

光大保德信量化核心证券投资基金

2024 年中期报告

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：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年八月三十日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 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 2024 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	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
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	17
6 中期财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 净资产（基金净值）变动表	20
6.4 报表附注	21
7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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	58
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	58
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	59
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	59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	59
8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60

8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
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	61
9	开放式基金份额变动	61
10	重大事件揭示	61
10.1	基金份额持有人大会决议	61
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	62
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4	基金投资策略的改变	62
10.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件	62
10.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	62
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	62
10.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
10.9	其他重大事件	65
11	影响投资者决策的其他重要信息	66
12	备查文件目录	67
12.1	备查文件目录	67
12.2	存放地点	67
12.3	查阅方式	67

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	光大保德信量化核心证券投资基金	
基金简称	光大保德信量化股票	
基金主代码	360001	
交易代码	360001	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2004 年 8 月 27 日	
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,191,363,149.11 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	光大保德信量化股票 A	光大保德信量化股票 C
下属分级基金的交易代码	360001	007479
报告期末下属分级基金的份额总额	1,191,234,299.81 份	128,849.30 份

2.2 基金产品说明

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

投资组合，并对投资组合进行动态持续优化，使投资组合风险收益特征符合既定目标；最后由交易员根据具体投资方案进行交易。

1. 多因素数量模型的运用

本基金借鉴保德信投资的量化投资管理经验，根据中国市场运行特征从股票估值，成长趋势及数据质量三方面选取对 A 股股价波动具有较强解释度的共同指标作为多因素数量模型的参数，通过一定的量化技术估算出共同指标的收益贡献率，并按一定权重加总得出个股预期收益率，作为投资组合构建的重要依据。估值类指标主要判断股票价格是否正确反映了公司基本面状况；趋势类指标说明股票现有估值是否能够持续；质量类指标判断是否存在暗示现行基本面趋势可能逆转的警戒信号。同时数量小组还将根据市场变化趋势定期或不定期地对模型参数及相关系数进行复核，并做相应调整以确保参数的有效性。

2. 行业评级

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

3. 个股评级

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

4. 投资组合优化器的运用

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

5. 权证的投资

(1) 权证的投资策略

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

A. 本公司主要采用 Black-Scholes 定价公式和二叉树模型对权证进行定价，并根据市场实际情况，调整权证定价模型及其参数，得到权证的理论价值，作为权证投资的价值基准。

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		光大保德信基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露	姓名	高顺平	石立平
	联系电话	(021) 80262888	010-63639180

负责人	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		4008-202-888	95595
传真		(021) 80262468	010-63639132
注册地址		上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢, 6层	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址		上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢(北区3号楼), 6-7层、10层	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		200010	100033
法定代表人		刘翔	吴利军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.epf.com.cn
基金中期报告备置地点	光大保德信基金管理有限公司、中国光大银行股份有限公司的办公场所。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	光大保德信基金管理有限公司	上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢 (北区 3 号楼), 6-7 层、10 层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日)	
	光大保德信量化股票 A	光大保德信量化股票 C
本期已实现收益	-301,180,902.51	-15,205,081.35
本期利润	-309,388,673.47	-59,543,631.54
加权平均基金份额本期利润	-0.2327	-0.7741
本期加权平均净值利润率	-28.53%	-90.08%
本期基金份额净值增长率	-17.72%	-18.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	光大保德信量化股票 A	光大保德信量化股票 C
期末可供分配利润	336,212,290.49	-45,935.38

期末可供分配基金份额利润	0.2822	-0.3565
期末基金资产净值	931,144,227.79	100,102.33
期末基金份额净值	0.7817	0.7769
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
	光大保德信量化股票 A	光大保德信量化股票 C
基金份额累计净值增长率	303.85%	-18.29%

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

光大保德信量化股票 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
过去一个月	-4.97%	1.01%	-2.97%	0.43%	-2.00%	0.58%
过去三个月	-3.22%	1.35%	-1.91%	0.68%	-1.31%	0.67%
过去六个月	-17.72%	2.23%	0.86%	0.81%	-18.58%	1.42%
过去一年	-21.18%	1.64%	-8.86%	0.79%	-12.32%	0.85%
过去三年	-41.56%	1.29%	-30.63%	0.94%	-10.93%	0.35%
自基金合同生效起至今	303.85%	1.58%	182.82%	1.43%	121.03%	0.15%

光大保德信量化股票 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
过去一个月	-5.00%	1.01%	-2.97%	0.43%	-2.03%	0.58%
过去三个月	-3.99%	1.37%	-1.91%	0.68%	-2.08%	0.69%
过去六个月	-18.20%	2.24%	0.86%	0.81%	-19.06%	1.43%
过去一年	-21.78%	1.64%	-8.86%	0.79%	-12.92%	0.85%
自基金合同生效起至今	-18.29%	1.54%	-12.72%	0.78%	-5.57%	0.76%

注：为更好地反映债券市场整体运行情况和本基金管理人旗下相关基金投资组合的运作情况，经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致，自 2014 年 4 月 1 日起，将本基金的业绩比较基准由原“90%×富时中国 A200 指数+10%×同业存款利率”变更为“90%×沪深 300 指数+10%×同业

存款利率”。

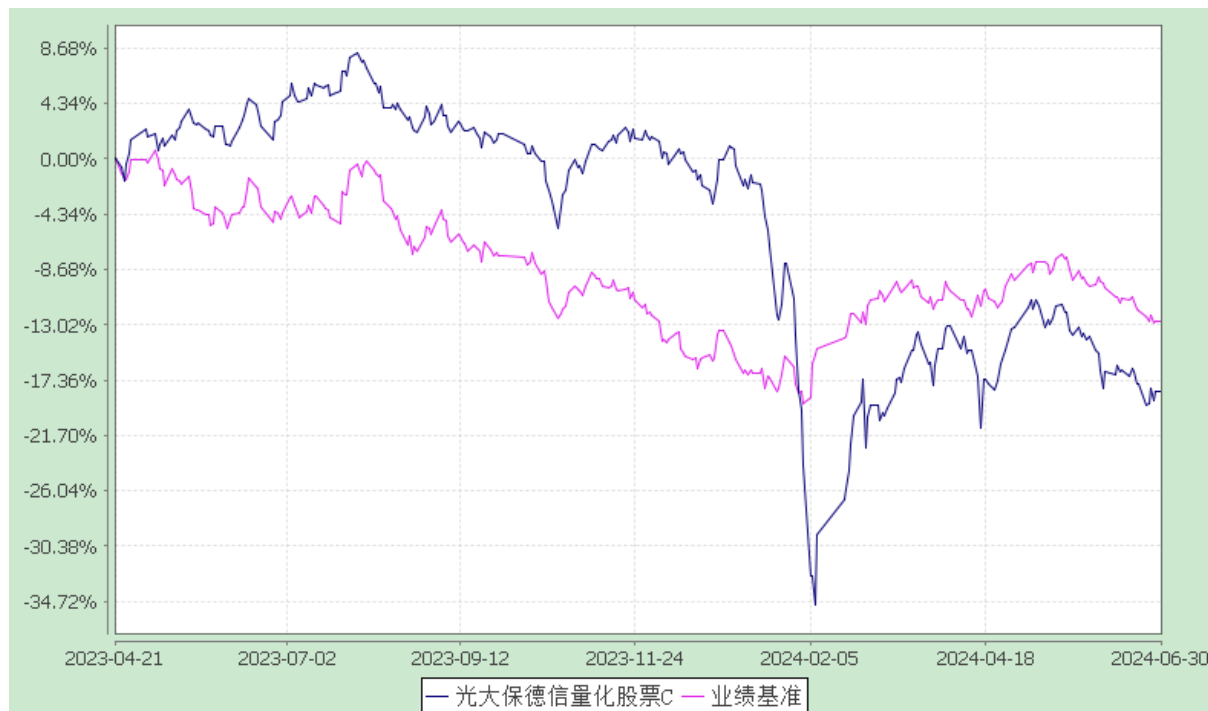
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

光大保德信量化核心证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2004 年 8 月 27 日至 2024 年 6 月 30 日)

光大保德信量化股票 A



光大保德信量化股票 C



注：本基金 C 类份额设立于 2023 年 4 月 21 日。

为更好地反映债券市场整体运行情况和本基金管理人旗下相关基金投资组合的运作情况，经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致，自 2014 年 4 月 1 日起，将本基金的业绩比较基准由原“90%×富时中国 A200 指数+10%×同业存款利率”变更为“90%×沪深 300 指数+10%×同业存款利率”。

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 2024 年 6 月 30 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

