

光大保德信纯债债券型证券投资基金

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：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信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..... | 7 |
| 2.5 其他相关资料..... | 7 |
| 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..... | 8 |
| 4 管理人报告 | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明..... | 13 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 13 |
| 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..... | 13 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 14 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 14 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 15 |
| 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..... | 15 |
| 5 托管人报告 | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明..... | 15 |
| 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..... | 15 |
| 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..... | 16 |
| 6 中期财务会计报告（未经审计） | 16 |
| 6.1 资产负债表..... | 16 |
| 6.2 利润表..... | 17 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表..... | 18 |
| 6.4 报表附注..... | 20 |
| 7 投资组合报告 | 41 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 41 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 42 |
| 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..... | 42 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 42 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 42 |
| 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..... | 43 |
| 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..... | 43 |
| 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..... | 43 |
| 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..... | 44 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策..... | 44 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 44 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 44 |
| 8 基金份额持有人信息 | 45 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 45 |

| | | |
|-----------|-------------------------------------|-----------|
| 8.2 | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 45 |
| 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 | 46 |
| 9 | 开放式基金份额变动 | 46 |
| 10 | 重大事件揭示 | 46 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议 | 46 |
| 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 | 46 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 46 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变 | 46 |
| 10.5 | 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 | 47 |
| 10.6 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 47 |
| 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 | 47 |
| 10.8 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 47 |
| 10.9 | 其他重大事件 | 48 |
| 11 | 影响投资者决策的其他重要信息 | 49 |
| 12 | 备查文件目录 | 50 |
| 12.1 | 备查文件目录 | 50 |
| 12.2 | 存放地点 | 50 |
| 12.3 | 查阅方式 | 50 |

2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|--------------------|-----------------|
| 基金名称 | 光大保德信纯债债券型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 光大保德信纯债债券 | |
| 基金主代码 | 012031 | |
| 交易代码 | 012031 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2021 年 11 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 | 中信银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 1,292,625,521.33 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 光大保德信纯债债券 A | 光大保德信纯债债券 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 012031 | 012032 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,250,147,277.59 份 | 42,478,243.74 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金在控制信用风险、谨慎投资的前提下，力争在获取持有期收益的同时，实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略 本基金根据工业增加值、通货膨胀率等宏观经济指标，结合国家货币政策和财政政策实施情况、市场收益率曲线变动情况、市场流动性情况，综合分析债券市场的变动趋势。最终确定本基金在债券类资产中的投资比率，构建和调整债券投资组合。</p> <p>2、目标久期策略及凸性策略 在组合的久期选择方面，本基金将综合分析宏观面的各个要素，主要包括宏观经济所处周期、货币财政政策动向、市场流动性变动情况等，通过对各宏观变量的分析，判断其对市场利率水平的影响方向和程度，从而确定本基金固定收益投资组合久期的合理范围。并且动态调整本基金的目标久期，即预期利率上升时适当缩短组合久期，在预期利率下降时适当延长组合久期，从而提高债券投资收益。</p> <p>由于债券价格与收益率之间往往存在明显的非线性关系，所以通过凸性管理策略为久期策略补充，可以更好地分析债券的利率风险。凸性越大，利率上行引起的价格损失越小，而利率下行带来的价格上升越大；反之亦然。本基金将通过严格的凸性分析，对久期策略做出适当的补充和修正。</p> <p>3、收益率曲线策略 在确定了组合的整体久期后，组合将基于宏观经济研究和债券市场跟踪，结合收益率曲线的拟合和波动模拟模型，对未来的收益率曲线移动进行情景分析，从而根据不同期限的收益率变动情况，在期限结构配置上适时采取子弹型、哑铃型或者阶梯型等策略，进一步优化组合的期限结构，增强</p> |

基金的收益。

4、信用债投资策略

(1) 本基金投资的信用债的信用评级须在 AA（含 AA）以上，除短期融资券、超短期融资券以外的信用债采用评级机构出具的债项信用评级，短期融资券、超短期融资券采用评级机构出具的主体信用评级。其中：

- 1) 投资于信用评级为 AA 的信用债占债券资产比例不超过 20%；
- 2) 投资于信用评级为 AA+ 的信用债占债券资产比例不超过 50%；
- 3) 投资于信用评级为 AAA 的信用债占债券资产比例不低于 50%。

本基金将综合参考国内依法成立并拥有证券评级资质的评级机构所出具的信用评级（具体评级机构名单以基金管理人确认为准）。如本基金投资的信用债出现同一时间多家评级机构出具的信用评级不一致，或没有对应评级的情况，基金管理人将结合内部信用评级规则进行独立判断与认定。信用债的信用评级以基金管理人的判断与认定结果为准。

(2) 由于影响信用债券利差水平的因素包括市场整体的信用利差水平和信用债自身的信用情况变化，因此本基金的信用债投资策略可以具体分为市场整体信用利差曲线策略和单个信用债信用分析策略。

1) 市场整体信用利差曲线策略

本基金将从经济周期、市场特征和政策因素三方面考量信用利差曲线的整体走势。在经济周期向上阶段，企业盈利能力增强，经营现金流改善，则信用利差可能收窄，反之当经济周期不景气，企业的盈利能力减弱，信用利差扩大。同时本基金也将考虑市场容量、信用债结构以及流动性之间的相互关系，动态研究信用债市场的主要特征，为分析信用利差提供依据。此外，本基金将从供给和需求两方面分别评估政策对信用债市场的作用。

2) 单个信用债信用分析策略

信用债的收益率水平及其变化很大程度上取决于其发行主体自身的信用水平。本基金主要通过发行主体偿债能力、抵押物质量、契约条款和公司治理情况等方面分析和评估单个信用债券的信用水平：

