

# 光大保德信恒利纯债债券型证券投资基金

## 2024 年第 2 季度报告

2024 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：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年七月十九日

## §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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 7 月 18 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 2024 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 光大保德信恒利纯债债券  |
| 基金主代码      | 002523   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2016 年 9 月 2 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 1,007,410,734.04 份   |
| 投资目标       | 在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳定增值。   |
| 投资策略       | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金根据工业增加值、通货膨胀率等宏观经济指标，结合国家货币政策和财政政策实施情况、市场收益率曲线变动情况、市场流动性情况，综合分析债券市场的变动趋势。最终确定本基金在债券类资产中的投资比率，构建和调整债券投资组合。</p> <p>2、目标久期策略及凸性策略</p> |

在组合的久期选择方面，本基金将综合分析宏观面的各个要素，主要包括宏观经济所处周期、货币财政政策动向、市场流动性变动情况等，通过对各宏观变量的分析，判断其对市场利率水平的影响方向和程度，从而确定本基金固定收益投资组合久期的合理范围。并且动态调整本基金的目标久期，即预期利率上升时适当缩短组合久期，在预期利率下降时适当延长组合久期，从而提高债券投资收益。由于债券价格与收益率之间往往存在明显的非线性关系，所以通过凸性管理策略为久期策略补充，可以更好地分析债券的利率风险。凸性越大，利率上行引起的价格损失越小，而利率下行带来的价格上升越大；反之亦然。本基金将通过严格的凸性分析，对久期策略做出适当的补充和修正。

### 3、收益率曲线策略

在确定了组合的整体久期后，组合将基于宏观经济研究和债券市场跟踪，结合收益率曲线的拟合和波动模拟模型，对未来的收益率曲线移动进行情景分析，从而根据不同期限的收益率变动情况，在期限结构配置上适时采取子弹型、哑铃型或者阶梯型等策略，进一步优化组合的期限结构，增强基金的收益。

### 4、信用债投资策略

信用类债券是本基金的重要投资对象，因此信用策略是本基金债券投资策略的重要部分。由于影响信用债券利差水平的因素包括市场整体的信用利差水平和信用债自身的信用情况变化，因此本基金的信用债投资策略可以具体分为市场整体信用利差曲线策略和单个信用债信用分析策略。

#### （1）市场整体信用利差曲线策略

本基金将从经济周期、市场特征和政策因素三方面考量信

用利差曲线的整体走势。在经济周期向上阶段，企业盈利能力增强，经营现金流改善，则信用利差可能收窄，反之当经济周期不景气，企业的盈利能力减弱，信用利差扩大。同时本基金也将考虑市场容量、信用债结构以及流动性之间的相互关系，动态研究信用债市场的主要特征，为分析信用利差提供依据。另外，政策因素也会对信用利差造成很大影响。这种政策影响集中在信用债市场的供给方面和需求方面。本基金将从供给和需求两方面分别评估政策对信用债市场的作用。

本基金将综合各种因素，分析信用利差曲线整体及分行业走势，确定信用债券总的投资比例及分行业的投资比例。

#### （2）单个信用债信用分析策略

信用债的收益率水平及其变化很大程度上取决于其发行主体自身的信用水平，本基金将对不同信用类债券的信用等级进行评估，深入挖掘信用债的投资价值，增强本基金的收益。

本基金主要通过发行主体偿债能力、抵押物质量、契约条款和公司治理情况等方面分析和评估单个信用债券的信用水平：

信用债作为发行主体的一种融资行为，发行主体的偿债能力是首先需要考虑的重要因素。本基金将从行业和企业两个层面来衡量发行主体的偿债能力。A) 行业层面：包括行业发展趋势、政策环境和行业运营竞争状况；B) 企业层面：包括盈利指标分析、资产负债表分析和现金流分析等。

抵押物作为信用债发行时的重要组成部分，是债券持有人分析和衡量该债券信用风险的关键因素之一。对于抵押物质量的考察主要集中在抵押物的现金流生成能力和资产增值能力。抵押物产生稳定现金流的能力越强、资产增值

