	688259	创耀科技	798.00	63,217.56	0.03
34	601089	福元医药	1,749.00	36,816.45	0.01
35	301215	中汽股份	3,357.00	21,451.23	0.01
36	301120	新特电气	990.00	15,335.10	0.01
37	301112	信邦智能	332.00	14,953.28	0.01
38	301122	采纳股份	193.00	13,581.41	0.01
39	301263	泰恩康	405.00	12,708.90	0.01
40	301217	铜冠铜箔	846.00	12,546.18	0.01
41	301259	艾布鲁	483.00	12,046.02	0.00
42	301268	铭利达	339.00	11,820.93	0.00
43	301235	华康医疗	311.00	11,796.23	0.00
44	301256	华融化学	1,144.00	11,531.52	0.00
45	301212	联盛化学	333.00	11,082.24	0.00
46	301153	中科江南	229.00	10,071.42	0.00
47	301137	哈焊华通	609.00	9,737.91	0.00
48	301162	国能日新	178.00	9,631.58	0.00
49	301116	益客食品	469.00	9,595.74	0.00
50	301200	大族数控	183.00	9,501.36	0.00
51	301236	软通动力	302.00	9,476.76	0.00

52	301248	杰创智能	307.00	9,170.09	0.00
53	301288	清研环境	452.00	9,030.96	0.00
54	301103	何氏眼科	281.00	8,997.62	0.00
55	301163	宏德股份	277.00	8,955.41	0.00
56	301130	西点药业	237.00	8,934.90	0.00
57	301206	三元生物	195.00	8,909.55	0.00
58	301216	万凯新材	276.00	8,235.84	0.00
59	301109	军信股份	505.00	8,150.70	0.00
60	301148	嘉戎技术	329.00	7,863.10	0.00
61	301158	德石股份	379.00	7,724.02	0.00
62	301228	实朴检测	373.00	7,586.82	0.00
63	301207	华兰疫苗	134.00	7,560.28	0.00
64	301102	兆讯传媒	243.00	7,554.87	0.00
65	301222	浙江恒威	258.00	7,471.68	0.00
66	301150	中一科技	87.00	7,200.12	0.00
67	301181	标榜股份	235.00	7,188.65	0.00
68	301123	奕东电子	273.00	6,931.47	0.00
69	301258	富士莱	162.00	6,752.16	0.00
70	301151	冠龙节能	305.00	6,545.30	0.00
71	301237	和顺科技	144.00	6,027.84	0.00
72	301279	金道科技	261.00	5,953.41	0.00
73	301219	腾远钴业	65.00	5,708.30	0.00
74	301110	青木股份	136.00	5,419.60	0.00
75	300834	星辉环材	144.00	4,324.32	0.00
76	301196	唯科科技	87.00	3,264.24	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	600702	舍得酒业	20,045,022.00	7.24
2	300841	康华生物	13,574,591.05	4.90
3	601888	中国中免	11,830,052.00	4.27
4	002154	报喜鸟	10,354,501.62	3.74
5	600809	山西汾酒	9,775,185.00	3.53
6	600737	中粮糖业	9,037,515.00	3.26
7	603187	海容冷链	8,998,959.53	3.25
8	603369	今世缘	8,883,465.76	3.21
9	603129	春风动力	8,777,323.80	3.17
10	000998	隆平高科	8,626,533.16	3.11

11	605007	五洲特纸	8,528,682.16	3.08
12	600195	中牧股份	8,150,425.30	2.94
13	300662	科锐国际	7,405,063.00	2.67
14	301089	拓新药业	7,118,641.80	2.57
15	000858	五粮液	6,847,773.63	2.47
16	603658	安图生物	6,175,020.50	2.23
17	601799	星宇股份	5,480,993.00	1.98
18	002867	周大生	5,196,774.00	1.88
19	600600	青岛啤酒	5,141,197.00	1.86
20	603529	爱玛科技	4,944,661.00	1.79

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	000333	美的集团	14,195,501.99	5.13
2	600690	海尔智家	12,788,804.00	4.62
3	000596	古井贡酒	12,313,794.00	4.45
4	603529	爱玛科技	11,875,818.00	4.29
5	600519	贵州茅台	10,758,775.00	3.88
6	603313	梦百合	10,757,623.70	3.88
7	300841	康华生物	9,471,421.00	3.42
8	601689	拓普集团	9,399,396.50	3.39
9	605007	五洲特纸	9,098,255.00	3.28
10	603369	今世缘	8,724,929.00	3.15
11	600737	中粮糖业	8,325,709.00	3.01
12	600963	岳阳林纸	8,231,287.27	2.97
13	002481	双塔食品	8,051,465.70	2.91
14	301089	拓新药业	7,376,169.70	2.66
15	603187	海容冷链	7,225,478.76	2.61
16	000858	五粮液	6,233,239.00	2.25
17	300498	温氏股份	6,003,063.40	2.17
18	603658	安图生物	5,898,719.62	2.13
19	600702	舍得酒业	5,576,699.00	2.01
20	603179	新泉股份	5,465,058.00	1.97