本基金将从行业和企业两个层面来衡量发行主体的偿债能力。A) 行业层面：包括行业发展趋势、政策环境和行业运营竞争状况；B) 企业层面：包括盈利指标分析、资产负债表分析和现金流分析等。

本基金对于抵押物质量的考察主要集中在抵押物的现金流生成能力和资产增值能力。抵押物产生稳定现金流的能力越强、资产增值的潜力越大，则抵押物的质量越好，从而该主体的信用水平也越高。

本基金将分析信用债券中契约条款的合理性和可实施性，并对发行人履行条款的情况进行动态跟踪与评估，发行人对契约条款的履行情况越良好，其信用水平也越高。

本基金关注的公司治理情况包括持有人结构、股东权益与员工关系、运行透明度和信息披露、董事会结构和效率等，良好的主体治理情况是信用债维持高信用等级的重要因素。

综合以上因素，本基金将深入挖掘信用债的投资价值，分析信用利差曲线整体及分行业走势，确定信用债的总投资比例及分行业投资比例，选择行业波动性小、主体经营稳健、流动性好的品种进行配置，增强本基金的收益。

5、资产支持证券投资策略

资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提

| | |
|--------|--|
| | <p>前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产支持证券。</p> <p>6、债券回购投资策略</p> <p>在本基金的日常投资中，还将充分利用组合的债券回购操作，利用债券回购收益率低于债券收益率的机会，融入资金购买收益率较高的债券品种，在严格头寸管理的基础上，在资金相对充裕的情况下进行风险可控的债券回购投资策略。</p> |
| 业绩比较基准 | 中债综合财富（总值）指数收益率×90%+一年期定期存款利率（税后）×10%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金，但低于股票型基金和混合型基金。 |

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 | 中信银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 高顺平 | 滕菲菲 |
| | 联系电话 | (021) 80262888 | 4006800000 |
| | 电子邮箱 | epfservice@epf.com.cn | tengfeifei@citicbank.com |
| 客户服务电话 | | 4008-202-888 | 95558 |
| 传真 | | (021) 80262468 | 010-85230024 |
| 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 | 北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层 |
| 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 | 北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层 |
| 邮政编码 | | 200010 | 100020 |
| 法定代表人 | | 刘翔 | 方合英 |

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、中信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） | |
|---------------|--------------------------------------|---------------|
| | 光大保德信纯债债券 A | 光大保德信纯债债券 C |
| 本期已实现收益 | 17,810,610.21 | 387,846.57 |
| 本期利润 | 29,818,299.80 | 587,542.63 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0302 | 0.0299 |
| 本期加权平均净值利润率 | 2.83% | 2.83% |
| 本期基金份额净值增长率 | 2.99% | 3.00% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日) | |
| | 光大保德信纯债债券 A | 光大保德信纯债债券 C |
| 期末可供分配利润 | 48,538,472.94 | 1,332,717.75 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0388 | 0.0314 |
| 期末基金资产净值 | 1,320,866,369.78 | 44,559,564.18 |
| 期末基金份额净值 | 1.0566 | 1.0490 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日) | |
| | 光大保德信纯债债券 A | 光大保德信纯债债券 C |
| 基金份额累计净值增长率 | 10.00% | 9.22% |

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

光大保德信纯债债券 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 | 0.37% | 0.01% | 0.79% | 0.03% | -0.42% | -0.02% |
| 过去三个月 | 1.54% | 0.05% | 1.60% | 0.06% | -0.06% | -0.01% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去六个月 | 2.99% | 0.04% | 3.46% | 0.06% | -0.47% | -0.02% |
| 过去一年 | 4.18% | 0.03% | 5.48% | 0.05% | -1.30% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 10.00% | 0.05% | 12.01% | 0.05% | -2.01% | 0.00% |

光大保德信纯债债券 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 | 0.52% | 0.04% | 0.79% | 0.03% | -0.27% | 0.01% |
| 过去三个月 | 1.64% | 0.05% | 1.60% | 0.06% | 0.04% | -0.01% |
| 过去六个月 | 3.00% | 0.04% | 3.46% | 0.06% | -0.46% | -0.02% |
| 过去一年 | 4.01% | 0.04% | 5.48% | 0.05% | -1.47% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 9.22% | 0.05% | 12.01% | 0.05% | -2.79% | 0.00% |

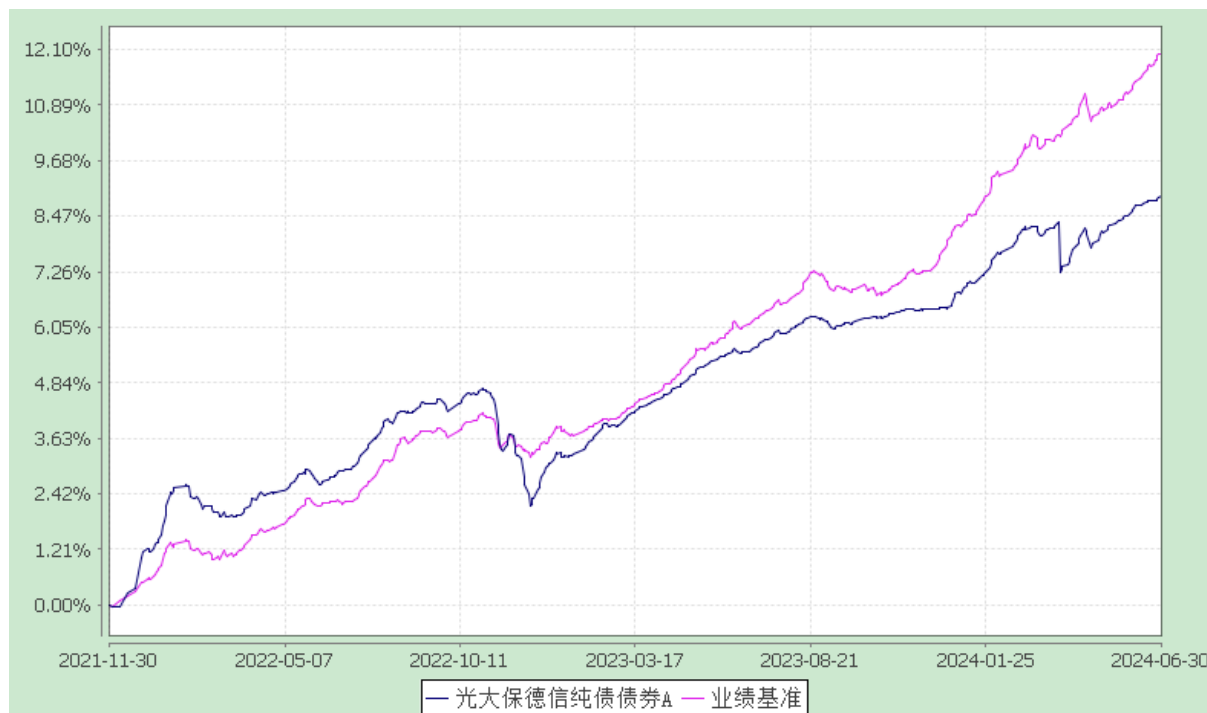
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