的潜力越大，则抵押物的质量越好，从而该信用债的信用水平也越高。

契约条款是指在信用债发行时明确规定的，约束和限制发行人行为的条款内容。具体包含承诺性条款和限制性条款两方面，本基金首先分析信用债券中契约条款的合理性和可实施性，随后对发行人履行条款的情况进行动态跟踪与评估，发行人对契约条款的履行情况越良好，其信用水平也越高。

对于通过发行债券开展融资活动的企业来说，该发行人的公司治理情况是该债券维持高信用等级的重要因素。本基金关注的公司治理情况包括持有人结构、股东权益与员工关系、运行透明度和信息披露、董事会结构和效率等。

#### 5、中小企业私募债投资策略

与传统的信用债相比，中小企业私募债券采取非公开方式发行和交易，整体流动性相对较差，而且受到发债主体资产规模较小、经营波动性较高、信用基本面稳定性较差的影响，整体的信用风险相对较高。因此，对于中小企业私募债券的投资应采取更为谨慎的投资策略。本基金认为，投资该类债券的核心要点是对个券信用资质进行详尽的分析，并综合考虑发行人的企业性质、所处行业、资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素，确定最终的投资决策。

#### 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

|                 |  |                    |
|-----------------|--|--------------------|
|                 | <p>支持证券。</p> <p>7、证券公司短期公司债券投资策略</p> <p>本基金将通过对证券行业分析、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。</p> <p>基金投资证券公司短期公司债券，基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。</p> <p>8、杠杆投资策略</p> <p>在本基金的日常投资中，还将充分利用组合的回购杠杆操作，在严格头寸管理的基础上，在资金相对充裕的情况下进行风险可控的杠杆投资策略。</p> |                    |
| 业绩比较基准          | 中证全债指数收益率。   |                    |
| 风险收益特征          | 本基金是债券型基金，长期预期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。  |                    |
| 基金管理人           | 光大保德信基金管理有限公司  |                    |
| 基金托管人           | 兴业银行股份有限公司   |                    |
| 下属分级基金的基金简称     | 光大保德信恒利纯债债券 A  | 光大保德信恒利纯债债券 D      |
| 下属分级基金的交易代码     | 002523   | 018970             |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,060,956.91 份   | 1,006,349,777.13 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                              |
|        | (2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日) |

|                | 光大保德信恒利纯债债券 A | 光大保德信恒利纯债债券 D    |
|----------------|---------------|------------------|
| 1.本期已实现收益      | 9,543.30      | 10,496,955.99    |
| 2.本期利润         | 12,863.00     | 15,110,119.04    |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0154        | 0.0150           |
| 4.期末基金资产净值     | 1,143,619.69  | 1,031,618,966.44 |
| 5.期末基金份额净值     | 1.0779        | 1.0251           |

注：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。上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、光大保德信恒利纯债债券 A:

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | 1.48%      | 0.05%         | 1.92%          | 0.08%                 | -0.44% | -0.03% |
| 过去六个月          | 2.71%      | 0.05%         | 4.31%          | 0.08%                 | -1.60% | -0.03% |
| 过去一年           | 4.03%      | 0.04%         | 6.59%          | 0.07%                 | -2.56% | -0.03% |
| 过去三年           | 10.57%     | 0.07%         | 17.29%         | 0.06%                 | -6.72% | 0.01%  |
| 过去五年           | 17.98%     | 0.07%         | 27.16%         | 0.07%                 | -9.18% | 0.00%  |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 29.64%     | 0.06%         | 39.00%         | 0.07%                 | -9.36% | -0.01% |