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、光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金、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、光大保德信

鼎利 90 天滚动持有债券型证券投资基金。

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		
韩羽辰	基金经理	2023-08-03	-	7 年	韩羽辰先生, 纽约大学金融工程专业硕士。2017 年 8 月加入光大保德信基金管理有限公司, 历任研究助理、量化研究员, 2020 年 9 月至 2023 年 7 月历任权益管理总部专户权益投资团队投资经理, 现任权益管理总部量化投资团队基金经理, 2023 年 8 月至今担任光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信风格轮动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、光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理, 2023 年 12 月至今担任光大保德信一带一路战略主题混合型证券投资基金的基金经理。
王卫林	基金经理	2023-08-22	-	8 年	王卫林先生, 北京大学软件工程专业硕士。2016 年 7 月至 2018 年 1 月在南方基金管理有限公司任职量化研究员; 2018 年 1 月至 2023 年 2 月在长城基金管理有限公司任职量化与指数投资部研究员、基金经理助理、基金经理; 2023 年 2 月加入光大保德信基金管理有限公司, 现任权益管理总部量化投资团队基金经理, 2023 年 8 月至今担任光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金、光大保德信创业板量化优选股票型证券投资基金、光大保德信锦弘混合型证券投资基金的基金经理。
朱剑涛	权益管理总部量化投资团队副团队长（主持工作）、基金	2024-05-06	-	16 年	朱剑涛先生, 2008 年毕业于复旦大学, 获得理学硕士。2008 年 7 月至 2010 年 8 月在华宝信托有限责任公司任职量化研究助理; 2010

	<p>经理</p>			<p>年 9 月至 2015 年 3 月在海通证券股份有限公司任职金融工程高级分析师；2015 年 4 月至 2022 年 5 月在东方证券股份有限公司任职金融工程首席分析师；2022 年 6 月至 2023 年 8 月在海南进化论私募基金管理有限公司任职量化研究负责人；2023 年 8 月加入光大保德信基金管理有限公司，现任权益管理总部量化投资团队副团队长（主持工作），2024 年 5 月至今担任光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信一带一路战略主题混合型证券投资基金的基金经理。</p>
--	-----------	--	--	---

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。本基金与本公司其他投资组合参与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% 的情况有 1 次，由投资组合策略

不同导致，未发现利益输送或异常交易的问题。

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

纵观 2024 年上半年，宏观经济在曲折中稳步复苏，一季度经济增长取得开门红，二季度略有放缓，其中出口的回暖较为明显。股票市场方面，A 股整体行业风格分化较为显著，以银行、煤炭、公用事业为代表的红利资产和大盘价值风格持续跑赢市场整体，同时受益于出海链的家电、摩托等行业也有阶段性表现。

本基金将继续使用量化策略模型优选个股，注重基本面指标与技术面相结合，保持行业均衡配置，力争基金资产的保值增值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内光大量化 A 份额净值增长率为-17.72%，业绩比较基准收益率为 0.86%；光大量化 C 份额净值增长率为-18.20%，业绩比较基准收益率为 0.86%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预计 2024 年下半年宏观经济有望持续向上修复，经济增长动能或将持续温和改善，前期密集出台的经济政策有利于推动重要领域景气度回升。展望下半年，基本面稳定、现金流平稳的红利资产有望成持续获得市场关注，同时受益于出海链和行业预期有所改善的领域也呈现一定投资价值。当前 A 股市场各主要宽基指数的估值仍处于合理偏低的区间，中长期配置价值值得期待。此外，资金面预计将逐步修复，美联储进入降息周期的时点有待验证，市场风格或将呈现阶段性轮动的状态，整体相对均衡。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》及监管机关有关规定和《光大保德信基金管理有限公司基金估值委员会工作制度》进行。日常估值由基金管理人和本基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计的财务核对同时进行。

报告期内，公司设立由负责运营的高管、运营部代表（包括基金会计）、投研部门代表、监察稽核部代表、IT 部代表、金融工程部门代表人员组成的估值委员会。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，选择基金估值模型及估值模型假设，定期评价现有估值政策和程

程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。基金估值政策的议定和修改采用集体决策机制，对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由公司估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行、审计师沟通后形成建议，经公司管理层批准后由运营部具体执行。估值委员会向公司管理层提交推荐建议前，应审慎平衡托管行、审计师和基金同业的意见，并必须获得估值委员会二分之一以上成员同意。

公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和长期相关工作经历，并具有广泛的代表性。

委员会对各相关部门和代表人员的分工如下：投资研究部和运营部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；运营部根据估值的专业技术对需要进行估值政策调整的品种提出初步意见提交估值委员会讨论，负责执行基金估值政策进行日常估值业务，负责与托管行、审计师、基金同业、监管机关沟通估值调整事项；监察稽核部就估值程序的合法合规发表意见；金融工程负责估值政策调整对投资绩效的评估；IT 部就估值政策调整的技术实现进行评估。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、基金合同以及基金实际运作情况，本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

中国光大银行股份有限公司在光大保德信量化核心证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对光大保德信量化核心证券投资基金的投资运作进行了全面的会计

核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《光大保德信量化核心证券投资基金 2024 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：光大保德信量化核心证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	96,286,161.14	128,870,362.51
结算备付金		5,576,362.16	9,484,264.84
存出保证金		495,683.66	599,618.18
交易性金融资产	6.4.7.2	838,749,205.38	1,592,087,400.04
其中：股票投资		838,749,205.38	1,592,087,400.04
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-9,052.04
应收清算款		9,270.83	80,188,953.76
应收股利		-	-
应收申购款		42,025.79	78,024.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		941,158,708.96	1,811,299,571.66
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		417,148.94	612,739.64
应付管理人报酬		933,117.32	1,805,763.90
应付托管费		155,519.55	300,960.66
应付销售服务费		27.74	74,827.22
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	885.87
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	8,408,565.29	15,650,476.96
负债合计		9,914,378.84	18,445,654.25
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	436,040,905.84	846,548,490.03
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	495,203,424.28	946,305,427.38
净资产合计		931,244,330.12	1,792,853,917.41
负债和净资产总计		941,158,708.96	1,811,299,571.66

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.7817 元，基金份额总额 1,191,363,149.11 份。其中 A 类基金份额净值 0.7817 元，份额总额 1,191,234,299.81 份；C 类基金份额净值 0.7769 元，份额总额 128,849.30 份。

6.2 利润表

会计主体：光大保德信量化核心证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-360,797,338.60	96,583,140.21
1.利息收入		473,581.02	494,224.12
其中：存款利息收入	6.4.7.9	449,601.75	494,224.12
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		23,979.27	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-309,326,563.49	73,666,820.80
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-321,052,788.62	61,913,482.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	11,726,225.13	11,753,338.49
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-52,546,321.15	22,412,432.61
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	601,965.02	9,662.68
减：二、营业总支出		8,134,966.41	11,130,746.78
1. 管理人报酬	6.4.10.2	6,774,547.49	9,446,705.59
2. 托管费	6.4.10.2	1,129,091.33	1,574,450.92
3. 销售服务费	6.4.10.2	121,226.18	-
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	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		86.33	-
8. 其他费用	6.4.7.19	110,015.08	109,590.27
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-368,932,305.01	85,452,393.43
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-368,932,305.01	85,452,393.43
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-368,932,305.01	85,452,393.43

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：光大保德信量化核心证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	846,548,490.03	-	946,305,427.38	1,792,853,917.41
二、本期期初净资产	846,548,490.03	-	946,305,427.38	1,792,853,917.41
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-410,507,584.19	-	-451,102,003.10	-861,609,587.29
（一）、综合收益总额	-	-	-368,932,305.01	-368,932,305.01
（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）	-410,507,584.19	-	-82,169,698.09	-492,677,282.28
其中：1.基金申购款	180,643,202.28	-	54,438,146.72	235,081,349.00
2.基金赎回款	-591,150,786.47	-	-136,607,844.81	-727,758,631.28
（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	436,040,905.84	-	495,203,424.28	931,244,330.12
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	481,690,610.96	-	737,902,463.19	1,219,593,074.15
二、本期期初净资产	481,690,610.96	-	737,902,463.19	1,219,593,074.15

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-11,968,731.78	-	65,334,248.21	53,365,516.43
（一）、综合收益总额	-	-	85,452,393.43	85,452,393.43
（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）	-11,968,731.78	-	-20,118,145.22	-32,086,877.00
其中：1.基金申购款	3,121,541.10	-	5,233,078.72	8,354,619.82
2.基金赎回款	-15,090,272.88	-	-25,351,223.94	-40,441,496.82
（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	469,721,879.18	-	803,236,711.40	1,272,958,590.58