光大保德信纯债债券型证券投资基金

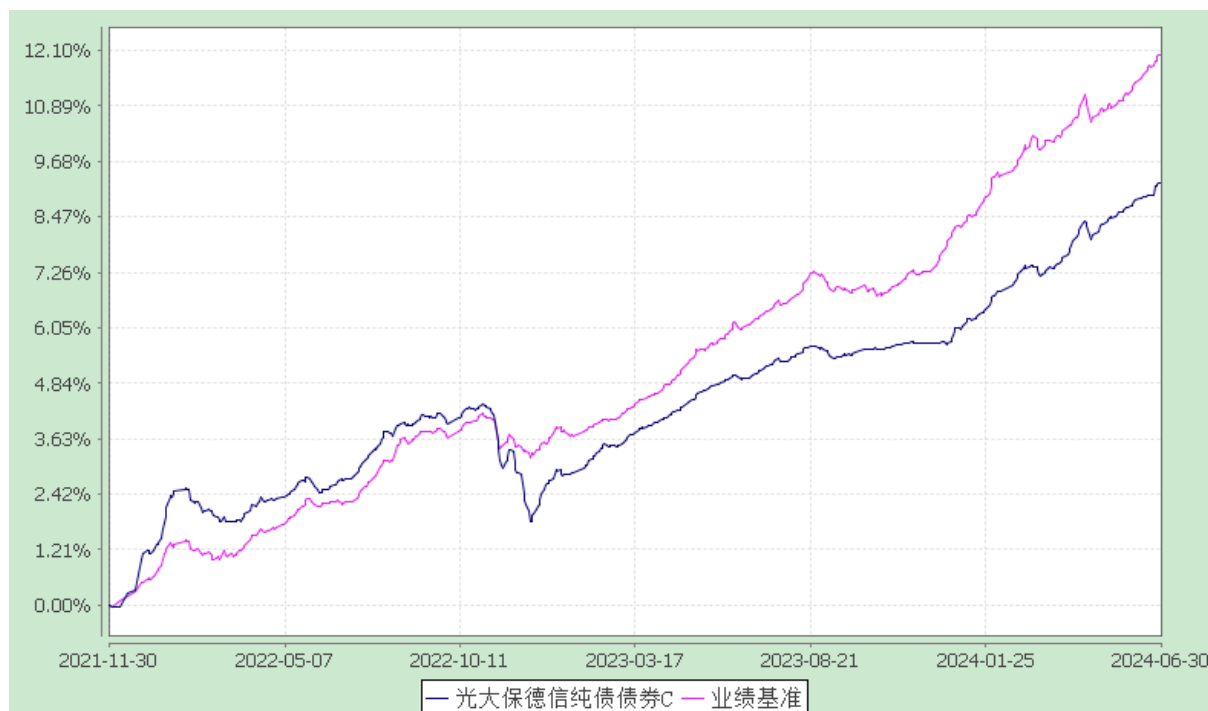
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021 年 11 月 30 日至 2024 年 6 月 30 日)

光大保德信纯债债券 A



光大保德信纯债债券 C



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 | | |
| | | | | | |

| | | | | |
|------------|--|-------------------|----------|---|
| <p>李怀定</p> | <p>固收管理总部 固收研究团队 联席团队长、 基金经理</p> | <p>2021-11-30</p> | <p>-</p> | <p>17 年</p> <p>李怀定先生,复旦大学经济学博士学位。2007 年 7 月至 2007 年 11 月任职华泰证券股份有限公司固定收益部;2007 年 11 月至 2009 年 7 月在光大证券股份有限公司担任债券分析师;2009 年 7 月至 2012 年 5 月在国信证券股份有限公司担任经济研究所高级分析师;2012 年 5 月至 2018 年 8 月在汇添富基金管理股份有限公司历任固定收益投资部高级分析师、债券基金经理助理、债券基金经理;2018 年 8 月至 2021 年 5 月在长江养老保险股份有限公司担任养老保障投资部/个人养老金投资部固收投资经理;2021 年 6 月加入光大保德信基金管理有限公司,现任固收管理总部固收研究团队联席团队长,2021 年 7 月至 2024 年 1 月担任光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金(已清盘)的基金经理,2021 年 7 月至今担任光大保德信恒利纯债债券型证券投资基金、光大保德信尊裕纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、光大保德信尊丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2021 年 7 月至 2023 年 4 月担任光大保德信诚鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2021 年 9 月至 2024 年 1 月担任光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金(已清盘)的基金经理,2021 年 11 月至今担任光大保德信纯债债券型证券投资基金的基金经理,2021 年 12 月至 2023 年 3 月担任光大保德信裕鑫混合型证券投资基金(已清盘)的基金经理,2022 年 9 月至今担任光大保德信尊颐纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2023 年 6 月至今担任光大保德信睿阳纯债债券型证券投资基金的基金经理,2023 年 7 月至 2024 年 7 月担任光大保德信荣利纯债债</p> |
|------------|--|-------------------|----------|---|