##### 2、光大保德信恒利纯债债券 D:

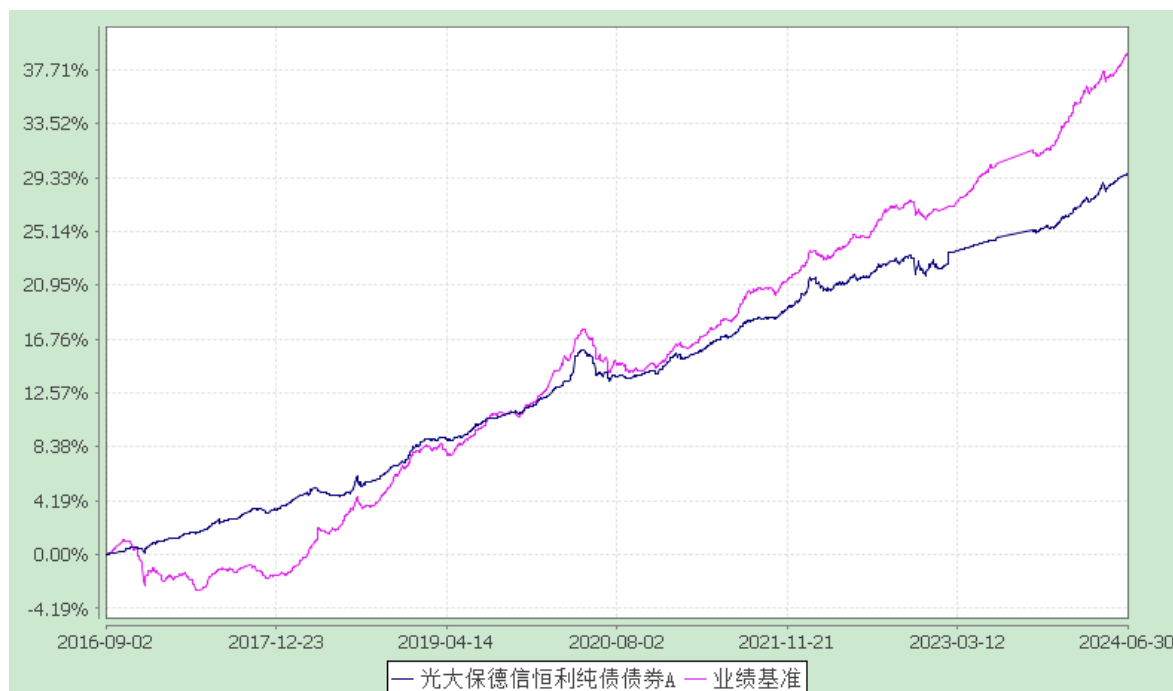
| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | 1.48%      | 0.05%         | 1.92%          | 0.08%                 | -0.44% | -0.03% |
| 过去六个月          | 2.72%      | 0.05%         | 4.31%          | 0.08%                 | -1.59% | -0.03% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 3.42%      | 0.04%         | 6.03%          | 0.07%                 | -2.61% | -0.03% |

