

光大保德信均衡精选混合型证券投资基金  
2023 年年度报告  
2023 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年三月二十九日

## §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。本年度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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 28 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。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
<b>§2 基金简介</b>	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	10
2.4 信息披露方式	11
2.5 其他相关资料	11
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	11
3.1 主要会计数据和财务指标	11
3.2 基金净值表现	13
3.3 过去三年基金的利润分配情况	16
<b>§4 管理人报告</b>	16
4.1 基金管理人及基金经理情况	16
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	18
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	18
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	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	20
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	20
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	21
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	22
4.9 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	22
<b>§5 托管人报告</b>	22
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	22
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	23
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	23
<b>§6 审计报告</b>	23
6.1 审计意见	23
6.2 形成审计意见的基础	23
6.3 其他信息	23
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	24
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	24
<b>§7 年度财务报表</b>	25
7.1 资产负债表	25
7.2 利润表	26
7.3 净资产变动表	27
7.4 报表附注	29
<b>§8 投资组合报告</b>	57
8.1 期末基金资产组合情况	57
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	58
8.3 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	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	66
8.6 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 .....	66
8.7 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 .....	66
8.8 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 .....	67
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细 .....	67
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	67
8.11 本基金投资股指期货的投资政策 .....	67
8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	67
8.13 投资组合报告附注 .....	67
<b>§9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>68</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	68
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	69
9.3 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 .....	69
<b>§10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>69</b>
<b>§11 重大事件揭示</b> .....	<b>70</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	70
11.2 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 .....	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	70
11.4 基金投资策略的改变 .....	70
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	70
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	70
11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	70
11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	71
11.9 其他重大事件 .....	74
<b>12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>75</b>
<b>§13 备查文件目录</b> .....	<b>76</b>
13.1 备查文件目录 .....	76
13.2 存放地点 .....	76
13.3 查阅方式 .....	76

## §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金名称	光大保德信均衡精选混合型证券投资基金	
基金简称	光大保德信均衡精选混合	
基金主代码	360010	
交易代码	360010	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 3 月 4 日	
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	51,358,392.11 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	光大保德信均衡精选混合 A	光大保德信均衡精选混合 C
下属分级基金的交易代码	360010	019234
报告期末下属分级基金的份额总额	51,290,691.34 份	67,700.77 份

## 2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于具备优良成长前景且估值水平相对合理或被低估的上市公司股票，实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金将通过选择具备优良成长前景且价格合理或被低估的上市公司股票，以期实现基金资产的长期稳健增值。</p> <p>本基金将主要采用“自下而上”的资产配置策略，以精选个股为主，兼顾股票资产在行业间的合理配置；在形成最终股票投资组合后，本基金还将根据宏观经济及证券市场状况确定大类证券资产的配置比例。</p> <p>1. 股票投资策略</p> <p>本基金主要选取国际上普遍采用的 GARP（Growth At Reasonable Price，以合理的价格增长）选股模型进行个股的选择。该模型通过建立统一的</p>

价值评估框架，综合考虑上市公司的增长潜力和市场估值水平，以寻找具有增长潜力且价格合理或被低估的股票。GARP 强调对上市公司盈利增长和市场估值水平进行综合考量，而不仅仅关注股票估值的绝对水平抑或上市公司的增长水平。因此，传统意义上的价值型股票和成长型股票都将纳入 GARP 模型的评估框架，使得本基金可以在最大范围内发现具有投资价值的股票。

具体来说，本基金将通过三个步骤完成最终投资组合的构建：

第一步，通过将本管理人全局备选库中的上市公司财务数据输入到本基金构建的 GARP 模型中，对上市公司的投资价值进行初步排序，形成本基金的初选股票池。具体来说，初选股票池的构建程序和主要标准如下：

(1)、投资研究团队构建公司全局备选库；

全局备选库由公司投资研究团队负责建立和维护。投资研究团队通过对上市公司进行财务报表分析，参加上市公司管理层业绩交流会议，对行业运营状况进行跟踪，分析预测上市公司的经营情况和未来盈利前景。在此基础上，研究人员编写研究报告，履行股票入库审批程序，将股票加入到公司全局备选库中。对于全局备选库中的股票，研究团队将保持密切跟踪，通过口头或书面报告的形式将最新信息及时反馈至投资团队，并更新到公司投资研究平台。

全局备选库中将剔除过去一年内存在重大管理及经营问题（如亏损，管理层不稳定，存在违法违规行为等）的上市公司。

(2)、数量研究小组对全局备选库中的上市公司按照 GARP 模型进行评分；

数量研究小组对全局备选库中的上市公司，按照 GARP 模型进行评分，对上市公司的投资价值进行排序。输入 GARP 模型的数据主要包括全局备选库中上市公司的行情数据、历史财务数据以及未来两年的复合盈利增长率预测数据。

本基金构建的 GARP 模型涉及到的指标主要有 PEG, PE, ROE, PC 等。PEG 指标是 GARP 模型最重要的指标。该指标综合考虑了上市公司的估值水平与盈利成长能力。在考察上市公司的盈利成长能力方面，采用上市公司未来两年预测的复合年盈利增长率。

PE 指标是 GARP 模型的另一个重要指标。采用该指标是为了在一定程度上规避绝对估值水平过高的公司：其中一类公司，是某些处于新兴行业高速成长期的上市公司，因为盈利基数较小，其未来两年盈利成长水平可能非常之高，但该增长并不具有持续性；另外一类公司，是因行业景气度好转或管理改善而扭亏为盈的上市公司，其近期的盈利增长水平可能也会非常高，但也不具有可持续性。如果单纯按照 PEG 对该两类上市公司进行估值，会高估其成长的价值；一旦行业进入稳定成长期或通过管理改善经营业绩的边际效应变小，其合理估值将出现严重下滑。

ROE 和 PC 指标，是 GARP 模型的两个辅助指标。该两个指标均采用历史数据，分别用来衡量上市公司的运营效率和盈利质量。

本基金将根据实际情况以及证券市场状况增加 GARP 模型涉及到的指标及调整相应的权重。

(3)、选取得分前 80% 的股票；

对于全局备选库中的上市公司，在前述 GARP 模型评分的基础上，按照得分由大到小的顺序，选取得分为前 80% 的股票。

(4)、剔除流通市值过小的股票；

在第(3)步的基础上，剔除流通市值过小的股票，以便于基金投资组合的构建。本基金所指流通市值过小是指对所有 A 股股票，按照流通市值由大到小排序，排名在后 5% 且在前述第(3)步中的股票。

自此，本基金初选股票池构建完成。

(5)、基金初选股票池的更新。

公司全局备选库由投资研究团队进行日常的维护更新。每月的月末，金融工程团队重复如上第(2)至第(5)步，进行基金初选股票池的更新。

GARP 模型将筛选出股价未能合理反映上市公司成长性的股票，但股价回归合理价值需要一定因素的催化。本基金在实际投资运作中，将结合被低估上市公司的有利信息发布（如宏观政策、行业政策或公司行为）、分析师对公司的关注度及投资评级、股票价格走势与成交量等因素判断该类股票的上涨时机。当上述因素出现有利于推动市场对该类公司的认知转变时，基金将买入股票；当上市公司的成长价值得到充分反映，GARP 模型也将自动向下调整该类公司的得分和排名，本基金将结合市

场情绪和流动性状况择机卖出该类股票。

第二步，基金经理和研究员通过调研分析，对全局备选库（以初选股票池为重点）中的股票进行基本面分析，包括财务分析（经营能力分析、偿债能力分析、盈利能力分析）、公司治理结构、经营战略、公司竞争优势（如垄断，资源等），并购重组机会等方面以克服纯量化方法无法充分反映公司未来预期因素的弊端，由此形成本基金的核心股票池。其中，核心股票池中的股票数量应保证至少有 80%来自于上述 GARP 模型筛选后得到的初选股票池。

第三步，本基金将通过行业分析并考虑基金资产规模等因素形成最终股票投资组合，最终股票投资组合必须全部来自核心股票池。本基金将通过分析行业景气度，行业竞争状况，行业风险，行业整体估值水平等多方面的因素，使最终股票投资组合尽可能最优地配置于各个行业之间。其中，行业景气度分析将通过价值链下端需求分析，价值链上端供应分析对目标行业所处生命周期及行业的景气情况进行判定，本基金将重点投资于处于增长或者成熟的行业；行业竞争分析将从三个角度进行：（1）通过市场份额结构分析进行行业集中度分析，初步判断行业内部竞争激烈程度；（2）对行业所处价值链的位置、价值链上下端以及行业内部公司的合作程度等方面进行分析，以确定行业的价值来源和增值潜力；（3）对行业内部公司采取的竞争策略进行判别和分析，如采用降低成本、产品差异化，并对它们的策略进行评估；本基金将选用国际上普遍采用的“Porter 五因素”分析方法对行业风险进行分析。五个因素分别为：买方议价能力，卖方议价能力，行业进入壁垒，行业竞争情况以及产品替代风险。在对行业进行以上分析的基础上，本基金将通过行业估值水平的国际比较和国内市场行业之间的比较，将基金资产配置于估值相对合理或被低估的行业上。