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 券型证券投资基金的基金经理，2024 年 3 月至今担任光大保德信鼎利 90 天滚动持有债券型证券投资基金的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---|

注：对基金的首任基金经理，其任职日期按基金合同生效日填写，离任日期为公司决定确定的解聘日期。

4.1.3 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

上半年经济整体呈现总需求相对偏弱、生产相对旺盛、通胀相对低位的局面，背后原因应该是受国际市场需求回升，国内财政产业政策集中发力等影响；分季度看，相比一季度，二季度内需复苏相对缓慢，居民消费仍偏保守、地产投资增速有所下降、基建投资总体进度较慢。上半年后期政治局会议提出加快财政支出力度、地产去库存等，并陆续出台了相关具体政策。但整体而言，政策效果得到完全反映仍需一定时间。

债券市场方面，上半年各类债券品种收益率整体呈下行趋势，其中资质相对偏弱的城投债，在地方政府化债政策推动下继续出现下行，长久期利率债在配置盘推动下也出现下行，但由于受到一些外部因素约束，长久期利率债期间出现一定的反复。

组合操作方面，上半年组合整体操作比较积极，期间对组合持仓结构进行了优化，在短久期信用债和中短久期信用债之间作了些许调整，债券仓位也适当有所提高。整体而言，上半年组合杠杆和久期水平较去年 4 季度末有所提高。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内光大纯债 A 份额净值增长率为 2.99%，业绩比较基准收益率为 3.46%；光大纯债 C 份额净值增长率为 3.00%，业绩比较基准收益率为 3.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们维持二季报的观点，尽管多项货币、财政以及地产政策陆续出台，但经济基本面回升仍相对温和，在多种外部因素叠加背景下，债券收益率中枢仍有进一步下行的空间，但因为当前绝对收益率水平较低，整体下行幅度可能会小于上半年和 2023 年全年走势。

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，2024 年 5 月 28 日本基金 A 类基金份额每 10 份派发红利 0.322 元，C 类基金份额每 10 份派发红利 0.320 元。

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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对光大保德信纯债债券型证券投资基金 2024 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，光大保德信基金管理有限公司在光大保德信纯债债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，光大保德信基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的光大保德信纯债债券型证券投资基金 2024 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：光大保德信纯债债券型证券投资基金

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 | 4,224,468.38 | 3,066,607.61 |
| 结算备付金 | | 5,686,395.21 | 793,715.43 |
| 存出保证金 | | 23,907.54 | 12,938.24 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 1,822,229,705.29 | 1,172,681,867.77 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 1,822,229,705.29 | 1,172,681,867.77 |
| 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 | - | 32,933,040.98 |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 2,844,779.22 | 1,103.10 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 1,835,009,255.64 | 1,209,489,273.13 |
| 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 | | 468,114,213.86 | 308,662,624.84 |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 629,723.27 | 26,150.96 |
| 应付管理人报酬 | | 335,527.94 | 235,171.07 |
| 应付托管费 | | 111,842.64 | 78,390.39 |
| 应付销售服务费 | | 13,149.05 | 3,238.91 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 129,391.77 | 88,135.77 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 249,473.15 | 236,786.46 |
| 负债合计 | | 469,583,321.68 | 309,330,498.40 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 1,292,625,521.33 | 851,467,799.01 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 72,800,412.63 | 48,690,975.72 |
| 净资产合计 | | 1,365,425,933.96 | 900,158,774.73 |
| 负债和净资产总计 | | 1,835,009,255.64 | 1,209,489,273.13 |

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0563 元，基金份额总额 1,292,625,521.33 份。其中 A 类基金份额净值 1.0566 元，份额总额 1,250,147,277.59 份；C 类基金份额净值 1.0490 元，份额总额 42,478,243.74 份。

6.2 利润表

会计主体：光大保德信纯债债券型证券投资基金

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 | | 36,732,606.83 | 26,258,479.00 |
| 1.利息收入 | | 74,181.09 | 108,287.07 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 63,387.13 | 51,398.65 |
| 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 | | 10,793.96 | 56,888.42 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 24,377,151.14 | 22,624,379.13 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | 24,377,151.14 | 22,624,379.13 |

| | | | |
|----------------------------|----------|----------------------|----------------------|
| 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 | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | 12,207,385.65 | 3,525,705.86 |
| 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 | 73,888.95 | 106.94 |
| 减：二、营业总支出 | | 6,326,764.40 | 5,479,236.47 |
| 1. 管理人报酬 | | 1,594,085.97 | 1,373,776.51 |
| 2. 托管费 | | 531,361.93 | 457,925.50 |
| 3. 销售服务费 | | 35,735.51 | 52,955.10 |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 3,957,998.52 | 3,415,587.52 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 3,957,998.52 | 3,415,587.52 |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.18 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 65,964.88 | 63,912.42 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.19 | 141,617.59 | 115,079.42 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 30,405,842.43 | 20,779,242.53 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 30,405,842.43 | 20,779,242.53 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 30,405,842.43 | 20,779,242.53 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：光大保德信纯债债券型证券投资基金