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘翔，主管会计工作负责人：贺敬哲，会计机构负责人：王永万

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

光大保德信量化核心证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2004]85 号文《关于同意光大保德信量化核心证券投资基金设立的批复》的核准，由基金管理人光大保德信基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2004 年 8 月 27 日正式生效，首次设立募集规模为 2,544,287,215.94 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为光大保德信基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

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

范围为 5-15%。本基金的业绩比较基准为 90%×沪深 300 指数+10%×同业存款利率。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《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。

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期

限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	96,286,161.14
等于：本金	96,269,459.19
加：应计利息	16,701.95
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	96,286,161.14

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	862,419,816.37	-	838,749,205.38	-23,670,610.99
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-

	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计	862,419,816.37	-	838,749,205.38	-23,670,610.99	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	206.16
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	8,178,960.75
其中：交易所市场	8,178,960.75
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	49,726.04
预提信息披露费	179,672.34
合计	8,408,565.29

6.4.7.7 实收基金

光大保德信量化股票 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	1,641,249,646.23	600,595,621.04
本期申购	160,719,012.32	58,812,323.60
本期赎回（以“-”号填列）	-610,734,358.74	-223,495,888.10
本期末	1,191,234,299.81	435,912,056.54

光大保德信量化股票 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	245,952,868.99	245,952,868.99
本期申购	121,830,878.68	121,830,878.68
本期赎回（以“-”号填列）	-367,654,898.37	-367,654,898.37
本期末	128,849.30	128,849.30

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

光大保德信量化股票 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	819,415,656.83	139,256,721.86	958,672,378.69
本期期初	819,415,656.83	139,256,721.86	958,672,378.69
本期利润	-301,180,902.51	-8,207,770.96	-309,388,673.47
本期基金份额交易产生的变动数	-182,022,463.83	27,970,929.86	-154,051,533.97
其中：基金申购款	58,741,995.97	15,281,458.79	74,023,454.76
基金赎回款	-240,764,459.80	12,689,471.07	-228,074,988.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	336,212,290.49	159,019,880.76	495,232,171.25

光大保德信量化股票 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
上年度末	-33,266,965.54	20,900,014.23	-12,366,951.31
本期期初	-33,266,965.54	20,900,014.23	-12,366,951.31

本期利润	-15,205,081.35	-44,338,550.19	-59,543,631.54
本期基金份额交易产生的变动数	48,426,111.51	23,455,724.37	71,881,835.88
其中：基金申购款	-31,622,337.92	12,037,029.88	-19,585,308.04
基金赎回款	80,048,449.43	11,418,694.49	91,467,143.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-45,935.38	17,188.41	-28,746.97

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	378,858.76
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	65,739.90
其他	5,003.09
合计	449,601.75

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	5,126,454,168.79
减：卖出股票成本总额	5,436,132,260.23
减：交易费用	11,374,697.18
买卖股票差价收入	-321,052,788.62

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	11,726,225.13
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	11,726,225.13

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	-52,546,321.15
——股票投资	-52,546,321.15
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-52,546,321.15

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	601,802.64
转换费收入	162.38
合计	601,965.02

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	49,726.04
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	616.70

合计	110,015.08
----	------------

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本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（“光大保德信”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司（“光大银行”）	基金托管人、基金代销机构
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	1,576,076,952.78	15.98%	3,309,614,865.91	51.01%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024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	1,476,169.03	18.05%	1,476,169.03	18.05%
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
光大证券	3,065,159.53	51.33%	810,022.35	36.08%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月 30日
	当期发生的基金应支付的管理费	6,774,547.49
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,002,739.38	3,061,094.72
应支付基金管理人的净管理费	4,771,808.11	6,385,610.87

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,129,091.33	1,574,450.92

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	光大保德信量化股票 A	光大保德信量化股票 C	合计
光大保德信	-	111,690.91	111,690.91
合计	-	111,690.91	111,690.91
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	光大保德信量化股票 A	光大保德信量化股票 C	合计
光大证券	-	-	-
光大保德信	-	-	-
光大银行	-	-	-
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 4 月 21 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 0.40% 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 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。

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 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

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	光大保德信量化股票A	光大保德信量化股票C	光大保德信量化股票A	光大保德信量化股票C
期初持有的基金份额	-	10,028.66	-	-
期间申购/买入总份额	-	0.00	-	-
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	-	10,028.66	-	-
期末持有的基金份额	-	7.78%	-	-

占基金总份额比例				
----------	--	--	--	--

注：本报告期内和上年度可比期间管理人未投资本基金。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行	96,286,161.14	378,858.76	125,669,510.85	448,110.01

6.4.10.7 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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2024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	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688717	艾罗能源	2023-12-26	6个月	新股流通	55.66	47.02	11,303.00	629,124.98	531,467.06	-

				受限						
301589	诺瓦星云	2024-02-01	6 个月	新股流通受限	70.48	188.01	1,244.00	87,680.99	233,884.44	-
688692	达梦数据	2024-06-04	6 个月	新股流通受限	86.96	174.93	175.00	15,218.00	30,612.75	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1 个月以内	新股未上市	18.65	18.65	1,158.00	21,596.70	21,596.70	-
688709	成都华微	2024-01-31	6 个月	新股流通受限	15.69	18.79	1,045.00	16,396.05	19,635.55	-
603350	安乃达	2024-06-26	1 个月以内	新股未上市	20.56	20.56	945.00	19,429.20	19,429.20	-
301536	星辰科技	2024-03-20	6 个月	新股流通受限	16.16	32.27	481.00	7,772.96	15,521.87	-
688584	上海合晶	2024-02-01	6 个月	新股流通受限	22.66	15.89	866.00	19,623.56	13,760.74	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6 个月	新股流通受限	39.82	91.24	150.00	5,972.74	13,686.00	-
301565	中仑新材	2024-06-13	6 个月	新股流通受限	11.88	18.98	711.00	8,446.68	13,494.78	-
603341	龙旗科技	2024-02-23	6 个月	新股流通受限	26.00	37.49	298.00	7,748.00	11,172.02	-
688691	灿芯股份	2024-04-02	6 个月	新股流通受限	19.86	42.51	247.00	4,905.42	10,499.97	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6 个月	新股流通受限	8.90	16.97	576.00	5,126.40	9,774.72	-
301392	汇成真空	2024-05-28	6 个月	新股流通受限	12.20	41.66	219.00	2,671.80	9,123.54	-
301591	肯特股份	2024-02-20	6 个月	新股流通受限	19.43	36.98	219.00	4,255.17	8,098.62	-
30158	中瑞	2024-0	6 个月	新股	21.73	25.26	306.00	6,649.	7,729.	-

7	股份	3-27		流通受限				38	56	
001389	广合科技	2024-03-26	6个月	新股流通受限	17.43	34.56	222.00	3,869.46	7,672.32	-
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6个月	新股流通受限	10.64	19.82	361.00	3,841.04	7,155.02	-
688695	中创股份	2024-03-06	6个月	新股流通受限	22.43	31.55	186.00	4,171.98	5,868.30	-
688530	欧莱新材	2024-04-29	6个月	新股流通受限	9.60	16.10	344.00	3,302.40	5,538.40	-
301588	美新科技	2024-03-06	6个月	新股流通受限	14.50	21.25	257.00	3,726.50	5,461.25	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6个月	新股流通受限	28.01	37.83	138.00	3,865.38	5,220.54	-
603325	博隆技术	2024-01-03	6个月	新股流通受限	72.46	68.06	66.00	4,782.36	4,491.96	-
603381	永臻股份	2024-06-19	6个月	新股流通受限	23.35	25.13	178.00	4,156.30	4,473.14	-
603344	星德胜	2024-03-13	6个月	新股流通受限	19.18	22.66	182.00	3,490.76	4,124.12	-
001359	平安电工	2024-03-19	6个月	新股流通受限	17.39	20.60	184.00	3,199.76	3,790.40	-
603312	西典新能	2024-01-04	6个月	新股流通受限	29.02	25.36	130.00	3,772.60	3,296.80	-
603082	北自科技	2024-01-23	6个月	新股流通受限	21.28	29.49	107.00	2,276.96	3,155.43	-
001379	腾达科技	2024-01-11	6个月	新股流通受限	16.98	13.48	213.00	3,616.74	2,871.24	-
001387	雪祺电气	2024-01-04	6个月	新股流通受限	11.82	15.25	173.00	2,045.54	2,638.25	-