此外，考虑到一、二级市场的价差带来的套利机会，本基金将在分析新发行股票内在价值的基础上、在基金合同规定的额度内适度参与新股申购，为投资者获取稳定的套利回报。

## 2. 固定收益证券投资策略

本基金将根据预期收益和风险的动态变动关系将部分基金资产适度配置



于固定收益类证券上。本基金可以投资的固定收益证券包括国债，金融债，企业债，央行票据，回购，资产支持证券（ABS）等。

本基金将主要采用宏观分析和微观定价两个方面进行固定收益类证券投资组合的构建。

宏观层面主要关注影响债券收益率水平的各个因素，包括经济所处周期，货币政策取向，广义货币供应量（M2）变动等，通过对这些宏观变量的分析，定性的判断它们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；在确定固定收益投资组合的具体品种时，本基金将根据光大保德信独立开发的固定收益证券定价系统，对各个目标投资对象进行利差分析，包括信用利差，流动性利差，期权调整利差（OAS），并利用利率模型对利率进行模拟预测，选出定价合理或被低估，到期期限符合组合构建要求的固定收益品种。

### 3. 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。

### 4. 资产配置策略

在构建最终股票投资组合以及固定收益证券投资组合的同时，本基金还将通过深入分析宏观经济和政策环境，把握中国资本市场的变化趋势，结合定性分析和定量分析进行大类资产的配置。

具体来说，资产配置分为两部分：战略性资产配置以及战术性资产配置。本基金将通过分析经济周期的变化，产业结构的变迁以及各行业价值链的演变，结合资本市场制度因素（包括流动性、市场交易方式创新、上市公司透明度等）确定大类资产的战略配置比例范围。战略资产配置比例为本基金在中长期内确立的基准大类资产配置比例。

本基金也将根据对各类资产市场的估值变动、各行业的盈利变化、市场利率的短期趋势分析和判断以及对国家金融经济主管部门的政策措施及政策取向（包括货币政策、财政政策、产业政策等）的跟踪分析，在中短期内对大类资产进行偏离基准的战术性资产配置，以求获取超额收益或者降低投资风险。

### 5. 权证及其他品种投资策略

	<p>将根据基金管理人对权证价值的判断，在进行充分风险控制和遵守中国证监会相关法律法规的基础上，适当投资于权证，为基金持有人谋求收益，降低风险。</p> <p>同时，法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，如股指期货，本基金若认为有助于基金进行风险管理和组合优化的，将进行适度投资。本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则，根据证券市场实际情况对上述投资策略及投资组合构建流程进行非实质性的调整，此类变更不需经过基金份额持有人大会通过。</p>
业绩比较基准	75%×沪深 300 指数收益率+25%×中证全债指数收益率。
风险收益特征	本基金为主动操作的混合型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金及债券型基金，但低于股票型基金。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高顺平	王小飞
	联系电话	(021) 80262888	021-60637103
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		4008-202-888	021-60637228
传真		(021) 80262468	021-60635778
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	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200010	100033
法定代表人		刘翔	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.epf.com.cn
基金年度报告备置地点	光大保德信基金管理有限公司、中国建设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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2023 年		2022 年		2021 年	
	光大保德信 均衡精选混 合 A	光大保德信 均衡精选混 合 C	光大保德信 均衡精选混 合 A	光大保德信 均衡精选混 合 C	光大保德信 均衡精选混 合 A	光大保德信均 衡精选混合 C
本期已 实现收 益	-5,120,035. 63	-1,351.12	-16,331,339.7 5	-	-10,506,544.4 6	-
本期利 润	-6,321,062. 40	-1,321.63	-13,692,546.3 3	-	-13,502,659.5 2	-
加权平 均基金 份额本	-0.1219	-0.0595	-0.3619	-	-0.3485	-

期利润						
本期加 权平均 净值利 润率	-16.33%	-8.78%	-39.24%	-	-25.86%	-
本期基 金份额 净值增 长率	-14.54%	-9.59%	-33.06%	-	-23.29%	-
<b>3.1.2 期末</b>	<b>2023 年末</b>		<b>2022 年末</b>		<b>2021 年末</b>	
<b>数据和指 标</b>	光大保德信均 衡精选混合 A	光大保德信均 衡精选混合 C	光大保德信均 衡精选混合 A	光大保德信均 衡精选混合 C	光大保德信均 衡精选混合 A	光大保德信均 衡精选混合 C
期末可 供分配 利润	-17,374,402 .95	-23,014.61	-9,051,133.16	-	5,151,615.75	-
期末可 供分配 基金份 额利润	-0.3387	-0.3399	-0.2262	-	0.1559	-
期末基 金资产 净值	33,916,288. 39	44,686.16	30,963,033.1 4	-	38,187,426.2 0	-
期末基 金份额 净值	0.6613	0.6601	0.7738	-	1.1559	-
<b>3.1.3 累计 期末指标</b>	<b>2023 年末</b>		<b>2022 年末</b>		<b>2021 年末</b>	
	光大保德信 均衡精选混 合 A	光大保德信 均衡精选混 合 C	光大保德信 均衡精选混 合 A	光大保德信 均衡精选混 合 C	光大保德信 均衡精选混 合 A	光大保德信均 衡精选混合 C
基金份	7.87%	-9.59%	26.21%	-	88.54%	-

额 累 计 净 值 增 长 率						
-----------------------	--	--	--	--	--	--

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

##### 1. 光大保德信均衡精选混合 A:

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
过去三个月	-7.32%	0.86%	-4.93%	0.59%	-2.39%	0.27%
过去六个月	-10.90%	0.79%	-7.56%	0.63%	-3.34%	0.16%
过去一年	-14.54%	0.81%	-7.33%	0.63%	-7.21%	0.18%
过去三年	-56.11%	1.52%	-23.64%	0.83%	-32.47%	0.69%
过去五年	-29.05%	1.44%	18.53%	0.91%	-47.58%	0.53%
自基金合同生效起至今	7.87%	1.45%	78.92%	1.07%	-71.05%	0.38%

##### 2. 光大保德信均衡精选混合 C:

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
过去三个月	-7.46%	0.87%	-4.93%	0.59%	-2.53%	0.28%
自基金合同生效起至今	-9.59%	0.81%	-6.91%	0.59%	-2.68%	0.22%

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建设银行股份有限公司协商一致，自 2014 年 1 月 1 日起，将本基金的业绩比较基准由原“75%×沪深 300 指数收益率+25%×天相国债全价指数收益率”变更为“75%×沪深 300 指数收益率+25%×中证全债指数收益率”，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

### 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

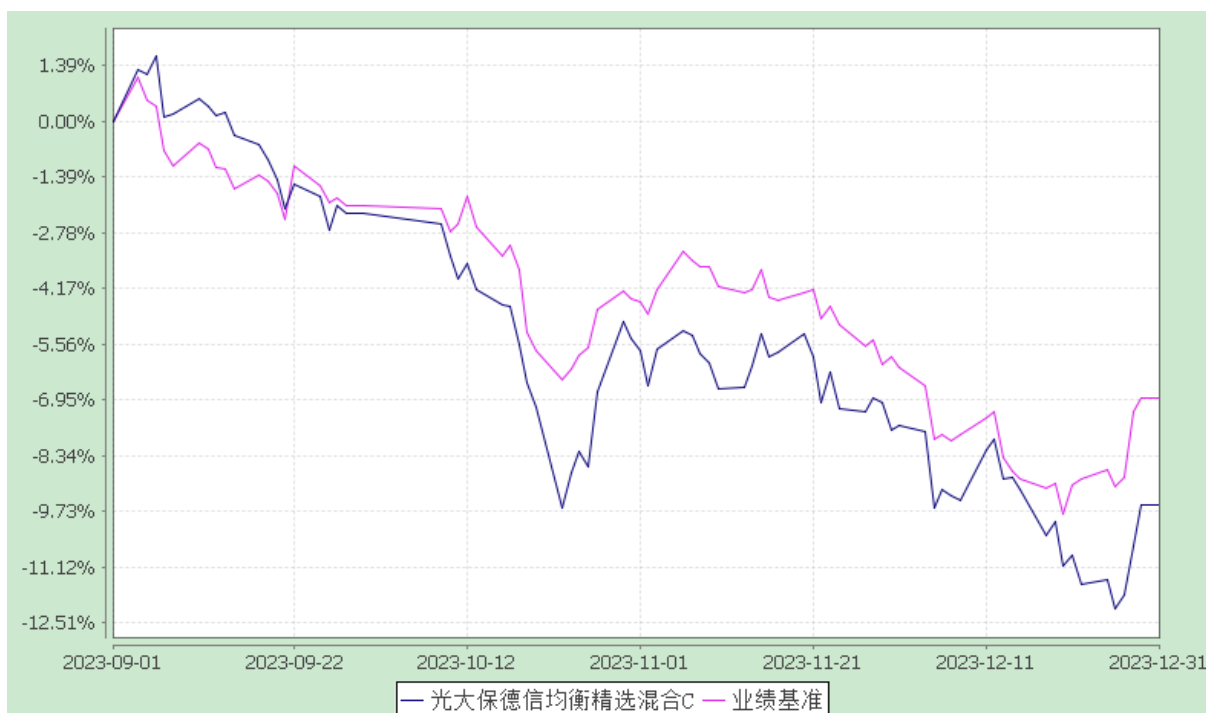
#### 光大保德信均衡精选混合型证券投资基金

自基金合同生效以来份额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  
(2009年3月4日至2023年12月31日)