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 | 851,467,799.01 | - | 48,690,975.72 | 900,158,774.73 |
| 二、本期期初净资产 | 851,467,799.01 | - | 48,690,975.72 | 900,158,774.73 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 441,157,722.32 | - | 24,109,436.91 | 465,267,159.23 |

| | | | | |
|--|---------------------------------|------------|----------------|------------------|
| (一)、综合收益总额 | - | - | 30,405,842.43 | 30,405,842.43 |
| (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) | 441,157,722.32 | - | 28,620,016.91 | 469,777,739.23 |
| 其中: 1.基金申购款 | 609,484,616.15 | - | 38,860,670.26 | 648,345,286.41 |
| 2.基金赎回款 | -168,326,893.83 | - | -10,240,653.35 | -178,567,547.18 |
| (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) | - | - | -34,916,422.43 | -34,916,422.43 |
| 四、本期期末净资产 | 1,292,625,521.33 | - | 72,800,412.63 | 1,365,425,933.96 |
| 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 | 436,681,384.33 | - | 8,864,675.05 | 445,546,059.38 |
| 二、本期期初净资产 | 436,681,384.33 | - | 8,864,675.05 | 445,546,059.38 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | 479,344,294.23 | - | 32,435,731.09 | 511,780,025.32 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 20,779,242.53 | 20,779,242.53 |
| (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) | 479,344,294.23 | - | 11,656,488.56 | 491,000,782.79 |
| 其中: 1.基金申购款 | 930,454,915.92 | - | 21,379,432.78 | 951,834,348.70 |
| 2.基金赎回款 | -451,110,621.69 | - | -9,722,944.22 | -460,833,565.91 |
| (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 | 916,025,678.56 | - | 41,300,406.14 | 957,326,084.70 |

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

光大保德信纯债债券型证券投资基金（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[2021]1037 号《关于准予光大保德信纯债债券型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人光大保德信基金管理有限公司自 2021 年 9 月 28 日至 2021 年 11 月 26 日止期间向社会公开发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2021）验字第 60467078_B06 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2021 年 11 月 30 日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 300,209,907.95 元，募集资金在募集期间产生的利息为人民币 39,315.84 元，以上收到的实收基金（本息）共计人民币 300,249,223.79 元，折合基金份额 300,249,223.79 份，其中 A 类基金份额 133,530,957.05 份，C 类基金份额 166,718,266.74 份。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，基金托管人为中信银行股份有限公司。

本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取前端认购费或申购费、但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取前后端认购费或申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括债券（国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、政府支持机构债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金不投资于股票等资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；本基金持有

现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金净值的 5%。其中，现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：中债综合财富（总值）指数收益率 $\times 90\%$ +一年期定期存款利率（税后） $\times 10\%$ 。

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（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 3 号《半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。

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 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止期间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 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。

6.4.6.2 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。

6.4.6.3 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[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。

6.4.6.4 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。

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 | 4,224,468.38 |
| 等于：本金 | 4,221,222.22 |
| 加：应计利息 | 3,246.16 |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 合计 | 4,224,468.38 |

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 | - | - | - | - | |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市场 | 450,295,828.13 | 5,575,102.91 | 456,799,602.91 | 928,671.87 |
| | 银行间市场 | 1,332,353,433.85 | 19,811,102.38 | 1,365,430,102.38 | 13,265,566.15 |
| | 合计 | 1,782,649,261.98 | 25,386,205.29 | 1,822,229,705.29 | 14,194,238.02 |
| | 资产支持证券 | - | - | - | - |
| 基金 | - | - | - | - | |
| 其他 | - | - | - | - | |
| 合计 | 1,782,649,261.98 | 25,386,205.29 | 1,822,229,705.29 | 14,194,238.02 | |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末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余额。

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 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 21,019.25 |

| | |
|----------|------------|
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | 21,019.25 |
| 应付利息 | - |
| 预提审计费 | 39,781.56 |
| 预提信息披露费 | 179,672.34 |
| 预提账户维护费 | 9,000.00 |
| 合计 | 249,473.15 |

6.4.7.7 实收基金

光大保德信纯债债券 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 | 841,172,281.88 | 841,172,281.88 |
| 本期申购 | 551,590,619.12 | 551,590,619.12 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -142,615,623.41 | -142,615,623.41 |
| 本期末 | 1,250,147,277.59 | 1,250,147,277.59 |

光大保德信纯债债券 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 | 10,295,517.13 | 10,295,517.13 |
| 本期申购 | 57,893,997.03 | 57,893,997.03 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -25,711,270.42 | -25,711,270.42 |
| 本期末 | 42,478,243.74 | 42,478,243.74 |

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

光大保德信纯债债券 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 | 44,428,084.18 | 3,751,438.75 | 48,179,522.93 |
| 本期期初 | 44,428,084.18 | 3,751,438.75 | 48,179,522.93 |

| | | | |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 本期利润 | 17,810,610.21 | 12,007,689.59 | 29,818,299.80 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 19,908,355.26 | 6,421,490.91 | 26,329,846.17 |
| 其中：基金申购款 | 26,805,180.97 | 8,498,367.70 | 35,303,548.67 |
| 基金赎回款 | -6,896,825.71 | -2,076,876.79 | -8,973,702.50 |
| 本期已分配利润 | -33,608,576.71 | - | -33,608,576.71 |
| 本期末 | 48,538,472.94 | 22,180,619.25 | 70,719,092.19 |

光大保德信纯债债券 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 | 465,842.41 | 45,610.38 | 511,452.79 |
| 本期期初 | 465,842.41 | 45,610.38 | 511,452.79 |
| 本期利润 | 387,846.57 | 199,696.06 | 587,542.63 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,786,874.49 | 503,296.25 | 2,290,170.74 |
| 其中：基金申购款 | 2,626,860.15 | 930,261.44 | 3,557,121.59 |
| 基金赎回款 | -839,985.66 | -426,965.19 | -1,266,950.85 |
| 本期已分配利润 | -1,307,845.72 | - | -1,307,845.72 |
| 本期末 | 1,332,717.75 | 748,602.69 | 2,081,320.44 |