#### 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

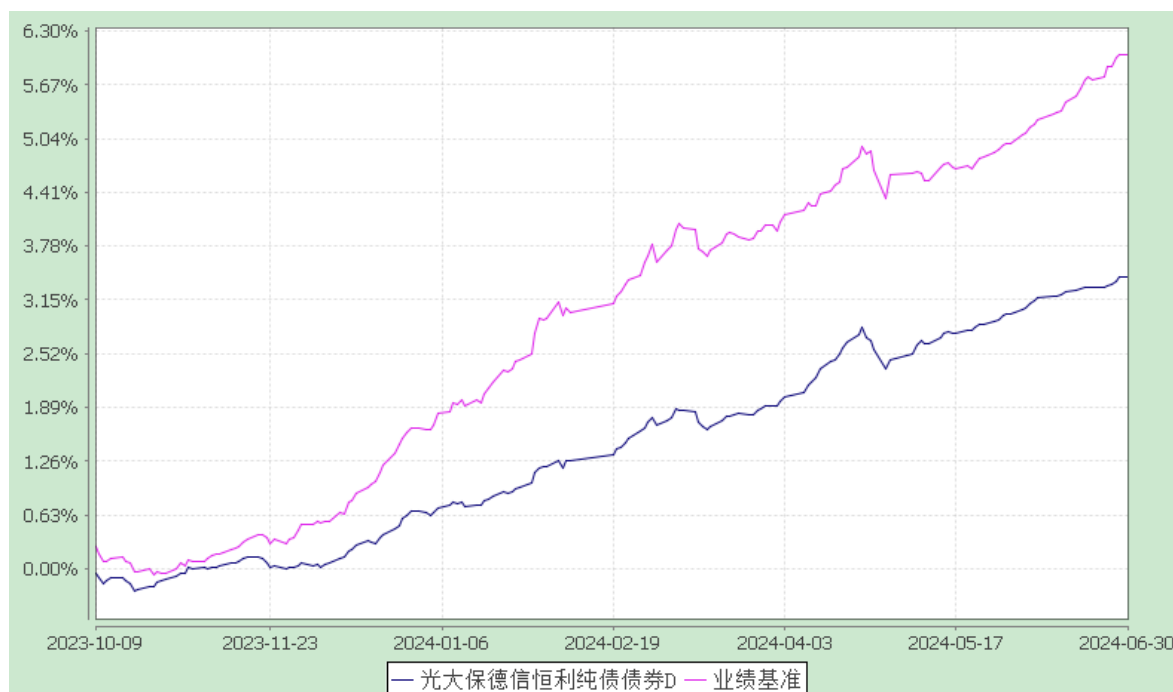
较

光大保德信恒利纯债债券型证券投资基金  
 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  
 (2016 年 9 月 2 日至 2024 年 6 月 30 日)

1. 光大保德信恒利纯债债券 A:



2. 光大保德信恒利纯债债券 D:



注：根据本基金管理人 2023 年 8 月 7 日发布的《关于光大保德信恒利纯债债券型证券投资基



金增设 D 类基金份额并修改基金合同的公告》，自 2023 年 8 月 8 日起，本基金增加 D 类份额。

## §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 |        |  |
| 李怀定 | 固收管理总部固收研究团队联席团队长、基金经理 | 2021-07-10  | -    | 17 年   | 李怀定先生，复旦大学经济学博士学位。2007 年 7 月至 2007 年 11 月任职华泰证券股份有限公司固定收益部；2007 年 11 月至 2009 年 7 月在光大证券股份有限公司担任债券分析师；2009 年 7 月至 2012 年 5 月在国信证券股份有限公司担任经济研究所高级分析师；2012 年 5 月至 2018 年 8 月在汇添富基金管理股份有限公司历任固定收益投资部高级分析师、债券基金经理助理、债券基金经理；2018 年 8 月至 2021 年 5 月在长江养老保险股份有限公司担任养老保障投资部/个人养老金投资部固收投资经理；2021 年 6 月加入光大保德信基金管理有限公司，现任固收管理总部固收研究团队联席团队长，2021 年 7 月至 2024 年 1 月担任光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金（已清盘）的基金经理，2021 年 7 月至今担任光大保德信恒利纯债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、光大保德信尊丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2021 年 7 月至 2023 年 4 月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，2021 年 9 月至 2024 年 1 月担任光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金（已清盘）的基金经理， |

|    |                                    |            |   |     |  |
|----|------------------------------------|------------|---|-----|--|
|    |                                    |            |   |     | <p>2021 年 11 月至今担任光大保德信纯债债券型证券投资基金的基金经理，2021 年 12 月至 2023 年 3 月担任光大保德信裕鑫混合型证券投资基金(已清盘)的基金经理，2022 年 9 月至今担任光大保德信尊颐纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2023 年 6 月至今担任光大保德信睿阳纯债债券型证券投资基金的基金经理，2023 年 7 月至今担任光大保德信荣利纯债债券型证券投资基金的基金经理，2024 年 3 月至今担任光大保德信鼎利 90 天滚动持有债券型证券投资基金的基金经理。</p>   |
| 邹强 | 固收管理总部<br>固收研究团队<br>联席团队长、<br>基金经理 | 2023-06-13 | - | 8 年 | <p>邹强先生，2011 年本科毕业于山东大学数学学院，2014 年获得复旦大学金融学的硕士学位。2014 年 6 月至 2015 年 12 月在国家开发银行工作；2016 年 1 月至 2018 年 7 月在平安养老保险股份有限公司担任宏观及债券策略助理研究员、研究经理；2018 年 7 月加入光大保德信基金管理有限公司，历任债券策略研究员，现任首席宏观债券策略分析师、固收管理总部固收研究团队联席团队长，2020 年 9 月至今担任光大保德信晟利债券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安诚债券型证券投资基金的基金经理，2021 年 6 月至今担任光大保德信永利纯债债券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中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、光大保德信尊泰三年定期开放债券型证券投资基金的基金经理，2022 年 3 月至 2023 年 3 月担任光大保德中短期利率债债券型证券投资基金（已清盘）的基金经理，2022 年 6 月至今担任光大保德信尊利纯债一年定期开放债券型发起式证券</p> |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | 投资基金的基金经理，2023 年 6 月至今担任光大保德信恒利纯债债券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。