#### 1、光大保德信均衡精选混合 A



#### 2、光大保德信均衡精选混合 C

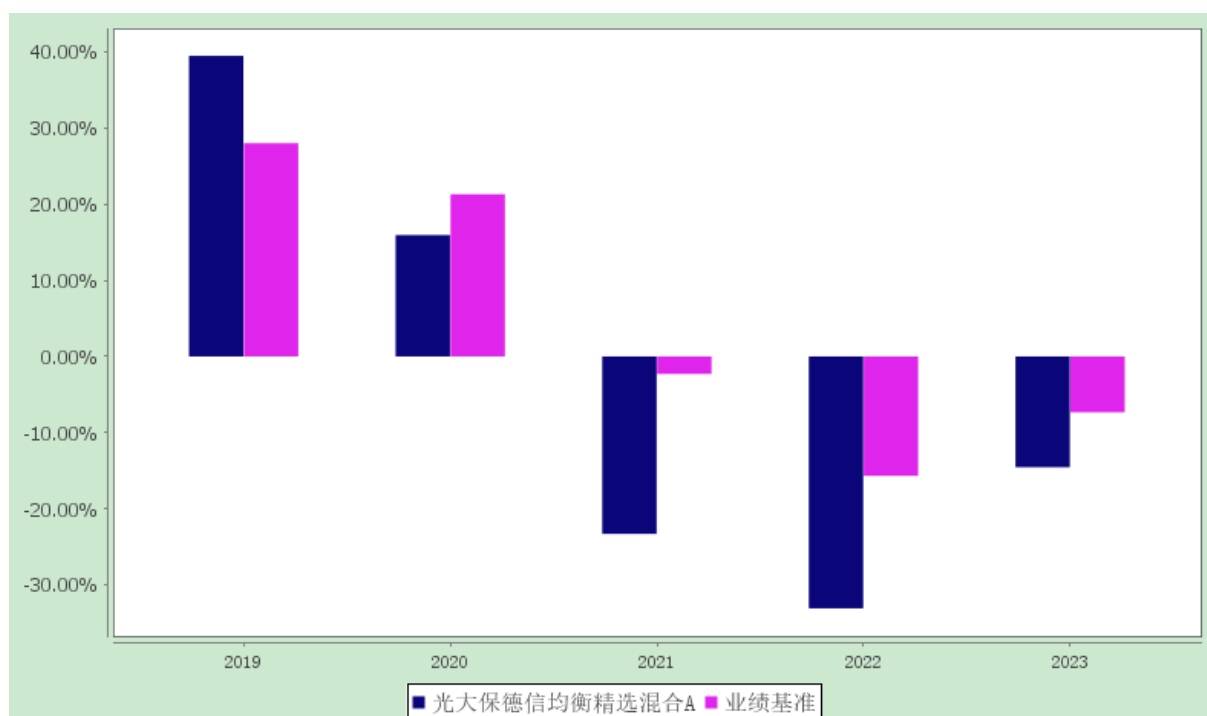


注：本基金 C 类份额设立于 2023 年 9 月 1 日。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

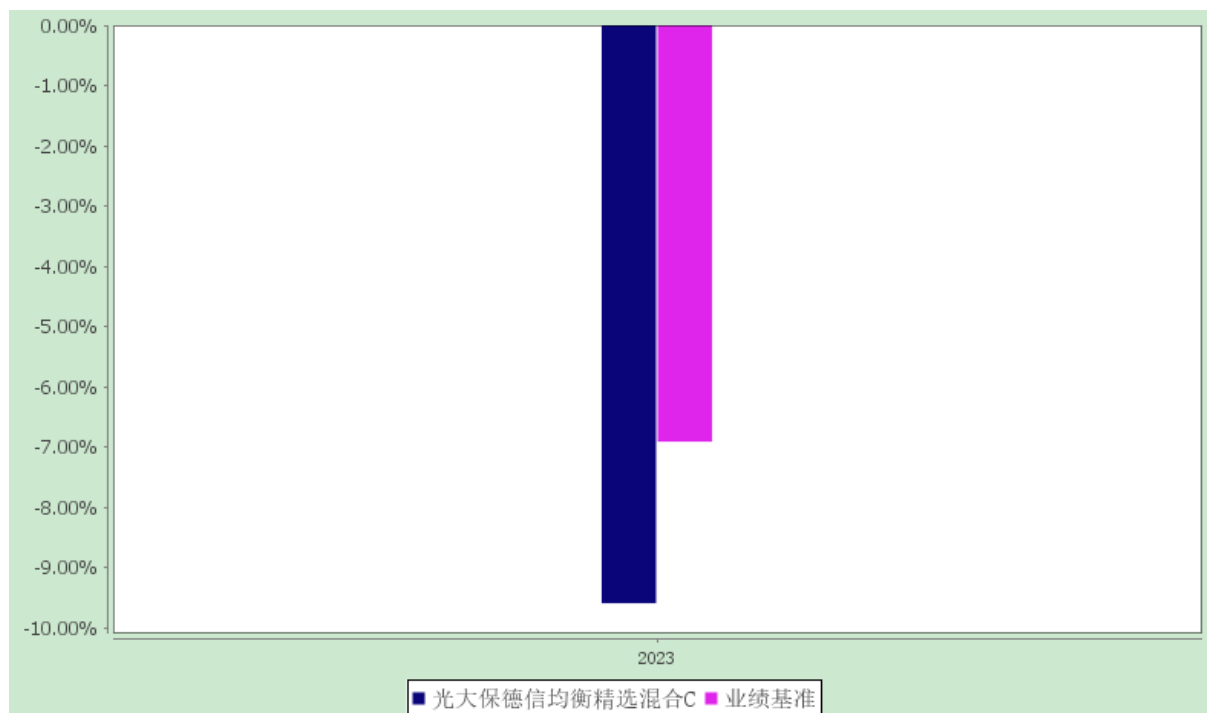
光大保德信均衡精选混合型证券投资基金  
过去五年净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

#### 1、光大保德信均衡精选混合 A



注：本基金基金合同于 2009 年 3 月 4 日生效，合同生效当年净值收益率按实际存续期计算，未按整个自然年度折算。

#### 2、光大保德信均衡精选混合 C



注：本基金基金合同于 2023 年 9 月 1 日生效，合同生效当年净值收益率按实际存续期计算，未按整个自然年度折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## §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 2023 年 12 月 31 日，光大保德信旗下管理着 69 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



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、光大保德信恒利纯债债券型证券投资基金、光大保德信诚鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信安和债券型证券投资基金、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、光大保德信汇佳混合型证券投资基金、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、光大保德信高端装备混合型证券投资基金、光大保德信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、光大保德信荣利纯债债券型证券投资基金、光大保德信专精特新混合型证券投资基金、光大保德信睿阳纯债债券型证券投资基金、光大保德信数字经济主题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		
苏淼	基金经理	2022-10-01	-	13 年	苏淼先生，东南大学管理学硕士。2010 年 5 月至 2011 年 12 月在国联证券股份有限公司任职分析师；2012 年 1 月至 2015 年 2 月在山西证券股份有限公司任职分析师；2015 年 3 月至 2017 年 4 月在国信证券股份有限公司任职分析师；2017 年 5 月加入光大保德信基金管理有限公司，历任权益管理总部股票研究团队高级研究员，2022 年 10 月至今担任光大保德信均衡精选混合型证券投资基金的基金经理，2023 年 2 月至 2023 年 7 月担任光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金（已清盘）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。本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 公平交易制度和控制方法**

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《光大保德信基金管理有限公司公平交易制度》，明确公平交易的适用范围、原则和内容、管控措施、公平交易执行程序 and 分配原则、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）、境外投资、衍生品等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。

公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时通过实时监控、分析评估、监察稽核和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

分析评估方面，公司采集连续四个季度，不同时间窗口（1 日内、3 日内、5 日内）的同向交易样本，在假设同向交易价差为零及 95% 的置信水平下，对同向交易价差进行 T 分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析。通过对涉及公平性交易的投资行为进行事后分析评估，分析对象涵盖公司旗下全部投资组合，并重点分析同类组合间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为。若出现异常交易行为，则及时进行核查并在向中国证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。在同向交易价差分析中，个别投资组合之间出现溢价率统计显著主要原因是市场交易价格波动较大且不同基金经理交易时机的选择不同，本基金管理人旗下所有投资组合从投资信息的获取、投资决策到交易执行的各个环节均按照公平交易制度的要求进行，未发现存在违反公平交易原则的现象。