603285	键邦股份	2024-06-28	6 个月	新股流通受限	18.65	18.65	129.00	2,405.85	2,405.85	-
603350	安乃达	2024-06-26	6 个月	新股流通受限	20.56	20.56	106.00	2,179.36	2,179.36	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 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 2024 年 6 月 30 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 0.00%(2023 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为结算备付金、存出保证金及银行存款等。本基金通过监控组合的久期来评估基金面临的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024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							
货币资金	96,286,161.14	-	-	-	-	-	96,286,161.14
结算备付金	5,576,362.16	-	-	-	-	-	5,576,362.16
存出保证金	495,683.66	-	-	-	-	-	495,683.66
交易性金融资产	-	-	-	-	-	838,749,205.38	838,749,205.38
应收证券清算款	-	-	-	-	-	9,270.83	9,270.83
应收申购款	-	-	-	-	-	42,025.79	42,025.79
资产总计	102,358,206.96	-	-	-	-	838,800,502.00	941,158,708.96
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	417,148.94	417,148.94
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	933,117.32	933,117.32
应付托管费	-	-	-	-	-	155,519.55	155,519.55
应付销售服务	-	-	-	-	-	27.74	27.74

费							
其他负债	-	-	-	-	-	8,408,565.29	8,408,565.29
负债总计	-	-	-	-	-	9,914,378.84	9,914,378.84
利率敏感度缺口	102,358,206.96	-	-	-	-	828,886,123.16	931,244,330.12
上年度末 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	128,870,362.51	-	-	-	-	-	128,870,362.51
结算备付金	9,484,264.84	-	-	-	-	-	9,484,264.84
存出保证金	599,618.18	-	-	-	-	-	599,618.18
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,592,087,400.04	1,592,087,400.04
买入返售金融资产	-9,052.04	-	-	-	-	-	-9,052.04
应收清算款	-	-	-	-	-	80,188,953.76	80,188,953.76
应收申购款	-	-	-	-	-	78,024.37	78,024.37
资产总计	138,945,193.49	-	-	-	-	1,672,354,378.17	1,811,299,571.66
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	612,739.64	612,739.64
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,805,763.90	1,805,763.90
应付托管费	-	-	-	-	-	300,960.66	300,960.66
应付销售服务费	-	-	-	-	-	74,827.22	74,827.22
应交税费	-	-	-	-	-	885.87	885.87
其他负债	-	-	-	-	-	15,650,476.96	15,650,476.96
负债总计	-	-	-	-	-	18,445,654.	18,445,654.

						25	25
利率敏感度缺	138,945,19					1,653,908,7	1,792,853,9
口	3.49	-	-	-	-	23.92	17.41

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末及上年度末持有的交易性固定收益类投资比例较低，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的基金管理人每日对投资组合的行业和个券的集中度进行监控，并定期分析其相对业绩比较基准的偏离度。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，通过压力测试来评估本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	838,749,205. 38	90.07	1,592,087,400 .04	88.80
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	838,749,205. 38	90.07	1,592,087,400 .04	88.80

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金未来业绩表现相对业绩基准的波动性与其过去一年的整体水平保持一致。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
	业绩比较基准上升 1%	增加约 11,458,233.76	增加约 12,627,949.14
	业绩比较基准下降 1%	减少约 11,458,233.76	减少约 12,627,949.14

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 2024年6月30日
第一层次	837,709,375.48
第二层次	41,025.90
第三层次	998,804.00
合计	838,749,205.38

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。

6.4.14.3 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。

6.4.14.4 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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7 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	838,749,205.38	89.12
	其中：股票	838,749,205.38	89.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	101,862,523.30	10.82
8	其他各项资产	546,980.28	0.06
9	合计	941,158,708.96	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	3,941,935.00	0.42
B	采矿业	70,738,380.40	7.60
C	制造业	496,361,287.09	53.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	43,975,601.64	4.72
E	建筑业	18,142,056.94	1.95
F	批发和零售业	33,406,908.26	3.59
G	交通运输、仓储和邮政业	31,578,629.30	3.39
H	住宿和餐饮业	2,270,520.00	0.24
I	信息传输、软件和信息技术服务业	35,678,936.19	3.83
J	金融业	65,042,004.50	6.98
K	房地产业	11,973,986.08	1.29
L	租赁和商务服务业	115,710.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	7,682,440.42	0.82
N	水利、环境和公共设施管理业	17,146,227.50	1.84
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	17,664.00	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	676,918.06	0.07
S	综合	-	-
	合计	838,749,205.38	90.07

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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	600900	长江电力	552,450	15,976,854.00	1.72
2	000975	银泰黄金	649,200	10,575,468.00	1.14

3	601288	农业银行	2,422,400	10,561,664.00	1.13
4	601857	中国石油	848,600	8,757,552.00	0.94
5	601088	中国神华	195,900	8,692,083.00	0.93
6	002078	太阳纸业	579,700	8,086,815.00	0.87
7	603588	高能环境	1,276,500	8,016,420.00	0.86
8	600519	贵州茅台	5,400	7,923,906.00	0.85
9	600036	招商银行	191,200	6,537,128.00	0.70
10	300303	聚飞光电	1,203,300	5,848,038.00	0.63
11	600941	中国移动	53,400	5,740,500.00	0.62
12	603380	易德龙	285,700	5,736,856.00	0.62
13	002139	拓邦股份	537,000	5,702,940.00	0.61
14	002729	好利科技	611,700	5,676,576.00	0.61
15	603629	利通电子	307,100	5,669,066.00	0.61
16	601298	青岛港	591,200	5,651,872.00	0.61
17	601117	中国化学	683,900	5,635,336.00	0.61
18	600760	中航沈飞	140,500	5,634,050.00	0.61
19	002282	博深股份	880,600	5,627,034.00	0.60
20	002138	顺络电子	204,500	5,615,570.00	0.60
21	600989	宝丰能源	323,900	5,613,187.00	0.60
22	600028	中国石化	886,900	5,605,208.00	0.60
23	600018	上港集团	966,500	5,586,370.00	0.60
24	600901	江苏金租	1,101,200	5,561,060.00	0.60
25	601899	紫金矿业	316,500	5,560,905.00	0.60
26	300408	三环集团	190,400	5,557,776.00	0.60
27	001965	招商公路	468,300	5,554,038.00	0.60
28	601985	中国核电	520,600	5,549,596.00	0.60
29	601398	工商银行	973,400	5,548,380.00	0.60
30	300269	联建光电	2,202,300	5,527,773.00	0.59
31	601628	中国人寿	177,800	5,520,690.00	0.59
32	600219	南山铝业	1,445,900	5,508,879.00	0.59
33	600803	新奥股份	264,513	5,501,870.40	0.59
34	300384	三联虹普	417,662	5,479,725.44	0.59
35	600161	天坛生物	224,320	5,473,408.00	0.59
36	603408	建霖家居	413,900	5,459,341.00	0.59
37	600547	山东黄金	198,900	5,445,882.00	0.58
38	300760	迈瑞医疗	18,700	5,440,017.00	0.58
39	002415	海康威视	175,800	5,433,978.00	0.58
40	000333	美的集团	83,800	5,405,100.00	0.58
41	600323	瀚蓝环境	258,400	5,400,560.00	0.58
42	002697	红旗连锁	1,162,200	5,380,986.00	0.58
43	603501	韦尔股份	54,135	5,379,394.95	0.58
44	002128	电投能源	254,600	5,372,060.00	0.58
45	601601	中国太保	192,700	5,368,622.00	0.58
46	600999	招商证券	385,200	5,358,132.00	0.58