#### 4.1.1 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《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规的规定和基金合同、招募说明书等有关法律文件的约定，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。本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，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 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

二季度经济整体呈现总需求相对偏弱、生产相对旺盛、通胀相对低位的局面，背后原因应该是受国际市场需求回升，国内财政产业政策集中发力等影响，但相比而言，二季度内需复苏仍相对缓慢，居民消费仍偏保守、地产投资增速有所下降、基建投资总体进度较慢。4 月政治局会议

提出加快财政支出力度、地产去库存等，并陆续出台了相关具体政策。但整体而言，政策效果得到完全反映仍需一定时间。

债券市场方面，二季度债券市场收益率整体呈现缓慢下行趋势，3 月底 4 月初和 4 月底债券收益率两度出现快速上行，随后经济回升和信贷需求有待提升、机构配置需求较大以及市场风险偏好下修背景下，各类品种收益率延续 2023 年末以来的下行趋势，其中信用债整体表现好于利率债，长久期利率债收益率也出现下行。

我们维持一季报的观点，尽管多项货币、财政以及地产政策陆续出台，但经济基本面回升仍相对温和，在多种外部因素叠加背景下，债券收益率中枢仍有进一步下行的空间，但因为当前绝对收益率水平较低，整体下行幅度可能会小于 2023 年。

组合操作方面，二季度组合整体操作比较积极，期间对组合持仓结构进行了优化，在短久期信用债和中短久期信用债之间作了些许调整，但债券仓位、组合久期等关键指标与一季度变化不大。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内光大保德信恒利纯债债券 A 份额净值增长率为 1.48%，业绩比较基准收益率为 1.92%；光大保德信恒利纯债债券 D 份额净值增长率为 1.48%，业绩比较基准收益率为 1.92%。

#### 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   | -                | -            |
|    | 其中：股票  | -                | -            |
| 2  | 固定收益投资 | 1,394,494,377.57 | 99.90        |
|    | 其中：债券  | 1,394,494,377.57 | 99.90        |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
|   | 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      | 1,357,829.97     | 0.10   |
| 7 | 其他各项资产            | 1,710.72         | 0.00   |
| 8 | 合计                | 1,395,853,918.26 | 100.00 |

## 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 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      | -              | -            |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 236,147,422.68 | 22.87        |
|    | 其中：政策性金融债 | 154,105,842.43 | 14.92        |
| 4  | 企业债券      | 204,045,820.70 | 19.76        |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | 891,809,693.09 | 86.35        |
| 7  | 可转债（可交换债） | -              | -            |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |

|    |    |                  |        |
|----|----|------------------|--------|
| 9  | 其他 | 62,491,441.10    | 6.05   |
| 10 | 合计 | 1,394,494,377.57 | 135.03 |

### 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  | 240410    | 24 农发 10       | 700,000 | 71,252,328.77 | 6.90         |
| 2  | 200203    | 20 国开 03       | 600,000 | 61,420,049.18 | 5.95         |
| 3  | 102280728 | 22 嘉兴高新 MTN001 | 600,000 | 61,133,944.11 | 5.92         |
| 4  | 102101320 | 21 江北建投 MTN002 | 500,000 | 51,640,508.20 | 5.00         |
| 5  | 2221044   | 22 顺德农商小微债 02  | 500,000 | 51,444,808.74 | 4.98         |