#### 4.3.3 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。本基金与公司旗下其他投资组合在交易所市场未发生较少单边成交量大于 5% 的同日反向交易。

### 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

2023 年年初，国内服务消费快速复苏，地产相关行业出现了经营改善的迹象，市场对于经济回暖的预期非常高，2 季度，随着补库存的结束，经济复苏的力度逐步放缓，市场对于复苏的力度开始出现了分歧。下半年，面对国内需求的现状，支持经济发展的各项政策陆续出台，政治局会议也指出地产市场供求关系发生重大变化，适时调整优化房地产政策，随后各省市的地产政策也出现了一定程度的放松，2023 年 GDP 全年实际增速为 5.2%。

2023 年本基金较为关注资源、周期和新材料等领域，在进口替代和自主可控的大背景下，新材

料行业的细分优秀企业的投资前景值得关注，煤炭、原油的价格基本保持稳定，能源类公司的资本开支相对比较少，分红比较稳定，高股息率的公司得到市场的持续关注，化工、建材等周期类行业主要是跟踪行业景气度的边际变化情况，结合估值、景气度和管理层的治理水平，适当关注竞争优势明显的优质公司的投资机会。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内光大保德信均衡精选混合型 A 份额净值增长率为-14.54%，业绩比较基准收益率为-7.33%，光大保德信均衡精选混合型 C 份额净值增长率为-9.59%，业绩比较基准收益率为-6.91%。

#### 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 2024 年，中央经济工作会议指出高质量发展是新时代的硬道理，在经济回升向好的基础上，坚持稳中求进、以进促稳、先立后破，经济增速或与 2023 年基本持平。投资方面，中央政府或是未来投资边际增量的主要来源于，消费方面，家电、汽车的以旧换新是扩大消费的主要发力点，科技方面，科技创新是实现高质量发展的第一动力，积极培育战略性新兴产业是未来政策支持的主要方向。对于股票市场而言，经济弱复苏到复苏启动阶段，长期经营稳定、分红回报比较高的资产超额收益会比较明显，另一方面，业绩增长稳定、估值合理、竞争优势明显的成长股始终是市场寻找和配置的方向。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在开展内部监察稽核工作时本着合规运作、防范风险、保障基金份额持有人利益的宗旨，由独立于各业务部门的督察长和监察稽核部、风险管理部对公司的经营管理、基金的投资运作、基金的销售等公司所有业务及员工行为规范等方面进行定期和不定期检查，及时发现问题并督促相关部门进行整改，并定期制作监察稽核报告报董事会和公司管理层。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面：

督察长和监察稽核部督促、协助各业务部门按照法律法规和监管机构规定对相关制度的合法性、规范性和时效性完善各项内部管理制度和业务流程，明确风险控制职责并具体落实相应措施，提高全体员工的风险意识，有效保障基金份额持有人的利益。

督察长和监察稽核部、风险管理部针对各部门具体业务建立了相应的检查指标及检查重点，通过现场检查、电脑监控、人员询问、重点抽查等一系列方法，定期对公司和基金日常运作的各项业

务进行合法合规检查，并对基金投资交易行为过程实施实时监控，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理，并按规定定期出具合规风控工作情况报告报送董事会和公司管理层。

根据中国证监会的规定，督察长和监察稽核部及时准确地向监管机关报送各项报告，并对公司所有对外信息，包括基金法定信息披露、基金产品宣传推介材料等的合法合规情况进行事前审阅，确保其内容真实、准确、完整并符合中国证监会的相关规定。督察长和监察稽核部组织、协调各相关部门及时完成信息披露，确保公司的信息披露工作严格按照中国证监会规定的时间和方式进行。

在全公司范围内开展持续的学习和培训。督察长和监察稽核部先后组织了新员工入司培训，对相关人员进行法律法规的专项培训和年度监察培训，并组织员工开展学习、讨论，提高和加深了公司员工对基金法律法规的认识和理解，明确风险控制职责，树立全员内控意识。

根据董事会和管理层的要求，以及法规要求和公司业务发展的需要，督察长和监察稽核部以风险为导向，年内计划并实施了数个内部专项审计项目，及时发现潜在的问题和风险，对公司重要业务环节剔除流程改进建议，促使公司规范运作。

通过上述工作，在本报告期内，本基金管理人对本基金的管理始终按照法律法规、基金合同、招募说明书和公司制度进行，充分维护和保障了基金持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用资金资产，以风险控制为核心，进一步提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 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验，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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 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

本基金本报告期内出现了连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况，该情况自 2021 年 10 月 8 日起出现。本基金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的情形。

本报告期内，本基金存在连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。针对该情形，本基金管理人已向中国证监会报告了解决方案。

## §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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、

基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

## 5.3 托管人对本年度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。

## §6 审计报告

安永华明（2024）审字第 70072552\_B09 号

光大保德信均衡精选混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

我们审计了光大保德信均衡精选混合型证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的光大保德信均衡精选混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了光大保德信均衡精选混合型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

### 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于光大保德信均衡精选混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 其他信息

光大保德信均衡精选混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

#### 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估光大保德信均衡精选混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督光大保德信均衡精选混合型证券投资基金的财务报告过程。

#### 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对光大保德信均衡精选混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不



确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致光大保德信均衡精选混合型证券投资基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

师宇轩 李乐

上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼

2024 年 3 月 28 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：光大保德信均衡精选混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	2,399,359.70	2,293,282.16
结算备付金		56,678.83	135,393.70
存出保证金		13,771.75	9,140.41
交易性金融资产	7.4.7.2	31,460,451.37	29,652,251.89
其中：股票投资		30,177,770.00	27,192,840.00
基金投资		-	-
债券投资		1,282,681.37	2,459,411.89
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		359,496.93	-
应收股利		-	-
应收申购款		4,168.91	13,317.72
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		34,293,927.49	32,103,385.88
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		57,691.34	925,744.03
应付赎回款		72,700.43	9,585.97
应付管理人报酬	7.4.10.2	34,595.86	40,242.49
应付托管费	7.4.10.2	5,765.98	6,707.08
应付销售服务费		14.09	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		25.16	18.89
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	162,160.08	158,054.28
负债合计		332,952.94	1,140,352.74
<b>净 资 产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	51,358,392.11	40,014,166.30
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	-17,397,417.56	-9,051,133.16
净资产合计		33,960,974.55	30,963,033.14
负债和净资产总计		34,293,927.49	32,103,385.88

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.6613 元，基金份额总额 51,358,392.11 份。其中 A 类基金份额净值 0.6613 元，份额总额 51,290,691.34 份；C 类基金份额净值 0.6601 元，份额总额 67,700.77 份。

## 7.2 利润表

会计主体：光大保德信均衡精选混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注	本期	上年度可比期间
----	----	----	---------

	号	2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日 至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-5,606,971.17	-13,002,081.38
1.利息收入		13,239.24	15,909.10
其中：存款利息收入	7.4.7.9	13,239.24	15,909.10
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-4,424,297.06	-15,697,405.21
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-4,967,163.77	-15,869,005.22
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	218,235.31	52,197.01
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	324,631.40	119,403.00
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-1,200,997.28	2,638,793.42
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	5,083.93	40,621.31
<b>减：二、营业总支出</b>		715,412.86	690,464.95
1. 管理人报酬	7.4.10.2	544,262.25	523,013.62
2. 托管费	7.4.10.2	90,710.37	87,168.85
3. 销售服务费		29.23	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		36.01	7.48
8. 其他费用	7.4.7.19	80,375.00	80,275.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-6,322,384.03</b>	<b>-13,692,546.33</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-6,322,384.03</b>	<b>-13,692,546.33</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-6,322,384.03</b>	<b>-13,692,546.33</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体：光大保德信均衡精选混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	40,014,166.30	-9,051,133.16	30,963,033.14
二、本期期初净资产	40,014,166.30	-9,051,133.16	30,963,033.14
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	11,344,225.81	-8,346,284.40	2,997,941.41
（一）、综合收益总额	-	-6,322,384.03	-6,322,384.03
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	11,344,225.81	-2,023,900.37	9,320,325.44
其中：1. 基金申购款	19,094,248.56	-3,953,905.31	15,140,343.25
2. 基金赎回款	-7,750,022.75	1,930,004.94	-5,820,017.81
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	51,358,392.11	-17,397,417.56	33,960,974.55
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	33,035,810.45	5,151,615.75	38,187,426.20
二、本期期初净资产	33,035,810.45	5,151,615.75	38,187,426.20
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	6,978,355.85	-14,202,748.91	-7,224,393.06

号填列)			
(一)、综合收益总额	-	-13,692,546.33	-13,692,546.33
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	6,978,355.85	-510,202.58	6,468,153.27
其中: 1. 基金申购款	27,226,535.16	-1,294,799.35	25,931,735.81
2. 基金赎回款	-20,248,179.31	784,596.77	-19,463,582.54
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	40,014,166.30	-9,051,133.16	30,963,033.14