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 | 26,558.56 |
| 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 | 36,631.40 |
| 其他 | 197.17 |
| 合计 | 63,387.13 |

6.4.7.10 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|--------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 22,469,016.48 |

| | |
|------------------------------|---------------|
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 1,908,134.66 |
| 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 | 24,377,151.14 |

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 660,299,853.23 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 647,246,937.36 |
| 减：应计利息总额 | 11,129,456.21 |
| 减：交易费用 | 15,325.00 |
| 买卖债券差价收入 | 1,908,134.66 |

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

本基金本报告期无股利收益。

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 | 12,207,385.65 |
| ——股票投资 | - |
| ——债券投资 | 12,207,385.65 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2.衍生工具 | - |

| | |
|----------------------------|---------------|
| ——权证投资 | - |
| 3.其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税 | - |
| 合计 | 12,207,385.65 |

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 | 73,874.06 |
| 转换费收入 | 14.89 |
| 合计 | 73,888.95 |

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 | 39,781.56 |
| 信息披露费 | 59,672.34 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行汇划费 | 14,563.69 |
| 账户维护费 | 27,000.00 |
| 其他费用 | 600.00 |
| 合计 | 141,617.59 |

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 |
| 中信银行股份有限公司（“中信银行”） | 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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

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

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 | 占当期债券成交总额的 比例 | 成交金额 | 占当期债券成交总额的 比例 |
| 光大证券 | 288,757,566.81 | 67.79% | 271,745,081.93 | 72.25% |

6.4.10.1.4 债券回购交易

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 | 占当期债券回购成交总额的 比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的 比例 |

| | | | | |
|------|----------------|-------|--------------|-------|
| 光大证券 | 392,500,000.00 | 6.81% | 5,000,000.00 | 0.10% |
|------|----------------|-------|--------------|-------|

6.4.10.1.5 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。

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 | 1,594,085.97 | 1,373,776.51 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 18,678.39 | 28,351.36 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 1,575,407.58 | 1,345,425.15 |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.30% 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 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托管费 | 531,361.93 | 457,925.50 |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 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 |

| | 光大保德信纯债债券 A | 光大保德信纯债债券 C | 合计 |
|----------------|---------------------------------|-------------|-----------|
| 光大保德信 | - | 903.78 | 903.78 |
| 光大证券 | - | 4,771.98 | 4,771.98 |
| 中信银行 | - | 11,015.87 | 11,015.87 |
| 合计 | - | 16,691.63 | 16,691.63 |
| 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 | | |
| | 光大保德信纯债债券 A | 光大保德信纯债债券 C | 合计 |
| 光大保德信 | - | 12,449.88 | 12,449.88 |
| 中信银行 | - | 22,802.70 | 22,802.70 |
| 光大证券 | - | 1.90 | 1.90 |
| 合计 | - | 35,254.48 | 35,254.48 |

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。其中，A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额销售服务费年费率为 0.35%。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

$$H = E \times C \text{ 类基金销售服务费年费率} / \text{当年天数}$$

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。

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自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

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

光大保德信纯债债券 A

份额单位：份

| 关联方名称 | 光大保德信纯债债券A本期末 2024年6月30日 | | 光大保德信纯债债券A上年度末 2023年12月31日 | |
|-------------------|-----------------------------|--------------------------|-------------------------------|----------------------|
| | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的 比例 | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额占 基金总份额的比例 |
| 光大保德信资产管理 有限公司 | 33,594,844.44 | 2.69% | 33,594,844.44 | 3.99% |

光大保德信纯债债券 C

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 C 类基金份额。

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 |
| 中信银行 | 4,224,468.38 | 26,558.56 | 657,676.25 | 24,938.47 |

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

光大保德信纯债债券 A

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日 | 除息日 | | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 利润分配合计 | 备注 |
|----|------------|-----|------------|---------------|---------------|--------------|---------------|----|
| | | 场内 | 场外 | | | | | |
| 1 | 2024-05-28 | - | 2024-05-28 | 0.322 | 26,637,166.42 | 6,971,410.29 | 33,608,576.71 | - |
| 合计 | | | | 0.322 | 26,637,166.42 | 6,971,410.29 | 33,608,576.71 | - |

光大保德信纯债债券 C

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日 | 除息日 | | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 利润分配合计 | 备注 |
|----|------------|-----|------------|---------------|--------------|-----------|--------------|----|
| | | 场内 | 场外 | | | | | |
| 1 | 2024-05-28 | - | 2024-05-28 | 0.320 | 1,239,628.66 | 68,217.06 | 1,307,845.72 | - |
| 合计 | | | | 0.320 | 1,239,628.66 | 68,217.06 | 1,307,845.72 | - |