### 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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于股指期货。

### 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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

#### 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。

### 5.10.3 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。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 前十名证券中，22 农业银行二级 01(2228041.IB)的发行主体中国农业银行股份有限公司于 2023 年 8 月 18 日收到国家金融监督管理总局出具的行政处罚（金罚决字[2023]8 号）、于 2023 年 11 月 16 日收到国家金融监督管理总局的行政处罚（金罚决字〔2023〕21 号）、于 2023 年 11 月 17 日收到国家外汇管理局北京市分局出具的行政处罚（京汇罚〔2023〕32 号）。

基金管理人按照内部研究工作规范对以上证券进行分析后将其列入基金投资对象备选库并跟踪研究。以上处罚事件发生后，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。除上述证券发行主体外，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公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 本基金未投资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   | 1,710.72 |
| 2  | 应收证券清算款 | -        |
| 3  | 应收股利    | -        |
| 4  | 应收利息    | -        |
| 5  | 应收申购款   | -        |
| 6  | 其他应收款   | -        |
| 7  | 待摊费用    | -        |
| 8  | 其他      | -        |
| 9  | 合计      | 1,710.72 |

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目             | 光大保德信恒利纯债债   | 光大保德信恒利纯债债       |
|----------------|--------------|------------------|
|                | 券A           | 券D               |
| 本报告期期初基金份额总额   | 783,714.21   | 1,006,349,777.13 |
| 报告期期间基金总申购份额   | 360,894.80   | -                |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 83,652.10    | -                |
| 报告期期间基金拆分变动份额  | -            | -                |
| 本报告期期末基金份额总额   | 1,060,956.91 | 1,006,349,777.13 |

### §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

| 投资者类别   | 报告期内持有基金份额变化情况 |                        |                  |      |      | 报告期末持有基金情况       |        |
|---|----------------|------------------------|------------------|------|------|------------------|--------|
|   | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额             | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额             | 份额占比   |
| 机构  | 1              | 20240401-20240630      | 1,006,349,777.13 | 0.00 | 0.00 | 1,006,349,777.13 | 99.89% |
| 产品特有风险  |                |                        |                  |      |      |                  |        |
| 本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过20%的情形，可能面临单一投资者集中赎回的情况，从而： |                |                        |                  |      |      |                  |        |
| (1) 对基金的流动性造成冲击，存在对剩余投资者的赎回办理造成影响的风险。               |                |                        |                  |      |      |                  |        |



(2) 基金管理人因基金赎回的流动性要求致使部分投资受到限制，或因赎回费归入基金资产等原因，而导致基金资产净值波动的风险，影响基金的投资运作和收益水平。

(3) 因基金资产规模过小，而导致部分投资不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略，或导致基金不能满足存续条件的风险。

本管理人将审慎评估大额申购对基金持有集中度的影响，在运作中保持合适的流动性水平，保护持有人利益。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本报告期内，经公司十一届十五次董事会会议审议通过，自 2024 年 6 月 11 日起，龚俊涛先生正式担任公司副总经理兼首席市场总监。

2、从 2024 年三季度开始，我公司旗下公募基金连续 60 个工作日低于 5000 万或客户数少于 200 人（不含发起式基金）的迷你基金，信息披露费、审计费、基金份额持有人大会费、银行间账户维护费、IOPV 计算与发布费、注册登记费等各类固定费用均由公司承担。若产品规模再次回到 5000 万以上后，不符合迷你基金条件时，上述固定费用恢复由基金资产承担。

## 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恒利纯债债券型证券投资基金设立的文件
- 2、光大保德信恒利纯债债券型证券投资基金基金合同
- 3、光大保德信恒利纯债债券型证券投资基金招募说明书
- 4、光大保德信恒利纯债债券型证券投资基金托管协议
- 5、光大保德信恒利纯债债券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恒利纯债债券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

二〇二四年七月十九日