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从 7.1 至 7.4, 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

光大保德信均衡精选混合型证券投资基金(原名光大保德信均衡精选股票型证券投资基金)(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”)证监许可[2008]1249 号文《关于核准光大保德信均衡精选股票型证券投资基金募集的批复》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 2009 年 3 月 4 日正式生效, 首次设立募集规模为 1,040,503,238.27 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及注册登记机构为光大保德信基金管理有限公司, 基金托管人为中国建设银行股份有限公司。根据基金管理人光大保德信基金管理有限公司于 2023 年 8 月 31 日发布的《关于光大保德信均衡精选混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告》, 自 2023 年 9 月 1 日起, 本基金增加 C 类基金份额。

根据 2014 年 8 月 8 日实行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》, 经与基金托管人中国建

设银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，自 2015 年 7 月 17 日起将本基金变更为光大保德信均衡精选混合型证券投资基金。

本基金股票及存托凭证资产占基金资产不少于 60%，最高可达基金资产 90%，其余资产除应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在 1 年以内的政府债券外，还可投资于中国证监会认可的其他金融工具，包括但不限于债券、可转债、央行票据、回购、权证等。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。同时，为了更有效地进行风险管理，基金资产可适当投资于经法律法规或中国证监会允许的各种金融衍生产品，如期权、期货、权证、资产支持证券以及其他相关的衍生工具。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序并经和托管人协商同意后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为： $75\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 25\% \times \text{中证全债指数收益率}$ 。

#### 7.4.2 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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币

元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据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分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

##### (2) 金融负债分类

本基金的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、以摊余成本计量的金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为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，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产



或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 由于本基金 C 类基金份额收取销售服务费，而 A 类基金份额不收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。

(3) 本基金收益每年最多分配 5 次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 60%；

(4) 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

(5) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的该类基金份额净值自动转为同一类别的基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(6) 基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

(7) 基金当期收益应先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；

(8) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

(2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

(3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 税项

#### 7.4.6.1 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‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

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。

#### 7.4.6.2 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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资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。对证券投资基金在 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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

#### 7.4.6.3 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法》、《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。

#### 7.4.6.4 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。

#### 7.4.6.5 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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	2,399,359.70	2,293,282.16
等于：本金	2,399,062.64	2,293,048.14
加：应计利息	297.06	234.02
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	2,399,359.70	2,293,282.16

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		31,332,235.06	-	30,177,770.00	-1,154,465.06
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,267,897.56	6,461.37	1,282,681.37	8,322.44
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,267,897.56	6,461.37	1,282,681.37	8,322.44
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		32,600,132.62	6,461.37	31,460,451.37	-1,146,142.62
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		27,057,261.00	-	27,192,840.00	135,579.00
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,528,384.34	11,751.89	2,459,411.89	-80,724.34
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,528,384.34	11,751.89	2,459,411.89	-80,724.34
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-

合计	29,585,645.34	11,751.89	29,652,251.89	54,854.66
----	---------------	-----------	---------------	-----------

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	98.78	28.07
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	82,061.30	78,026.21
其中：交易所市场	82,061.30	78,026.21
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提审计费	30,000.00	30,000.00
预提信息披露费	50,000.00	50,000.00
合计	162,160.08	158,054.28



### 7.4.7.7 实收基金

光大保德信均衡精选混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额	账面金额
上年度末	40,014,166.30	40,014,166.30
本期申购	19,026,547.79	19,026,547.79
本期赎回（以“-”号填列）	-7,750,022.75	-7,750,022.75
本期末	51,290,691.34	51,290,691.34

光大保德信均衡精选混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额	账面金额
本期申购	67,700.77	67,700.77
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	67,700.77	67,700.77

注：（1）申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

（2）根据基金管理人光大保德信基金管理有限公司于 2023 年 8 月 31 日发布的《关于光大保德信均衡精选混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告》，自 2023 年 9 月 1 日起，本基金增设 C 类基金份额。

### 7.4.7.8 未分配利润

光大保德信均衡精选混合 A

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	8,472,621.85	-17,523,755.01	-9,051,133.16
本期期初	8,472,621.85	-17,523,755.01	-9,051,133.16
本期利润	-5,120,035.63	-1,201,026.77	-6,321,062.40
本期基金份额交易产生的变动数	2,409,059.15	-4,411,266.54	-2,002,207.39

其中：基金申购款	3,841,290.39	-7,773,502.72	-3,932,212.33
基金赎回款	-1,432,231.24	3,362,236.18	1,930,004.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,761,645.37	-23,136,048.32	-17,374,402.95

光大保德信均衡精选混合 C

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
本期期初	-	-	-
本期利润	-1,351.12	29.49	-1,321.63
本期基金份额交易产生的变动数	8,876.17	-30,569.15	-21,692.98
其中：基金申购款	8,876.17	-30,569.15	-21,692.98
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,525.05	-30,539.66	-23,014.61

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	10,803.04	14,945.54
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	2,143.90	836.86
其他	292.30	126.70
合计	13,239.24	15,909.10

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	187,476,592.74	63,347,687.64
减：卖出股票成本总额	192,025,998.43	79,047,657.09
减：交易费用	417,758.08	169,035.77
买卖股票差价收入	-4,967,163.77	-15,869,005.22

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	26,149.22	10,294.97
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	192,086.09	41,902.04
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	218,235.31	52,197.01

##### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,481,643.77	213,989.11
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,254,446.38	172,000.00
减：应计利息总额	34,922.04	29.50
减：交易费用	189.26	57.57
买卖债券差价收入	192,086.09	41,902.04

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

##### 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	324,631.40	119,403.00
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	324,631.40	119,403.00

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
1.交易性金融资产	-1,200,997.28	2,638,793.42
——股票投资	-1,290,044.06	2,719,517.76
——债券投资	89,046.78	-80,724.34
——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	-1,200,997.28	2,638,793.42

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	4,948.99	39,995.27
转换费收入	134.94	626.04
合计	5,083.93	40,621.31

#### 7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
审计费用	30,000.00	30,000.00
信息披露费	50,000.00	50,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	375.00	275.00
合计	80,375.00	80,275.00

#### 7.4.7.20 分部报告

本基金本报告期无分部报告综述。

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 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。

#### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

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
中国建设银行股份有限公司（简称“建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
保德信投资管理有限公司	基金管理人的股东
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
光大保德信资产管理有限公司	基金管理人控制的子公司

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

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股票交易。

###### 7.4.10.1.2 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。

###### 7.4.10.1.3 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。

###### 7.4.10.1.4 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回购交易。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	544,262.25	523,013.62
其中：支付销售机构的客户维护费	165,584.72	183,079.65
应支付基金管理人的净管理费	378,677.53	339,933.97

注：2023 年 8 月 28 日前，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；自 2023 年 8 月 28 日起，基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	90,710.37	87,168.85

注：2023 年 8 月 28 日前，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；自 2023 年 8 月 28 日起，基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金托管费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

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。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各	本期 2023年1月1日至2023年12月31日
-----------	-----------------------------

关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	光大保德信均衡精选混合 A	光大保德信均衡精选混合 C	合计
光大保德信	-	29.23	29.23
合计	-	29.23	29.23
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	光大保德信均衡精选混合A	光大保德信均衡精选混合C	合计
	合计	-	-

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金份额分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。自 2023 年 9 月 1 日起，本基金增加收取销售服务费的 C 类份额。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值的 0.60% 年费率计提。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

$H = E \times C$  类基金销售服务费年费率 / 当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 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	上年度可比期间
----	----	---------



	2023年1月1日至2023年12月31日		2022年1月1日至2022年12月31日	
	光大保德信均衡精选混合A	光大保德信均衡精选混合C	光大保德信均衡精选混合A	光大保德信均衡精选混合C
期初持有的基金份额	-	-	-	-
期间申购/买入总份额	-	13,707.42	-	-
期间因拆分变动份额	-	0.00	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	0.00	-	-
期末持有的基金份额	-	13,707.42	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	20.25%	-	-

注：1. 期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

2. 基金管理人投资本基金的费率标准与其他同条件的投资者适用的费率标准相一致。

#### 7.4.10.5.2 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。

#### 7.4.10.6 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		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年12月31日		2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	2,399,359.70	10,803.04	2,293,282.16	14,945.54

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 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

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 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。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金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。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金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。

###### 7.4.12.4 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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，并向风险管理委员会报告评估情况。

风险管理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。

#### 7.4.13.2 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 2023 年 12 月 31 日，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 3.78%(2022 年 12 月 31 日：3.70%)。

#### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。本基金的生息资产主要为结算备付金、存出保证金、债券投资及银行存款等。本基金通过监控组合的久期来评估基金面临的利率风险。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 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							
货币资金	2,399,359.70	-	-	-	-	-	2,399,359.70
结算备付金	56,678.83	-	-	-	-	-	56,678.83
存出保证金	13,771.75	-	-	-	-	-	13,771.75
交易性金融资产	-	-	-	1,282,681.37	-	30,177,770.00	31,460,451.37
应收清算款	-	-	-	-	-	359,496.93	359,496.93
应收申购款	-	-	-	-	-	4,168.91	4,168.91
资产总计	2,469,810.28	-	-	1,282,681.37	-	30,541,435.84	34,293,927.49
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	57,691.34	57,691.34

应付赎回款	-	-	-	-	-	72,700.43	72,700.43
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	34,595.86	34,595.86
应付托管费	-	-	-	-	-	5,765.98	5,765.98
应付销售服务费	-	-	-	-	-	14.09	14.09
应交税费	-	-	-	-	-	25.16	25.16
其他负债	-	-	-	-	-	162,160.08	162,160.08
负债总计	-	-	-	-	-	332,952.94	332,952.94
利率敏感度缺口	2,469,810.28	-	-	1,282,681.37	-	30,208,482.90	33,960,974.55
上年度末 2022 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							
货币资金	2,293,282.16	-	-	-	-	-	2,293,282.16
结算备付金	135,393.70	-	-	-	-	-	135,393.70
存出保证金	9,140.41	-	-	-	-	-	9,140.41
交易性金融资产	-	680,852.05	1,778,559.84	-	-	27,192,840.00	29,652,251.89
应收申购款	-	-	-	-	-	13,317.72	13,317.72
资产总计	2,437,816.27	680,852.05	1,778,559.84	-	-	27,206,157.72	32,103,385.88
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	925,744.03	925,744.03
应付赎回款	-	-	-	-	-	9,585.97	9,585.97
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	40,242.49	40,242.49
应付托管费	-	-	-	-	-	6,707.08	6,707.08
应交税费	-	-	-	-	-	18.89	18.89
其他负债	-	-	-	-	-	158,054.28	158,054.28
负债总计	-	-	-	-	-	1,140,352.74	1,140,352.74
利率敏感度缺口	2,437,816.27	680,852.05	1,778,559.84	-	-	26,065,804.98	30,963,033.14

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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。

#### 7.4.13.4.1.2 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。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 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	30,177,770.00	88.86	27,192,840.00	87.82

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,282,681.37	3.78	1,145,268.60	3.70
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	31,460,451.37	92.64	28,338,108.60	91.52

#### 7.4.13.4.3.2 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内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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 1%	增加约 322,434.70	增加约 426,090.77
	业绩比较基准下降 1%	减少约 322,434.70	减少约 426,090.77

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。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	31,460,451.37	28,338,108.60
第二层次	0.00	1,314,143.29
第三层次	-	-
合计	31,460,451.37	29,652,251.89

###### 7.4.14.2.2 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。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根



据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

##### 7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2024 年 3 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	30,177,770.00	88.00
	其中：股票	30,177,770.00	88.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,282,681.37	3.74
	其中：债券	1,282,681.37	3.74
	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	2,456,038.53	7.16
8	其他各项资产	377,437.59	1.10
9	合计	34,293,927.49	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,767,500.00	5.20
C	制造业	21,650,120.00	63.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	740,850.00	2.18
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,749,300.00	8.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	708,000.00	2.08
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,302,000.00	3.83
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	601,000.00	1.77
R	文化、体育和娱乐业	659,000.00	1.94
S	综合	-	-
	合计	30,177,770.00	88.86

## 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末投资港股通股票。

## 8.3 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	603056	德邦股份	190,000	2,749,300.00	8.10
2	300285	国瓷材料	115,000	2,658,800.00	7.83
3	603668	天马科技	140,000	2,567,600.00	7.56
4	601208	东材科技	197,000	2,438,860.00	7.18
5	603650	彤程新材	40,000	1,332,000.00	3.92
6	301096	百诚医药	20,000	1,302,000.00	3.83
7	601233	桐昆股份	80,000	1,210,400.00	3.56
8	002493	荣盛石化	100,000	1,035,000.00	3.05
9	002532	天山铝业	170,000	1,021,700.00	3.01
10	002643	万润股份	60,000	995,400.00	2.93
11	300980	祥源新材	40,000	938,400.00	2.76
12	605589	圣泉集团	40,000	895,200.00	2.64
13	600309	万华化学	10,000	768,200.00	2.26
14	600256	广汇能源	100,000	714,000.00	2.10
15	300002	神州泰岳	80,000	708,000.00	2.08
16	600988	赤峰黄金	50,000	700,500.00	2.06
17	600373	中文传媒	50,000	659,000.00	1.94
18	300680	隆盛科技	35,000	654,500.00	1.93
19	688323	瑞华泰	30,000	644,100.00	1.90
20	300037	新宙邦	13,000	614,900.00	1.81
21	603773	沃格光电	18,000	609,660.00	1.80
22	603681	永冠新材	40,000	604,000.00	1.78
23	002044	美年健康	100,000	601,000.00	1.77
24	300406	九强生物	30,000	573,000.00	1.69
24	600873	梅花生物	60,000	573,000.00	1.69
26	600023	浙能电力	105,000	484,050.00	1.43
27	603225	新凤鸣	30,000	426,000.00	1.25
28	688121	卓然股份	20,000	404,600.00	1.19
29	688550	瑞联新材	10,000	396,800.00	1.17
30	601857	中国石油	50,000	353,000.00	1.04
31	002271	东方雨虹	15,000	288,000.00	0.85
32	600642	申能股份	40,000	256,800.00	0.76

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

## 8.4.1 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	601208	东材科技	5,539,799.00	17.89
2	600803	新奥股份	5,215,640.29	16.84
3	300285	国瓷材料	4,330,157.00	13.98
4	600011	华能国际	3,958,778.00	12.79
5	601233	桐昆股份	3,619,020.00	11.69
6	002271	东方雨虹	3,597,017.00	11.62
7	603650	彤程新材	3,585,579.16	11.58
8	600346	恒力石化	3,262,287.00	10.54
9	002648	卫星化学	3,168,699.00	10.23
10	603056	德邦股份	3,061,626.00	9.89
11	002886	沃特股份	2,997,470.00	9.68
12	600642	申能股份	2,931,896.00	9.47
13	300737	科顺股份	2,929,246.00	9.46
14	002532	天山铝业	2,682,888.00	8.66
15	603225	新凤鸣	2,661,292.80	8.60
16	002493	荣盛石化	2,621,006.00	8.46
17	603801	志邦家居	2,508,055.00	8.10
18	002643	万润股份	2,372,223.00	7.66
19	688357	建龙微纳	2,354,444.90	7.60
20	603668	天马科技	2,138,906.00	6.91
21	000975	银泰黄金	2,111,580.00	6.82
22	600989	宝丰能源	2,081,916.00	6.72
23	600021	上海电力	2,079,988.00	6.72
24	600309	万华化学	2,068,876.00	6.68
25	600827	百联股份	2,006,306.00	6.48
26	301096	百诚医药	1,983,065.00	6.40
27	601857	中国石油	1,904,300.00	6.15
28	603867	新化股份	1,900,386.00	6.14
29	688550	瑞联新材	1,888,261.55	6.10
30	601636	旗滨集团	1,885,799.00	6.09
31	600023	浙能电力	1,867,914.00	6.03
32	000589	贵州轮胎	1,859,409.00	6.01
33	002572	索菲亚	1,828,459.00	5.91
34	301030	仕净科技	1,816,480.00	5.87
35	600988	赤峰黄金	1,811,132.00	5.85

36	600028	中国石化	1,768,691.00	5.71
37	002876	三利谱	1,759,809.00	5.68
38	002372	伟星新材	1,742,236.00	5.63
39	600547	山东黄金	1,718,982.00	5.55
40	000893	亚钾国际	1,685,538.00	5.44
41	000543	皖能电力	1,678,785.00	5.42
42	601058	赛轮轮胎	1,671,230.00	5.40
43	603816	顾家家居	1,595,906.00	5.15
44	300121	阳谷华泰	1,570,295.00	5.07
45	688106	金宏气体	1,532,928.19	4.95
46	301168	通灵股份	1,470,350.10	4.75
47	002092	中泰化学	1,466,764.00	4.74
48	688323	瑞华泰	1,454,137.29	4.70
49	600027	华电国际	1,454,114.00	4.70
50	605589	圣泉集团	1,417,412.00	4.58
51	000539	粤电力 A	1,416,265.00	4.57
52	600732	爱旭股份	1,411,002.00	4.56
53	002601	龙佰集团	1,332,691.58	4.30
54	002915	中欣氟材	1,331,728.00	4.30
55	000807	云铝股份	1,310,385.03	4.23
56	002608	江苏国信	1,309,895.00	4.23
57	300002	神州泰岳	1,301,395.96	4.20
58	300054	鼎龙股份	1,263,022.00	4.08
59	000830	鲁西化工	1,231,707.00	3.98
60	002064	华峰化学	1,225,887.00	3.96
61	000059	华锦股份	1,211,305.01	3.91
62	600570	恒生电子	1,157,728.00	3.74
63	603601	再升科技	1,115,323.00	3.60
64	600339	中油工程	1,108,160.00	3.58
65	002918	蒙娜丽莎	1,102,975.00	3.56
66	000672	上峰水泥	1,074,555.00	3.47
67	000952	广济药业	1,060,804.00	3.43
68	603833	欧派家居	1,052,467.00	3.40
69	688268	华特气体	1,023,068.46	3.30
70	601677	明泰铝业	1,008,685.00	3.26
71	600426	华鲁恒升	990,559.00	3.20
72	688267	中触媒	964,321.73	3.11
73	002170	芭田股份	952,039.00	3.07
74	300980	祥源新材	949,371.00	3.07
75	301171	易点天下	937,490.00	3.03
76	688372	伟测科技	932,206.14	3.01
77	603822	嘉澳环保	913,945.00	2.95
78	000933	神火股份	912,300.00	2.95
79	603993	洛阳钼业	907,256.00	2.93