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

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。

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

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 236,566,055.94 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值 单价 | 数量（张） | 期末估值总额 |
|-----------|--------------------|------------|------------|--------------|----------------|
| 102381754 | 23 鄂长投 MTN002 | 2024-07-05 | 104.23 | 300,000.00 | 31,269,000.00 |
| 102480290 | 24 江宁城建 MTN001 | 2024-07-05 | 102.99 | 300,000.00 | 30,897,000.00 |
| 102380460 | 23 华发集团 MTN001 | 2024-07-04 | 105.07 | 200,000.00 | 21,014,000.00 |
| 102382711 | 23 济南城建 MTN004A | 2024-07-02 | 104.73 | 200,000.00 | 20,946,000.00 |
| 102382632 | 23 福州左海 MTN004 | 2024-07-02 | 104.17 | 200,000.00 | 20,834,000.00 |
| 102382032 | 23 越秀集团 MTN004 | 2024-07-04 | 103.55 | 200,000.00 | 20,710,000.00 |
| 102381317 | 23 鄂联投 MTN002 | 2024-07-02 | 103.48 | 200,000.00 | 20,696,000.00 |
| 102381116 | 23 西城投资 MTN001 | 2024-07-05 | 103.02 | 200,000.00 | 20,604,000.00 |
| 102480932 | 24 物产中大 MTN001 | 2024-07-04 | 101.48 | 200,000.00 | 20,296,000.00 |
| 102300467 | 23 中原豫资 MTN002 | 2024-07-04 | 104.54 | 120,000.00 | 12,544,800.00 |
| 102100112 | 21 成都国投 MTN001 | 2024-07-02 | 103.65 | 100,000.00 | 10,365,000.00 |
| 102480073 | 24 南浦口 MTN002 | 2024-07-02 | 103.10 | 100,000.00 | 10,310,000.00 |
| 102480495 | 24 福州古厝 MTN001 | 2024-07-05 | 101.85 | 100,000.00 | 10,185,000.00 |
| 102382161 | 23 湖州城投 MTN001 | 2024-07-04 | 104.13 | 80,000.00 | 8,330,400.00 |
| 102382763 | 23 中国航材 MTN001 | 2024-07-02 | 104.57 | 40,000.00 | 4,182,800.00 |
| 合计 | | | | 2,540,000.00 | 263,184,000.00 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 231,548,157.92 元，于 2024 年 7 月 1 日、2024 年 7 月 4 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2024年6月30日 | 上年末 2023年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 86,434,289.04 | 73,520,756.17 |
| 合计 | 86,434,289.04 | 73,520,756.17 |

注：未评级债券包括：一般短期融资券、国债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2024年6月30日 | 上年末 2023年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| AAA | 473,345,782.47 | 532,424,814.41 |
| AAA 以下 | 158,498,665.39 | 216,262,139.91 |
| 未评级 | 1,103,950,968.39 | 350,474,157.28 |
| 合计 | 1,735,795,416.25 | 1,099,161,111.60 |

注：未评级债券包括：一般公司债、一般中期票据。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

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

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。本基金的生息资产主要为结算备付金、债券投资、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 | 4,224,468.38 | - | - | - | - | - | 4,224,468.38 |
| 结算备付金 | 5,686,395.21 | - | - | - | - | - | 5,686,395.21 |
| 存出保证金 | 23,907.54 | - | - | - | - | - | 23,907.54 |
| 交易性金融资产 | - | - | 86,434,289.04 | 1,578,033,862.36 | 157,761,553.89 | - | 1,822,229,705.29 |

| | | | | | | | |
|-----------------------------|---------------------|-------------------|--------------------|----------------------|--------------------|------------------|----------------------|
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 2,844,779.2 2 | 2,844,779.2 2 |
| 资产总计 | 9,934,771.1 3 | - | 86,434,289. 04 | 1,578,033,8 62.36 | 157,761,55 3.89 | 2,844,779.2 2 | 1,835,009,2 55.64 |
| 负债 | | | | | | | |
| 卖出回购金融 资产款 | 468,114,21 3.86 | - | - | - | - | - | 468,114,21 3.86 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 629,723.27 | 629,723.27 |
| 应付管理人报 酬 | - | - | - | - | - | 335,527.94 | 335,527.94 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 111,842.64 | 111,842.64 |
| 应付销售服务 费 | - | - | - | - | - | 13,149.05 | 13,149.05 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 129,391.77 | 129,391.77 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 249,473.15 | 249,473.15 |
| 负债总计 | 468,114,21 3.86 | - | - | - | - | 1,469,107.8 2 | 469,583,32 1.68 |
| 利率敏感度缺 口 | -458,179,44 2.73 | - | 86,434,289. 04 | 1,578,033,8 62.36 | 157,761,55 3.89 | 1,375,671.4 0 | 1,365,425,9 33.96 |
| 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 | 3,066,607.6 1 | - | - | - | - | - | 3,066,607.6 1 |
| 结算备付金 | 793,715.43 | - | - | - | - | - | 793,715.43 |
| 存出保证金 | 12,938.24 | - | - | - | - | - | 12,938.24 |
| 交易性金融资 产 | 20,782,498. 63 | 51,635,769. 40 | 139,623,60 6.76 | 960,639,99 2.98 | - | - | 1,172,681,8 67.77 |
| 买入返售金融 资产 | 32,933,040. 98 | - | - | - | - | - | 32,933,040. 98 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 1,103.10 | 1,103.10 |
| 资产总计 | 57,588,800. 89 | 51,635,769. 40 | 139,623,60 6.76 | 960,639,99 2.98 | - | 1,103.10 | 1,209,489,2 73.13 |
| 负债 | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|-----------|-----------------|---------------|----------------|----------------|---|-------------|----------------|
| 卖出回购金融资产款 | 308,662,624.84 | - | - | - | - | - | 308,662,624.84 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 26,150.96 | 26,150.96 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 235,171.07 | 235,171.07 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 78,390.39 | 78,390.39 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 3,238.91 | 3,238.91 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 88,135.77 | 88,135.77 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 236,786.46 | 236,786.46 |
| 负债总计 | 308,662,624.84 | - | - | - | - | 667,873.56 | 309,330,498.40 |
| 利率敏感度缺口 | -251,073,823.95 | 51,635,769.40 | 139,623,606.76 | 960,639,992.98 | - | -666,770.46 | 900,158,774.73 |

注：上表统计了本基金的利率风险敞口。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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | | |
|----|---|---------------------------------|---------------------|
| 假设 | 影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动； 利率变动范围合理。 | | |
| 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 |
| | 基准利率上升1% | 减少约 34,816,741.41 | 减少约 20,017,692.59 |
| | 基准利率下降1% | 增加约 35,785,688.48 | 增加约 20,599,131.61 |

注：上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

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。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