47	002048	宁波华翔	413,500	5,350,690.00	0.57
48	000513	丽珠集团	143,407	5,336,174.47	0.57
49	002053	云南能投	440,300	5,323,227.00	0.57
50	000708	中信特钢	392,200	5,322,154.00	0.57
51	603195	公牛集团	68,940	5,316,652.80	0.57
52	600276	恒瑞医药	137,360	5,282,865.60	0.57
53	601668	中国建筑	994,700	5,281,857.00	0.57
54	600967	内蒙一机	724,600	5,217,120.00	0.56
55	600309	万华化学	63,800	5,158,868.00	0.55
56	600380	健康元	460,000	5,138,200.00	0.55
57	301123	奕东电子	284,700	5,110,365.00	0.55
58	002563	森马服饰	871,600	5,063,996.00	0.54
59	002765	蓝黛科技	1,076,100	5,057,670.00	0.54
60	600235	民丰特纸	1,097,500	5,048,500.00	0.54
61	002897	意华股份	131,000	4,933,460.00	0.53
62	003025	思进智能	398,100	4,900,611.00	0.53
63	600704	物产中大	1,128,400	4,897,256.00	0.53
64	601988	中国银行	1,041,100	4,809,882.00	0.52
65	601166	兴业银行	259,300	4,568,866.00	0.49
66	600007	中国国贸	207,100	4,547,916.00	0.49
67	002595	豪迈科技	119,000	4,542,230.00	0.49
68	603993	洛阳钼业	533,400	4,533,900.00	0.49
69	600885	宏发股份	161,700	4,475,856.00	0.48
70	000738	航发控制	222,800	4,471,596.00	0.48
71	000830	鲁西化工	372,900	4,321,911.00	0.46
72	000034	神州数码	186,500	4,268,985.00	0.46
73	002529	海源复材	812,200	4,190,952.00	0.45
74	601229	上海银行	564,600	4,098,996.00	0.44
75	600513	联环药业	504,600	4,092,306.00	0.44
76	603579	荣泰健康	257,480	3,980,640.80	0.43
77	002106	莱宝高科	355,200	3,871,680.00	0.42
78	600875	东方电气	205,700	3,795,165.00	0.41
79	600985	淮北矿业	223,700	3,744,738.00	0.40
80	601311	骆驼股份	465,100	3,730,102.00	0.40
81	301382	蜂助手	204,050	3,691,264.50	0.40
82	600177	雅戈尔	516,160	3,675,059.20	0.39
83	600886	国投电力	195,000	3,556,800.00	0.38
84	600887	伊利股份	137,500	3,553,000.00	0.38
85	600329	达仁堂	108,700	3,520,793.00	0.38
86	600362	江西铜业	147,200	3,485,696.00	0.37
87	000598	兴蓉环境	460,500	3,462,960.00	0.37
88	002601	龙佰集团	181,700	3,374,169.00	0.36
89	600660	福耀玻璃	66,800	3,199,720.00	0.34
90	601611	中国核建	392,900	3,178,561.00	0.34

91	600663	陆家嘴	359,000	3,166,380.00	0.34
92	300652	雷迪克	159,468	3,162,250.44	0.34
93	600690	海尔智家	110,400	3,133,152.00	0.34
94	601100	恒立液压	66,800	3,111,544.00	0.33
95	605016	百龙创园	150,910	3,074,036.70	0.33
96	603299	苏盐井神	322,100	3,059,950.00	0.33
97	002351	漫步者	228,600	3,006,090.00	0.32
98	601211	国泰君安	220,900	2,993,195.00	0.32
99	300551	古鳌科技	529,069	2,978,658.47	0.32
100	000915	华特达因	96,100	2,898,376.00	0.31
101	601225	陕西煤业	110,800	2,855,316.00	0.31
102	600546	山煤国际	188,900	2,761,718.00	0.30
103	600980	北矿科技	205,900	2,682,877.00	0.29
104	603897	长城科技	148,900	2,613,195.00	0.28
105	601666	平煤股份	231,100	2,588,320.00	0.28
106	605198	安德利	95,500	2,521,200.00	0.27
107	600782	新钢股份	757,500	2,514,900.00	0.27
108	002788	鹭燕医药	316,200	2,491,656.00	0.27
109	300840	酷特智能	268,000	2,479,000.00	0.27
110	000955	欣龙控股	837,200	2,452,996.00	0.26
111	603015	弘讯科技	321,100	2,427,516.00	0.26
112	601318	中国平安	58,100	2,403,016.00	0.26
113	301067	显盈科技	121,500	2,394,765.00	0.26
114	600350	山东高速	270,200	2,391,270.00	0.26
115	300889	爱克股份	212,800	2,387,616.00	0.26
116	002730	电光科技	333,000	2,344,320.00	0.25
117	002981	朝阳科技	127,420	2,333,060.20	0.25
118	002179	中航光电	61,300	2,332,465.00	0.25
119	002134	天津普林	246,700	2,301,711.00	0.25
120	603045	福达合金	231,300	2,296,809.00	0.25
121	300789	唐源电气	173,380	2,295,551.20	0.25
122	603331	百达精工	253,000	2,294,710.00	0.25
123	601616	广电电气	787,800	2,292,498.00	0.25
124	300872	天阳科技	172,900	2,290,925.00	0.25
125	003017	大洋生物	140,820	2,289,733.20	0.25
126	600130	波导股份	717,000	2,287,230.00	0.25
127	600097	开创国际	277,000	2,279,710.00	0.24
128	300076	GQY 视讯	711,041	2,275,331.20	0.24
129	601007	金陵饭店	357,000	2,270,520.00	0.24
130	300701	森霸传感	269,375	2,265,443.75	0.24
131	002879	长缆科技	172,500	2,264,925.00	0.24
132	000605	渤海股份	489,100	2,264,533.00	0.24
133	000159	国际实业	433,500	2,262,870.00	0.24
134	000419	通程控股	552,000	2,257,680.00	0.24

135	603681	永冠新材	177,000	2,256,750.00	0.24
136	600386	北巴传媒	808,800	2,256,552.00	0.24
137	300771	智莱科技	256,450	2,254,195.50	0.24
138	600854	春兰股份	658,500	2,252,070.00	0.24
139	600128	苏豪弘业	352,400	2,244,788.00	0.24
140	002492	恒基达鑫	487,800	2,243,880.00	0.24
141	600183	生益科技	106,500	2,242,890.00	0.24
142	605001	威奥股份	460,500	2,242,635.00	0.24
143	600202	哈空调	627,600	2,240,532.00	0.24
144	002774	快意电梯	352,500	2,238,375.00	0.24
145	002722	物产金轮	198,000	2,237,400.00	0.24
146	002598	山东章鼓	301,500	2,237,130.00	0.24
147	603089	正裕工业	267,000	2,232,120.00	0.24
148	300884	狄耐克	258,800	2,230,856.00	0.24
149	002998	优彩资源	393,300	2,230,011.00	0.24
150	002286	保龄宝	404,300	2,227,693.00	0.24
151	301321	翰博高新	193,500	2,227,185.00	0.24
152	002863	今飞凯达	547,100	2,226,697.00	0.24
153	002360	同德化工	439,448	2,223,606.88	0.24
154	002687	乔治白	529,427	2,223,593.40	0.24
155	300987	川网传媒	183,030	2,221,984.20	0.24
156	603080	新疆火炬	165,050	2,221,573.00	0.24
157	000548	湖南投资	552,500	2,221,050.00	0.24
158	605155	西大门	242,400	2,217,960.00	0.24
158	000619	海螺新材	549,000	2,217,960.00	0.24
160	603903	中持股份	316,300	2,217,263.00	0.24
161	300150	世纪瑞尔	858,900	2,215,962.00	0.24
162	600594	益佰制药	738,000	2,214,000.00	0.24
163	002054	德美化工	450,800	2,213,428.00	0.24
164	002743	富煌钢构	599,600	2,212,524.00	0.24
165	002566	益盛药业	361,500	2,212,380.00	0.24
166	603020	爱普股份	331,500	2,211,105.00	0.24
167	300642	透景生命	189,900	2,210,436.00	0.24
168	002357	富临运业	430,800	2,210,004.00	0.24
169	605208	永茂泰	354,700	2,209,781.00	0.24
170	002133	广宇集团	990,500	2,208,815.00	0.24
171	600082	海泰发展	1,104,276	2,208,552.00	0.24
172	000153	丰原药业	410,480	2,208,382.40	0.24
173	600858	银座股份	561,700	2,207,481.00	0.24
174	002820	桂发祥	298,202	2,203,712.78	0.24
175	003033	征和工业	95,100	2,203,467.00	0.24
176	002365	永安药业	305,100	2,202,822.00	0.24
177	002295	精艺股份	414,000	2,202,480.00	0.24
178	002136	安纳达	243,000	2,201,580.00	0.24