80	688021	奥福环保	873,635.22	2.82
81	600325	华发股份	859,549.00	2.78
82	002709	天赐材料	845,447.00	2.73
83	600230	沧州大化	815,023.00	2.63
84	002155	湖南黄金	806,311.00	2.60
85	603067	振华股份	803,126.00	2.59
86	605399	晨光新材	802,608.00	2.59
87	002410	广联达	799,320.00	2.58
88	600256	广汇能源	781,400.00	2.52
89	600096	云天化	778,091.00	2.51
90	000338	潍柴动力	775,450.00	2.50
91	002185	华天科技	753,600.00	2.43
92	002555	三七互娱	751,912.00	2.43
93	300680	隆盛科技	744,672.00	2.41
94	688033	天宜上佳	741,868.31	2.40
95	601666	平煤股份	740,132.00	2.39
96	600585	海螺水泥	739,263.00	2.39
97	600963	岳阳林纸	737,341.00	2.38
98	601699	潞安环能	735,438.00	2.38
99	688121	卓然股份	729,890.17	2.36
100	600141	兴发集团	717,613.00	2.32
101	002597	金禾实业	717,505.00	2.32
102	000960	锡业股份	716,510.00	2.31
103	002409	雅克科技	714,570.00	2.31
104	601137	博威合金	709,882.00	2.29
105	600160	巨化股份	708,760.00	2.29
106	603008	喜临门	708,419.00	2.29
107	300481	濮阳惠成	703,432.00	2.27
108	603773	沃格光电	697,726.00	2.25
109	600409	三友化工	697,108.00	2.25
110	600373	中文传媒	692,915.00	2.24
111	000983	山西焦煤	692,438.00	2.24
112	688669	聚石化学	687,560.00	2.22
113	300748	金力永磁	683,147.00	2.21
114	603929	亚翔集成	679,907.00	2.20
115	600688	上海石化	674,000.00	2.18
116	600583	海油工程	659,854.00	2.13
117	002738	中矿资源	648,640.00	2.09
118	300041	回天新材	636,196.00	2.05
119	002044	美年健康	632,500.00	2.04
120	300037	新宙邦	630,080.00	2.03

## 8.4.2 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	600803	新奥股份	4,984,703.48	16.10
2	600011	华能国际	4,123,131.00	13.32
3	601208	东材科技	3,894,433.00	12.58
4	601233	桐昆股份	3,607,673.00	11.65
5	603225	新凤鸣	3,400,107.00	10.98
6	002648	卫星化学	3,384,189.60	10.93
7	600346	恒力石化	3,019,260.00	9.75
8	002886	沃特股份	2,924,377.00	9.44
9	002271	东方雨虹	2,923,944.00	9.44
10	600642	申能股份	2,916,421.00	9.42
11	300285	国瓷材料	2,849,984.00	9.20
12	002372	伟星新材	2,684,627.42	8.67
13	600309	万华化学	2,625,760.00	8.48
14	002876	三利谱	2,613,806.00	8.44
15	688357	建龙微纳	2,533,011.57	8.18
16	000975	银泰黄金	2,528,795.00	8.17
17	300737	科顺股份	2,469,579.00	7.98
18	002572	索菲亚	2,445,956.00	7.90
19	601058	赛轮轮胎	2,445,789.00	7.90
20	603650	彤程新材	2,371,719.91	7.66
21	603801	志邦家居	2,225,885.80	7.19
22	688106	金宏气体	2,167,144.86	7.00
23	600988	赤峰黄金	2,163,453.00	6.99
24	600989	宝丰能源	2,105,750.00	6.80
25	600021	上海电力	2,092,639.00	6.76
26	600827	百联股份	2,075,027.00	6.70
27	002643	万润股份	2,005,390.00	6.48
28	002493	荣盛石化	1,948,305.00	6.29
29	301030	仕净科技	1,930,973.00	6.24
30	000589	贵州轮胎	1,908,427.00	6.16
31	600028	中国石化	1,838,700.00	5.94
32	000543	皖能电力	1,822,571.00	5.89
33	603733	仙鹤股份	1,812,835.00	5.85
34	002601	龙佰集团	1,758,611.00	5.68
35	603668	天马科技	1,747,713.74	5.64
36	603867	新化股份	1,697,707.40	5.48
37	000893	亚钾国际	1,664,409.00	5.38
38	600547	山东黄金	1,627,573.00	5.26

39	601636	旗滨集团	1,613,593.00	5.21
40	601857	中国石油	1,556,950.00	5.03
41	002734	利民股份	1,505,760.40	4.86
42	603816	顾家家居	1,488,004.00	4.81
43	600027	华电国际	1,452,599.00	4.69
44	688267	中触媒	1,443,151.89	4.66
45	300121	阳谷华泰	1,429,501.00	4.62
46	688550	瑞联新材	1,398,122.90	4.52
47	002092	中泰化学	1,365,056.00	4.41
48	600023	浙能电力	1,352,193.00	4.37
49	300054	鼎龙股份	1,321,446.00	4.27
50	000807	云铝股份	1,321,367.00	4.27
51	000539	粤电力 A	1,308,750.00	4.23
52	002532	天山铝业	1,301,496.00	4.20
53	002608	江苏国信	1,243,667.00	4.02
54	605007	五洲特纸	1,237,398.00	4.00
55	000059	华锦股份	1,230,985.00	3.98
56	000830	鲁西化工	1,227,039.00	3.96
57	002915	中欣氟材	1,198,222.00	3.87
58	002918	蒙娜丽莎	1,181,049.57	3.81
59	600096	云天化	1,171,388.00	3.78
60	002064	华峰化学	1,155,937.00	3.73
61	301168	通灵股份	1,140,206.00	3.68
62	601088	中国神华	1,122,598.00	3.63
63	600489	中金黄金	1,089,341.00	3.52
64	600732	爱旭股份	1,089,107.00	3.52
65	600570	恒生电子	1,087,476.00	3.51
66	002597	金禾实业	1,085,787.00	3.51
67	603601	再升科技	1,056,818.00	3.41
68	000672	上峰水泥	1,053,897.00	3.40
69	000420	吉林化纤	993,000.00	3.21
70	002170	芭田股份	989,734.00	3.20
71	600339	中油工程	987,400.00	3.19
72	601699	潞安环能	981,737.65	3.17
73	600426	华鲁恒升	980,363.00	3.17
74	000952	广济药业	967,351.00	3.12
75	301171	易点天下	932,251.00	3.01
76	600325	华发股份	930,800.00	3.01
77	688268	华特气体	921,197.02	2.98
78	601677	明泰铝业	899,893.00	2.91
79	603833	欧派家居	891,404.00	2.88
80	002709	天赐材料	890,644.00	2.88
81	603822	嘉澳环保	887,464.00	2.87
82	000819	岳阳兴长	882,866.00	2.85



83	603993	洛阳钼业	851,500.00	2.75
84	002155	湖南黄金	836,250.00	2.70
85	000338	潍柴动力	806,928.00	2.61
86	603067	振华股份	802,499.00	2.59
87	000933	神火股份	788,200.00	2.55
88	605399	晨光新材	786,399.00	2.54
89	600230	沧州大化	772,909.78	2.50
90	688323	瑞华泰	766,903.16	2.48
91	600938	中国海油	766,400.00	2.48
92	601137	博威合金	765,217.00	2.47
93	605589	圣泉集团	759,071.00	2.45
94	300481	濮阳惠成	758,000.00	2.45
95	002185	华天科技	749,425.00	2.42
96	000960	锡业股份	746,019.00	2.41
97	688021	奥福环保	740,253.24	2.39
98	000998	隆平高科	725,600.00	2.34
99	603008	喜临门	713,830.00	2.31
100	688372	伟测科技	708,281.26	2.29
101	002410	广联达	707,624.00	2.29
102	600160	巨化股份	698,762.00	2.26
103	600585	海螺水泥	696,714.00	2.25
104	600409	三友化工	695,949.00	2.25
105	601666	平煤股份	693,400.00	2.24
106	600141	兴发集团	691,207.00	2.23
107	603929	亚翔集成	690,043.00	2.23
108	002409	雅克科技	688,250.00	2.22
109	600963	岳阳林纸	683,645.00	2.21
110	688033	天宜上佳	670,886.24	2.17
111	600688	上海石化	664,000.00	2.14
112	300041	回天新材	655,331.00	2.12
113	002555	三七互娱	653,796.00	2.11
114	000983	山西焦煤	652,493.00	2.11
115	603217	元利科技	649,297.00	2.10
116	688398	赛特新材	648,950.85	2.10
117	300748	金力永磁	641,500.00	2.07
118	600201	生物股份	638,883.00	2.06
119	688669	聚石化学	634,156.33	2.05
120	301096	百诚医药	626,114.00	2.02