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 | - |
| 第二层次 | 1,822,229,705.29 |
| 第三层次 | - |
| 合计 | 1,822,229,705.29 |

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。本基金本报告期及上年度可比期间持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

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 | - | - |

| | | | |
|---|-------------------|------------------|--------|
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 1,822,229,705.29 | 99.30 |
| | 其中：债券 | 1,822,229,705.29 | 99.30 |
| | 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 | 9,910,863.59 | 0.54 |
| 8 | 其他各项资产 | 2,868,686.76 | 0.16 |
| 9 | 合计 | 1,835,009,255.64 | 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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期内未买入股票。

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

本基金本报告期内未卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未买卖股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比 |
|----|------|------|----------|
|----|------|------|----------|

| | | | 例(%) |
|----|-----------|------------------|--------|
| 1 | 国家债券 | 86,434,289.04 | 6.33 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 145,757,991.14 | 10.67 |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 413,356,212.06 | 30.27 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 1,176,681,213.05 | 86.18 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 1,822,229,705.29 | 133.46 |

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 019727 | 23 国债 24 | 700,000 | 71,273,328.77 | 5.22 |
| 2 | 2128028 | 21 邮储银行二级 01 | 500,000 | 52,886,743.17 | 3.87 |
| 3 | 240083 | 23 义乌 G2 | 350,000 | 36,458,780.82 | 2.67 |
| 4 | 102382248 | 23 宜昌高新 MTN005 | 300,000 | 32,115,868.85 | 2.35 |
| 5 | 2128042 | 21 兴业银行二级 02 | 300,000 | 31,698,855.74 | 2.32 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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， 21 邮储银行二级 01(2128028.IB)的发行主体中国邮政储蓄银行股份有限公司于 2023 年 7 月 7 日收到中国人民银行出具的行政处罚决定（银罚决字（2023）39 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 | 23,907.54 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 2,844,779.22 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |

| | | |
|---|----|--------------|
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,868,686.76 |

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

本基金本报告期末未持有股票。

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 |
| 光大保德信纯债债券 A | 726 | 1,721,965.95 | 1,236,961,738.01 | 98.95% | 13,185,539.58 | 1.05% |
| 光大保德信纯债债券 C | 1,572 | 27,021.78 | 22,495,154.56 | 52.96% | 19,983,089.18 | 47.04% |
| 合计 | 2,298 | 562,500.23 | 1,259,456,892.57 | 97.43% | 33,168,628.76 | 2.57% |

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 | 光大保德信纯债债券 A | 28,761.80 | 0.00% |
| | 光大保德信纯债债券 C | - | - |
| | 合计 | 28,761.80 | 0.00% |

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 | 光大保德信纯债债券 A | 0~10 |
| | 光大保德信纯债债券 C | - |
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 光大保德信纯债债券 A | - |
| | 光大保德信纯债债券 C | - |
| | 合计 | - |

注：本基金的基金经理未持有本基金的份额。

9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 光大保德信纯债债券 A | 光大保德信纯债债券 C |
|---------------------------------|------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2021 年 11 月 30 日）基金份额总额 | 133,530,957.05 | 166,718,266.74 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 841,172,281.88 | 10,295,517.13 |
| 本报告期基金总申购份额 | 551,590,619.12 | 57,893,997.03 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 142,615,623.41 | 25,711,270.42 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,250,147,277.59 | 42,478,243.74 |

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

本报告期基金投资策略无改变。

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，托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚等情况。

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 | |
| 光大证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华金证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |

注：（1）报告期内租用证券公司交易单元变更情况

本报告期内本基金租用的证券公司交易单元无变更。

（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 |
| 光大证券股份有限公司 | 288,757,566.81 | 67.79% | 392,500,000.00 | 6.81% | - | - |
| 华金证券股份有限公司 | 137,185,503.00 | 32.21% | 5,368,403,000.00 | 93.19% | - | - |

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 | 光大保德信纯债债券型证券投资基金 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 | 同上 | 2024-02-06 |

| | | | |
|----|--|----|------------|
| | 服务的公告 | | |
| 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 | 光大保德信纯债债券型证券投资基金 2023 年年度报告 | 同上 | 2024-03-29 |
| 6 | 光大保德信纯债债券型证券投资基金恢复大额申购、转换转入、定期定额投资的公告 | 同上 | 2024-04-20 |
| 7 | 光大保德信纯债债券型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告 | 同上 | 2024-04-22 |
| 8 | 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 |
| 9 | 光大保德信纯债债券型证券投资基金暂停机构投资者大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告 | 同上 | 2024-05-22 |
| 10 | 光大保德信纯债债券型证券投资基金分红公告 | 同上 | 2024-05-24 |
| 11 | 光大保德信纯债债券型证券投资基金恢复机构投资者大额申购、转换转入、定期定额投资的公告 | 同上 | 2024-05-27 |
| 12 | 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 |
| 13 | 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 |
| 14 | 光大保德信纯债债券型证券投资基金(光大保德信纯债债券 A)基金产品资料概要更新 | 同上 | 2024-06-27 |
| 15 | 光大保德信纯债债券型证券投资基金(光大保德信纯债债券 C)基金产品资料概要更新 | 同上 | 2024-06-27 |
| 16 | 光大保德信纯债债券型证券投资基金招募说明书(更新) | 同上 | 2024-06-27 |

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 | 20240301-20240611 | 85,682,714.25 | 231,955,229.11 | 106,322,267.73 | 211,315,675.63 | 16.35% |
| | 2 | 20240101-20240630 | 636,102,873.42 | 0.00 | 0.00 | 636,102,873.42 | 49.21% |

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。

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

12.2 存放地点

上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢（北区 3 号楼），6-7 层、10 层。

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。客户服务中心电话：4008-202-888，021-80262888。公司网址：www.epf.com.cn。

光大保德信基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日