179	688287	观典防务	418,500	2,201,310.00	0.24
180	300808	久量股份	135,000	2,199,150.00	0.24
181	300440	运达科技	418,800	2,198,700.00	0.24
182	002753	永东股份	378,000	2,196,180.00	0.24
183	603321	梅轮电梯	321,000	2,192,430.00	0.24
184	600222	太龙药业	522,000	2,192,400.00	0.24
185	603630	拉芳家化	208,500	2,191,335.00	0.24
186	603183	建研院	681,090	2,186,298.90	0.23
187	603937	丽岛新材	281,400	2,183,664.00	0.23
188	603811	诚意药业	349,000	2,181,250.00	0.23
189	300086	康芝药业	620,600	2,178,306.00	0.23
190	603829	洛凯股份	184,000	2,176,720.00	0.23
191	301012	扬电科技	87,500	2,166,500.00	0.23
192	300583	赛托生物	178,300	2,166,345.00	0.23
193	300006	莱美药业	924,000	2,162,160.00	0.23
194	600249	两面针	588,400	2,159,428.00	0.23
195	688616	西力科技	190,294	2,157,933.96	0.23
196	002152	广电运通	206,100	2,155,806.00	0.23
197	300694	蠡湖股份	252,800	2,151,328.00	0.23
198	002817	黄山胶囊	402,200	2,147,748.00	0.23
199	002628	成都路桥	1,109,700	2,141,721.00	0.23
200	605336	帅丰电器	188,570	2,125,183.90	0.23
201	600831	ST 广网	791,100	2,120,148.00	0.23
202	600602	云赛智联	192,000	2,119,680.00	0.23
203	600533	栖霞建设	1,044,000	2,046,240.00	0.22
204	688682	霍莱沃	68,792	2,018,357.28	0.22
205	601168	西部矿业	112,400	2,017,580.00	0.22
206	605183	确成股份	129,500	2,002,070.00	0.21
207	601006	大秦铁路	267,700	1,916,732.00	0.21
208	002953	日丰股份	242,450	1,900,808.00	0.20
209	601000	唐山港	403,800	1,897,860.00	0.20
210	605287	德才股份	150,050	1,889,129.50	0.20
211	000030	富奥股份	376,600	1,849,106.00	0.20
212	002352	顺丰控股	51,200	1,827,328.00	0.20
213	301262	海看股份	80,700	1,819,785.00	0.20
214	300399	天利科技	206,400	1,814,256.00	0.19
215	301062	上海艾录	176,200	1,799,002.00	0.19
216	300997	欢乐家	151,400	1,789,548.00	0.19
217	000969	安泰科技	220,700	1,750,151.00	0.19
218	600845	宝信软件	54,300	1,733,799.00	0.19
219	002020	京新药业	159,200	1,666,824.00	0.18
220	002772	众兴菌业	277,500	1,662,225.00	0.18
221	603878	武进不锈	251,000	1,641,540.00	0.18
222	600397	安源煤业	901,600	1,622,880.00	0.17

223	603689	皖天然气	196,400	1,614,408.00	0.17
224	000858	五粮液	12,400	1,587,696.00	0.17
225	600027	华电国际	223,800	1,553,172.00	0.17
226	000895	双汇发展	61,200	1,454,724.00	0.16
227	605118	力鼎光电	96,900	1,442,841.00	0.15
228	601609	金田股份	252,800	1,430,848.00	0.15
229	600493	凤竹纺织	310,100	1,348,935.00	0.14
230	300453	三鑫医疗	209,800	1,340,622.00	0.14
231	603979	金诚信	26,000	1,313,780.00	0.14
232	000682	东方电子	117,700	1,299,408.00	0.14
233	002582	好想你	241,500	1,296,855.00	0.14
234	002034	旺能环境	99,200	1,290,592.00	0.14
235	003010	若羽臣	121,920	1,289,913.60	0.14
236	601633	长城汽车	49,900	1,262,470.00	0.14
237	603633	徕木股份	145,100	1,147,741.00	0.12
238	300452	山河药辅	99,800	1,133,728.00	0.12
239	002229	鸿博股份	100,400	1,108,416.00	0.12
240	000999	华润三九	25,900	1,102,822.00	0.12
241	002237	恒邦股份	88,900	1,023,239.00	0.11
242	301019	宁波色母	54,600	1,021,020.00	0.11
243	603165	荣晟环保	91,100	967,482.00	0.10
244	002001	新 和 成	48,000	921,600.00	0.10
245	600489	中金黄金	61,748	913,870.40	0.10
246	002647	仁东控股	275,400	908,820.00	0.10
247	300566	激智科技	64,100	896,759.00	0.10
248	603666	亿嘉和	55,700	878,946.00	0.09
249	300615	欣天科技	88,500	846,945.00	0.09
250	603966	法兰泰克	123,020	845,147.40	0.09
251	000533	顺钠股份	250,500	824,145.00	0.09
252	603358	华达科技	28,200	813,570.00	0.09
253	688307	中润光学	37,500	775,875.00	0.08
254	000712	锦龙股份	101,100	758,250.00	0.08
255	002574	明牌珠宝	180,000	752,400.00	0.08
256	000963	华东医药	24,700	686,907.00	0.07
257	600229	城市传媒	98,000	675,220.00	0.07
258	002667	威领股份	138,200	650,922.00	0.07
259	000551	创元科技	73,100	638,163.00	0.07
260	002159	三特索道	49,500	635,085.00	0.07
261	002971	和远气体	25,100	621,978.00	0.07
262	605177	东亚药业	27,000	595,890.00	0.06
263	603125	常青科技	34,400	592,024.00	0.06
264	601607	上海医药	30,700	586,677.00	0.06
265	600674	川投能源	29,300	549,375.00	0.06
266	688717	艾罗能源	11,303	531,467.06	0.06

267	000063	中兴通讯	18,800	525,836.00	0.06
268	300631	久吾高科	27,000	517,050.00	0.06
269	603881	数据港	40,578	515,746.38	0.06
270	000803	山高环能	144,300	503,607.00	0.05
271	603855	华荣股份	21,600	477,576.00	0.05
272	002177	御银股份	145,500	469,965.00	0.05
273	002017	东信和平	55,100	458,983.00	0.05
274	601089	福元医药	29,400	407,190.00	0.04
275	603298	杭叉集团	20,308	398,849.12	0.04
276	600483	福能股份	33,700	392,942.00	0.04
277	603611	诺力股份	22,700	386,808.00	0.04
278	002066	瑞泰科技	48,000	381,600.00	0.04
279	688205	德科立	12,800	368,768.00	0.04
280	603568	伟明环保	17,900	368,382.00	0.04
281	605007	五洲特纸	25,900	327,117.00	0.04
282	601369	陕鼓动力	39,200	314,384.00	0.03
283	002222	福晶科技	13,640	307,309.20	0.03
284	002014	永新股份	29,460	279,280.80	0.03
285	603915	国茂股份	27,000	277,830.00	0.03
286	688186	广大特材	27,500	267,575.00	0.03
287	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.03
288	688571	杭华股份	42,000	222,180.00	0.02
289	603041	美思德	19,400	194,000.00	0.02
290	688181	八亿时空	10,014	189,765.30	0.02
291	603949	雪龙集团	16,500	185,790.00	0.02
292	688143	长盈通	7,604	162,877.68	0.02
293	603278	大业股份	24,200	150,282.00	0.02
294	603329	上海雅仕	10,500	115,710.00	0.01
295	301011	华立科技	7,000	107,870.00	0.01
296	301003	江苏博云	5,000	107,550.00	0.01
297	688768	容知日新	3,633	85,048.53	0.01
298	003041	真爱美家	6,560	80,097.60	0.01
299	688589	力合微	2,981	75,151.01	0.01
300	603856	东宏股份	7,300	74,314.00	0.01
301	603056	德邦股份	5,000	65,500.00	0.01
302	300597	吉大通信	7,000	50,610.00	0.01
303	301319	唯特偶	1,430	42,942.90	0.00
304	300959	线上线下	1,400	39,354.00	0.00
305	000407	胜利股份	14,600	38,106.00	0.00
306	605288	凯迪股份	1,115	34,520.40	0.00
307	301276	嘉曼服饰	1,492	31,272.32	0.00
308	301373	凌玮科技	1,366	31,144.80	0.00
309	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
310	688557	兰剑智能	1,309	30,342.62	0.00