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	196,300,972.49
---------------	----------------

卖出股票的收入（成交）总额	187,476,592.74
---------------	----------------

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 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。

### 8.5 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	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）	1,282,681.37	3.78
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,282,681.37	3.78

### 8.6 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	113623	凤 21 转债	11,000	1,282,681.37	3.78

### 8.7 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。

### 8.8 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。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.11 本基金投资股指期货的投资政策

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。

### 8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.12.1 本期国债期货投资政策

若本基金投资国债期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于国债期货。

#### 8.12.2 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。

#### 8.12.3 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。

### 8.13 投资组合报告附注

8.13.1 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。

8.13.2 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。

#### 8.13.3 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	13,771.75

2	应收清算款	359,496.93
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,168.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	377,437.59

#### 8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113623	凤 21 转债	1,282,681.37	3.78

#### 8.13.5 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。

#### 8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金报告期内没有其他需要说明的重要事项。

### 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
光大保德信均衡	5,694	9,007.85	12,365,817.46	24.11%	38,924,873.88	75.89%

精选混合 A						
光大保德信均衡 精选混合 C	3	22,566.92	13,707.42	20.25%	53,993.35	79.75%
合计	5,697	9,014.99	12,379,524.88	24.10%	38,978,867.23	75.90%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	光大保德信均衡精选混合 A	110,041.61	0.21%
	光大保德信均衡精选混合 C	53,993.35	79.75%
	合计	164,034.96	0.32%

### 9.3 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	份额级别	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	光大保德信均衡精选混合 A	0~10
	光大保德信均衡精选混合 C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	光大保德信均衡精选混合 A	-
	光大保德信均衡精选混合 C	0~10
	合计	0~10

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	光大保德信均衡精选混合 A	光大保德信均衡精选混合 C
基金合同生效日（2009 年 3 月 4 日）基金份额总额	1,040,503,238.27	-
本报告期期初基金份额总额	40,014,166.30	-
本报告期基金总申购份额	19,026,547.79	67,700.77

减：本报告期基金总赎回份额	7,750,022.75	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	51,290,691.34	67,700.77

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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，基金管理人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门根据工作需要，任命牛环起、施伟为资产托管业务部副总经理。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 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。

### 11.5 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。

### 11.6 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。报告年度应支付给聘任安永华明会计师事务所的报酬情况是 3 万元，目前该审计机构已提供审计服务的连续年限为 15 年。

### 11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

#### 11.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

根据我行审计报告，本行不存在涉嫌犯罪被依法立案调查的情况，本行的控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员不存在涉嫌犯罪被依法采取强制措施、涉嫌严重违纪违法或者职务犯罪被纪检监察机关采取留置措施且影响其履行职责的情况；本行或者本行的控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员不存在受到刑事处罚，涉嫌违法违规被中国证监会立案调查或者受到中国证监会行政处罚，或者受到其他有权机关重大行政处罚，或者被中国证监会采取行政监管措施和被证券交易所采取纪律处分的情况；本行董事、监事、高级管理人员不存在因涉嫌违法违规被

其他有权机关采取强制措施且影响其履行职责的情况。

## 11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.8.1 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	
德邦证券	2	97,735,942.35	25.48%	51,384.63	23.08%	-
华创证券有限责任公司	2	75,069,166.41	19.57%	39,133.54	17.58%	-
国海证券股份有限公司	1	45,473,658.33	11.85%	23,705.56	10.65%	-
财通证券股份有限公司	2	41,141,689.54	10.73%	22,048.52	9.90%	-
开源证券股份有限公司	2	41,055,572.44	10.70%	21,401.47	9.61%	-
招商证券股份有限公司	1	34,728,912.37	9.05%	32,074.77	14.41%	-
国盛证券有限责任公司	2	27,612,478.86	7.20%	14,521.65	6.52%	-
上海证券有限责任公司	1	18,841,988.71	4.91%	17,359.32	7.80%	-
中信建投证券股份有限公司	2	1,939,050.00	0.51%	1,010.76	0.45%	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
五矿证券有限公司	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	-

安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-

注：（1）报告期内租用证券公司交易单元无变更情况；

（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。

### 11.8.2 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
德邦证券	542,264.42	10.56%	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	932,108.08	18.15%	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	2,255,949.95	43.93%	-	-	-	-
财通证券股份有限公司	114,182.00	2.22%	-	-	-	-
开源证券股份有限公司	570,946.46	11.12%	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	116,400.00	2.27%	-	-	-	-
上海证券有限责任公司	602,894.93	11.74%	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
五矿证券有限公司	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
东北证券股份	-	-	-	-	-	-

有限公司						
西南证券	-	-	-	-	-	-

### 11.9 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 2022 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	2023-01-03
2	光大保德信均衡精选混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	同上	2023-01-20
3	光大保德信均衡精选混合型证券投资基金 2022 年年度报告	同上	2023-03-31
4	光大保德信均衡精选混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	同上	2023-03-31
5	光大保德信均衡精选混合型证券投资基金招募说明书（更新）	同上	2023-03-31
6	光大保德信均衡精选混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	同上	2023-04-21
7	光大保德信基金管理有限公司旗下基金 2023 年 6 月 30 日基金份额净值及累计净值公告	同上	2023-07-03
8	光大保德信均衡精选混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	同上	2023-07-21
9	光大保德信基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	同上	2023-08-26
10	光大保德信均衡精选混合型证券投资基金基金合同	同上	2023-08-26
11	光大保德信均衡精选混合型证券投资基金托管协议	同上	2023-08-26
12	光大保德信均衡精选混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	同上	2023-08-30
13	光大保德信均衡精选混合型证券投资基金招募说明书（更新）	同上	2023-08-30
14	关于光大保德信均衡精选混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告	同上	2023-08-31
15	光大保德信均衡精选混合型证券投资基金 2023 年中期报告	同上	2023-08-31
16	光大保德信均衡精选混合型证券投资基金基金合同	同上	2023-08-31
17	光大保德信均衡精选混合型证券投资基金托管协议	同上	2023-08-31
18	光大保德信均衡精选混合型证券投资基金（光	同上	2023-09-06

	大保德信均衡精选混合 A)基金产品资料概要更新		
19	光大保德信均衡精选混合型证券投资基金(光大保德信均衡精选混合 C)基金产品资料概要更新	同上	2023-09-06
20	光大保德信均衡精选混合型证券投资基金招募说明书(更新)	同上	2023-09-06
21	光大保德信均衡精选混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	同上	2023-10-25
22	光大保德信基金管理有限公司关于暂停官网、网上交易、微信交易、APP、客服热线、在线客服等相关服务的公告	同上	2023-11-13
23	光大保德信基金管理有限公司关于暂停官网、网上交易、APP、微信交易、客服热线、在线客服等系统服务相关公告	同上	2023-11-23
24	光大保德信基金管理有限公司关于暂停关于暂停网上交易、APP、微信交易系统服务相关公告	同上	2023-11-29
25	光大保德信基金管理有限公司关于暂停网上交易、APP、微信交易系统服务相关公告	同上	2023-12-12
26	光大保德信基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	同上	2023-12-30

## 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20230112-20231231	0.00	12,365,817.46	0.00	12,365,817.46	24.08%

#### 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。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

1. 根据 2023 年 8 月 26 日《光大保德信基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，光大保德信基金管理有限公司决定自 2023 年 8 月 28 日起，调低本基金的管理费率及托管费率并对基金合同有关条款进行修订。详情请见公告。

2. 根据 2023 年 8 月 31 日《关于光大保德信均衡精选混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告》，基金管理人决定自 2023 年 9 月 1 日起对旗下光大保德信均衡精选混合型证券投资基金增设收取销售服务费的 C 类基金份额并更新基金管理人信息等，同时对《光大保德信均衡精选混合型证券投资基金基金合同》作相应修改。详情请见公告。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准光大保德信均衡精选股票型证券投资基金设立的文件
- 2、光大保德信均衡精选混合型证券投资基金基金合同
- 3、光大保德信均衡精选混合型证券投资基金招募说明书
- 4、光大保德信均衡精选混合型证券投资基金托管协议
- 5、光大保德信均衡精选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均衡精选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

### 13.2 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。

### 13.3 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](http://www.epf.com.cn)。

光大保德信基金管理有限公司

二〇二四年三月二十九日