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	227,852,909.91
卖出股票的收入（成交）总额	235,699,805.29

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按

买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,594,526.22	1.04
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,058,561.64	4.03
	其中：政策性金融债	10,058,561.64	4.03
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	12,653,087.86	5.07

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	220301	22 进出 01	100,000	10,058,561.64	4.03
2	019641	20 国债 11	25,330	2,594,526.22	1.04

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 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 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 20 进出 02(200302)中国进出口银行于 2021 年 7 月 16 日收到中国银行保险监督管理委员会出具的处罚（银保监罚决字(2021)31 号）、2022 年 3 月 25 日中国银行保险监督管理委员会出具的银保监罚决字(2022)9 号，主要内容为：

银保监罚决字(2021)31 号：一、违规投资企业股权；二、个别高管人员未经核准实际履职；三、监管数据漏报错报；四、违规向地方政府购买服务提供融资；五、违规变相发放土地储备贷款；六、向用地未获国务院批准的项目发放贷款；七、违规开展租金保理业务变相支持地方政府举债；八、租金保理业务基础交易不真实；九、向租赁公司发放用途不合规的流动资金贷款；十、违规向个别医疗机构新增融资；十一、个别并购贷款金额占比超出监管上限；十二、借并购贷款之名违规发放股权收购贷款；十三、违规向未取得“四证”的固定资产项目发放贷款；十四、违规发放流动资金贷款用于固定资产投资；十五、授信额度核定不审慎；十六、向无实际用款需求的企业发放贷款导致损失；十七、突破产能过剩行业限额要求授信；十八、项目贷款未按规定设定抵质押担保；十九、贷款风险分类不审慎；二十、信贷资产买断业务贷前调查不尽职；二十一、向借款人转嫁评估费用；二十二、同业业务交易对手名单制管理落实不到位；二十三、贸易背景审查不审慎；二十四、对以

往监管通报问题整改不到位。处罚结果为：罚没 7345.6 万元。

银保监罚决字(2022)9 号：一、漏报不良贷款余额 EAST 数据；二、漏报逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据；三、漏报贸易融资业务 EAST 数据；四、漏报贷款核销业务 EAST 数据；五、漏报抵押物价值 EAST 数据；六、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据；七、漏报债券投资业务 EAST 数据；八、漏报权益类投资业务 EAST 数据；九、漏报投资资产管理产品业务 EAST 数据；十、漏报跟单信用证业务 EAST 数据；十一、漏报贷款承诺业务 EAST 数据；十二、未报送委托贷款业务 EAST 数据；十三、EAST 系统分户账与总账比对不一致；十四、漏报分户账 EAST 数据；十五、EAST 系统《对公活期存款分户账明细记录》表错报；十六、EAST 系统《关联关系》表漏报；十七、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报。处罚结果：罚款 420 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	100,184.32
2	应收清算款	-
3	应收股利	50,736.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,534,875.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,685,795.93

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
7,871	20,651.39	30,615,977.91	18.84%	131,931,079.54	81.16%

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	530,753.14	0.33%

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	170,837,202.46
本报告期基金总申购份额	26,687,342.18
减：本报告期基金总赎回份额	34,977,487.19
本报告期基金拆分变动份额	-

本报告期期末基金份额总额	162,547,057.45
--------------	----------------

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，基金管理人、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。

本报告期内，本基金的托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

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	
光大证券	1	143,588,105.51	31.58%	131,401.90	37.15%	-
中信建投证券股份有限公司	2	311,026,217.66	68.42%	222,301.82	62.85%	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券股份	2	-	-	-	-	-

有限公司						
------	--	--	--	--	--	--

注：（1）报告期内租用证券公司交易单元变更情况：

报告期内未新增或停止租用证券公司交易单元。

（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，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	成交金额	占当期回购成交总	成交金额	占当期权证成交总

		额的比例		额的比例		额的比例
光大证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	7,728,992.41	100.00%	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-

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关于旗下基金执行新金融工具相关会计准则的公告	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	2022-01-01
2	光大保德信基金管理有限公司旗下基金 2021 年 12 月 31 日基金份额净值及累计净值公告	同上	2022-01-01
3	光大保德信消费主题股票型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	同上	2022-01-24
4	光大保德信消费主题股票型证券投资基金 2021 年年度报告	同上	2022-03-31
5	光大保德信消费主题股票型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	同上	2022-04-22
6	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	2022-05-20
7	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	2022-05-20
8	光大保德信基金管理有限公司关于终止与北京植信基金销售有限公司销售合作关系的公告	同上	2022-06-11

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

二〇二二年八月三十一日