311	603102	百合股份	1,000	30,110.00	0.00
312	688080	映翰通	945	28,661.85	0.00
313	603040	新坐标	1,400	27,902.00	0.00
314	301290	东星医疗	1,330	26,480.30	0.00
315	301106	骏成科技	880	25,300.00	0.00
316	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
317	688689	银河微电	1,094	23,225.62	0.00
318	688111	金山办公	100	22,750.00	0.00
319	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
320	603320	迪贝电气	1,500	21,210.00	0.00
321	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
322	301181	标榜股份	860	19,504.80	0.00
323	002732	燕塘乳业	1,314	19,013.58	0.00
324	600455	博通股份	1,200	17,664.00	0.00
325	605259	绿田机械	900	17,559.00	0.00
326	001296	长江材料	1,200	17,100.00	0.00
327	688737	中自科技	1,020	16,524.00	0.00
328	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
329	688613	奥精医疗	1,200	15,276.00	0.00
330	603150	万朗磁塑	600	15,024.00	0.00
331	688012	中微公司	100	14,126.00	0.00
332	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
333	300717	华信新材	800	13,752.00	0.00
334	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
335	688237	超卓航科	676	13,553.80	0.00
336	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
337	301257	普蕊斯	440	12,430.00	0.00
338	688393	安必平	805	12,340.65	0.00
339	688722	同益中	1,100	12,309.00	0.00
340	300407	凯发电气	1,495	11,362.00	0.00
341	301178	天亿马	550	11,346.50	0.00
342	603214	爱婴室	1,000	11,290.00	0.00
343	300543	朗科智能	1,400	11,200.00	0.00
344	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
345	003002	壶化股份	1,000	10,970.00	0.00
346	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
347	603232	格尔软件	1,000	10,420.00	0.00
348	605058	澳弘电子	500	9,840.00	0.00
349	688028	沃尔德	596	9,792.28	0.00
350	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
351	300626	华瑞股份	1,300	9,737.00	0.00
352	688045	必易微	317	9,532.19	0.00
353	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
354	300605	恒锋信息	1,000	9,060.00	0.00

355	688607	康众医疗	722	8,967.24	0.00
356	002890	弘宇股份	1,118	8,966.36	0.00
357	600099	林海股份	1,300	8,944.00	0.00
358	300562	乐心医疗	1,000	8,910.00	0.00
359	002873	新天药业	1,066	8,847.80	0.00
360	603725	天安新材	1,400	8,694.00	0.00
361	688132	邦彦技术	500	8,675.00	0.00
362	603637	镇海股份	1,400	8,540.00	0.00
363	603926	铁流股份	1,010	8,383.00	0.00
364	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
365	603898	好莱客	1,100	8,085.00	0.00
366	001206	依依股份	600	7,812.00	0.00
367	601963	重庆银行	1,000	7,750.00	0.00
368	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
369	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
370	688077	大地熊	465	7,360.95	0.00
371	002809	红墙股份	1,000	7,170.00	0.00
372	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
373	601528	瑞丰银行	1,500	7,080.00	0.00
374	603967	中创物流	760	7,068.00	0.00
375	300622	博士眼镜	578	7,034.26	0.00
376	603323	苏农银行	1,400	6,734.00	0.00
377	603192	汇得科技	500	6,715.00	0.00
378	002807	江阴银行	1,700	6,409.00	0.00
379	300040	九洲集团	1,018	6,270.88	0.00
380	601860	紫金银行	2,500	6,250.00	0.00
381	002963	豪尔赛	600	6,138.00	0.00
382	300644	南京聚隆	300	6,114.00	0.00
383	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
384	002576	通达动力	500	5,675.00	0.00
385	301082	久盛电气	521	5,642.43	0.00
386	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
387	600883	博闻科技	900	5,535.00	0.00
388	600192	长城电工	1,200	5,496.00	0.00
389	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
390	300519	新光药业	500	5,425.00	0.00
391	603602	纵横通信	430	5,362.10	0.00
392	600833	第一医药	500	5,225.00	0.00
393	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
394	300838	浙江力诺	500	5,140.00	0.00
395	002948	青岛银行	1,500	5,055.00	0.00
396	003036	泰坦股份	600	4,794.00	0.00
397	300240	飞力达	900	4,788.00	0.00
398	300277	海联讯	700	4,718.00	0.00

399	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
400	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
401	002394	联发股份	700	4,312.00	0.00
402	300845	捷安高科	390	4,223.70	0.00
403	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
404	002839	张家港行	1,000	4,020.00	0.00
405	603101	汇嘉时代	800	3,944.00	0.00
406	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
407	300932	三友联众	390	3,755.70	0.00
408	002412	汉森制药	700	3,619.00	0.00
409	000632	三木集团	1,300	3,510.00	0.00
410	300564	筑博设计	400	3,412.00	0.00
411	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
412	002887	绿茵生态	500	3,255.00	0.00
413	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
414	000586	汇源通信	400	3,140.00	0.00
415	688081	兴图新科	330	2,904.00	0.00
416	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
417	688655	迅捷兴	269	2,824.50	0.00
418	603700	宁水集团	300	2,814.00	0.00
419	603978	深圳新星	300	2,685.00	0.00
420	003019	宸展光电	105	2,659.65	0.00
421	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
422	600051	宁波联合	500	2,635.00	0.00
423	000952	广济药业	500	2,495.00	0.00
424	603928	兴业股份	294	2,302.02	0.00
425	000573	粤宏远 A	1,000	2,180.00	0.00
426	300246	宝莱特	350	2,117.50	0.00
427	603059	倍加洁	100	1,974.00	0.00
428	000014	沙河股份	200	1,914.00	0.00
429	301227	森鹰窗业	100	1,881.00	0.00
430	600356	恒丰纸业	300	1,776.00	0.00
431	300357	我武生物	84	1,698.48	0.00
432	603096	新经典	100	1,690.00	0.00
433	300810	中科海讯	99	1,515.69	0.00
434	603706	东方环宇	100	1,465.00	0.00
435	300643	万通智控	100	1,410.00	0.00
436	600830	香溢融通	200	1,392.00	0.00
437	002696	百洋股份	350	1,382.50	0.00
438	300190	维尔利	500	1,375.00	0.00
439	603288	海天味业	39	1,344.33	0.00
440	001218	丽臣实业	88	1,317.36	0.00
441	300980	祥源新材	82	1,292.32	0.00
442	300424	航新科技	100	1,223.00	0.00

443	603768	常青股份	100	1,134.00	0.00
444	688189	南新制药	200	1,126.00	0.00
445	300824	北鼎股份	150	1,087.50	0.00
446	002094	青岛金王	600	1,074.00	0.00
446	300245	天玑科技	200	1,074.00	0.00
448	603228	景旺电子	33	1,049.40	0.00
449	301258	富士莱	42	1,044.12	0.00
450	300371	汇中股份	120	1,004.40	0.00
451	002956	西麦食品	60	824.40	0.00
452	002293	罗莱生活	99	799.92	0.00
453	600408	安泰集团	500	790.00	0.00
454	605339	南侨食品	54	767.88	0.00
455	601952	苏垦农发	80	721.60	0.00
456	300623	捷捷微电	41	709.30	0.00
457	300628	亿联网络	19	698.63	0.00
458	300741	华宝股份	45	685.80	0.00
459	600636	国新文化	91	682.50	0.00
460	300743	天地数码	50	677.00	0.00
461	601139	深圳燃气	95	634.60	0.00
462	002051	中工国际	89	619.44	0.00
463	601577	长沙银行	75	613.50	0.00
464	603909	建发合诚	69	574.08	0.00
465	300590	移为通信	50	571.00	0.00
466	301160	翔楼新材	15	558.75	0.00
467	001914	招商积余	54	541.08	0.00
468	002718	友邦吊顶	50	522.00	0.00
469	603238	诺邦股份	50	498.00	0.00
470	002507	涪陵榨菜	40	490.00	0.00
471	603535	嘉诚国际	30	484.20	0.00
472	603317	天味食品	40	456.40	0.00
473	600969	郴电国际	80	438.40	0.00
474	603866	桃李面包	80	405.60	0.00
475	600295	鄂尔多斯	40	396.80	0.00
476	000541	佛山照明	80	389.60	0.00
477	300897	山科智能	19	350.36	0.00
478	603527	众源新材	40	284.00	0.00
479	605169	洪通燃气	36	282.24	0.00
480	601200	上海环境	33	280.50	0.00
481	603025	大豪科技	20	276.40	0.00
482	600548	深高速	26	276.38	0.00
483	603269	海鸥股份	28	274.96	0.00
484	003011	海象新材	20	268.20	0.00
485	605158	华达新材	30	192.90	0.00
486	300413	芒果超媒	8	167.20	0.00

487	002140	东华科技	20	155.00	0.00
488	605066	天正电气	25	139.25	0.00
489	603697	有友食品	20	116.00	0.00
490	301237	和顺科技	5	114.30	0.00
491	000088	盐田港	24	108.72	0.00
492	603601	再升科技	20	55.20	0.00
493	603308	应流股份	3	37.26	0.00
494	300183	东软载波	1	11.58	0.00
495	603567	珍宝岛	1	10.53	0.00
496	300002	神州泰岳	1	8.12	0.00
497	600757	长江传媒	1	8.06	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	600900	长江电力	75,761,057.00	4.23
2	603811	诚意药业	17,499,916.00	0.98
3	301227	森鹰窗业	15,838,913.44	0.88
4	600235	民丰特纸	15,352,430.00	0.86
5	002729	好利科技	15,218,364.00	0.85
6	300543	朗科智能	14,954,811.56	0.83
7	603637	镇海股份	14,290,724.00	0.80
8	601088	中国神华	14,212,125.00	0.79
9	605336	帅丰电器	14,198,867.30	0.79
10	000407	胜利股份	14,165,724.00	0.79
11	002133	广宇集团	13,879,929.00	0.77
12	605258	协和电子	13,579,468.00	0.76
13	688189	南新制药	13,485,321.69	0.75
14	300519	新光药业	13,266,429.00	0.74
15	300371	汇中股份	13,206,331.60	0.74
16	603089	正裕工业	13,113,187.00	0.73
17	300240	飞力达	13,097,247.00	0.73
18	301276	嘉曼服饰	12,949,200.64	0.72
19	601288	农业银行	12,534,899.00	0.70
20	300564	筑博设计	12,498,454.00	0.70

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	600900	长江电力	62,884,399.13	3.51
2	300543	朗科智能	21,961,307.76	1.22
3	605058	澳弘电子	20,878,710.00	1.16
4	300843	胜蓝股份	20,088,016.00	1.12
5	300040	九洲集团	18,676,993.00	1.04
6	002381	双箭股份	17,051,667.00	0.95
7	603096	新经典	15,938,120.40	0.89
8	300243	瑞丰高材	15,546,143.22	0.87
9	603739	蔚蓝生物	15,259,936.00	0.85
10	002140	东华科技	15,001,734.47	0.84
11	002743	富煌钢构	14,991,836.00	0.84
12	300743	天地数码	14,956,797.60	0.83
13	000590	启迪药业	14,868,803.00	0.83
14	002817	黄山胶囊	14,690,724.00	0.82
15	605258	协和电子	14,484,298.00	0.81
16	000788	北大医药	14,275,640.69	0.80
17	600356	恒丰纸业	14,218,428.76	0.79
18	301227	森鹰窗业	14,091,919.34	0.79
19	688080	映翰通	13,807,049.78	0.77
20	300440	运达科技	13,302,722.00	0.74

7.4.3 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	4,735,340,386.72
卖出股票的收入（成交）总额	5,126,454,168.79

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未投资贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 前十名证券中，农业银行(601288.SH)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）。

招商银行(600036.SH)的发行主体招商银行股份有限公司于 2023 年 11 月 27 日收到国家外汇管理局深圳市分局出具的行政处罚（深外管检[2023]42 号）、于 2023 年 12 月 15 日收到国家金融监督管理总局深圳监管局出具的行政处罚（深金罚决字[2023]81 号）、于 2024 年 6 月 28 日收到国家金融监督管理总局出具的公开处罚（金罚决字[2024]30 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内受到证监会、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	495,683.66
2	应收清算款	9,270.83
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	42,025.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	546,980.28

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

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

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
光大保德信量化	75,227	15,835.20	139,245,621.42	11.69%	1,051,988,678.	88.31%

股票 A					39	
光大保德信量化股票 C	9	14,316.59	10,028.66	7.78%	118,820.64	92.22%
合计	75,236	15,835.01	139,255,650.08	11.69%	1,052,107,499.03	88.31%

8.2 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	光大保德信量化股票 A	529,426.66	0.04%
	光大保德信量化股票 C	100.93	0.08%
	合计	529,527.59	0.04%

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	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	光大保德信量化股票 A	50~100
	光大保德信量化股票 C	-
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	光大保德信量化股票 A	0~10
	光大保德信量化股票 C	-
	合计	0~10

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	光大保德信量化股票 A	光大保德信量化股票 C
基金合同生效日（2004 年 8 月 27 日）基金份额总额	2,544,287,215.94	-
本报告期期初基金份额总额	1,641,249,646.23	245,952,868.99
本报告期基金总申购份额	160,719,012.32	121,830,878.68
减：本报告期基金总赎回份额	610,734,358.74	367,654,898.37
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,191,234,299.81	128,849.30

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，经公司十一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。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金在本报告期内的投资策略未发生改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金报告期内未持有基金。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所情况。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.7.1 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相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7.2 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，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
中信建投证券股份有限公司	2	2,139,258,900.71	21.70%	1,146,440.92	14.02%	-
光大证券股份有限公司	3	1,576,076,952.78	15.98%	1,476,169.03	18.05%	-
中泰证券股份有限公司	1	1,060,230,405.75	10.75%	1,002,878.12	12.26%	-
信达证券	1	1,023,315,899.37	10.38%	753,042.60	9.21%	-
海通证券	1	962,058,579.10	9.76%	900,396.62	11.01%	-
长江证券股份有限公司	1	833,684,116.72	8.46%	788,554.99	9.64%	-

兴业证券	1	792,494,349.27	8.04%	757,539.94	9.26%	-
申万宏源证券 有限公司	2	635,578,105.01	6.45%	570,223.91	6.97%	-
广发证券股份 有限公司	1	578,049,992.97	5.86%	541,003.24	6.61%	-
国信证券股份 有限公司	1	259,330,679.76	2.63%	242,711.38	2.97%	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
东方证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
中国国际金融 股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：（1）报告期内租用证券公司交易单元变更情况

报告期内本基金无新增租用交易单元；停止租用中银国际证券交易单元1个、国投证券交易单元1个、中信建投证券交易单元1个。

（2）选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

基金管理人选择证券经营机构，并选用其交易单元供本基金买卖证券专用，应本着安全、高效、低成本，能够为本基金提供高质量增值研究服务的原则，对该证券经营机构的经营情况、治理情况、研究实力等进行综合考量。

基本选择标准如下：

实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币；

财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

经营行为规范，近两年未发生重大违规行为而受到证监会处罚；

内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求，并能为本基金提供全面的信息服务；

研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务；对于某一领域的研究实力超群，或是能够提供全方面，高质量的服务。

(3) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

投资研究团队按照(2)中列出的有关经营情况、治理情况的选择标准，对备选的证券经营机构进行初步筛选；

对通过初选的各证券经营机构，投资研究团队各成员在其分管行业或领域的范围内，对该机构所提供的研究报告和信息资讯进行评分。

根据各成员评分，得出各证券经营机构的综合评分。

投资研究团队根据各机构的得分排名，拟定要选用其专用交易单元的证券经营机构。

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

10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	250,000,000.00	100.00%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份	-	-	-	-	-	-

有限公司						
高华证券	-	-	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中国国际金融 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旗下基金 2023 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	2024-01-01
2	光大保德信量化核心证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	同上	2024-01-22
3	关于终止“光大保德信基金”APP 运营及维护服务的公告	同上	2024-02-06
4	关于旗下公募基金产品风险等级情况的说明	同上	2024-02-07
5	光大保德信量化核心证券投资基金(光大保德信量化股票 A)基金产品资料概要更新	同上	2024-03-27
6	光大保德信量化核心证券投资基金(光大保德信量化股票 C)基金产品资料概要更新	同上	2024-03-27
7	光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书(更新)	同上	2024-03-27
8	光大保德信量化核心证券投资基金 2023 年年度报告	同上	2024-03-29

9	光大保德信量化核心证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	同上	2024-04-22
10	光大保德信量化核心证券投资基金基金经理变更公告	同上	2024-05-06
11	光大保德信量化核心证券投资基金(光大保德信量化股票 A)基金产品资料概要更新	同上	2024-05-08
12	光大保德信量化核心证券投资基金(光大保德信量化股票 C)基金产品资料概要更新	同上	2024-05-08
13	光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书(更新)	同上	2024-05-08
14	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分公募基金产品风险等级变动的通知	同上	2024-05-13
15	光大保德信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	同上	2024-06-13
16	光大保德信基金管理有限公司关于暂停与海银基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	同上	2024-06-20
17	光大保德信量化核心证券投资基金(光大保德信量化股票 A)基金产品资料概要更新	同上	2024-06-28
18	光大保德信量化核心证券投资基金(光大保德信量化股票 C)基金产品资料概要更新	同上	2024-06-28

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

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	20240101-20240201	595,706,155.73	4,611,330.70	600,317,486.43	0.00	0.00%
产品特有风险							
<p>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：</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>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。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准光大保德信量化核心证券投资基金设立的文件
- 2、光大保德信量化核心证券投资基金基金合同
- 3、光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书
- 4、光大保德信量化核心证券投资基金托管协议
- 5、光大保德信量化核心证券投资基金法律意见书
- 6、报告期内光大保德信量化核心证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告
- 7、基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
- 8、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 9、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

光大保德信基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日