光大保德信增利收益债券型证券投资基金

2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年十月二十七日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	光大保德信增利收益债券
基金主代码	360008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 10 月 29 日
报告期末基金份额总额	2,119,065,374.85 份
投资目标	本基金主要投资债券类投资工具，在获取基金资产稳定增值的基础上，争取获得高于基金业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将在限定的投资范围内，根据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、市场流动性情况来预测债券市场整体利率趋势，同时结合各具体品种的供需情况、流动性、信用状况和利率敏感度等因素进行综合分析，在严格控制风险的前提下，构建和调整债券投资组合。在非债券类品种投资方面，本基金将充分发挥机构

	投资者在新股询价过程中的积极作用，积极参与新股（含增发新股）的申购、询价和配售，在严格控制整体风险的前提下，提高基金超额收益，力争为投资者提供长期稳定投资回报。 1．资产配置策略 本基金采取稳健的资产配置策略，通过固定收益类证券的积极管理，力求提升收益的稳定性，降低基金份额净值的波动风险；同时，根据股票市场的趋势研判及新发行股票上市公司基本面的研究，积极参与风险较低的一级市场新股申购和增发新股，力求在稳定收益的基础上，适度提高基金资产的总收益率。 2.债券投资策略 本基金将主要采用宏观分析和微观定价两个方面进行债券类投资组合的构建，宏观层面主要关注影响债券收益率水平的各个因素，包括宏观经济所处周期、货币财政政策取向、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。在确定固定收益投资组合的具体品种时，本基金将根据市场对于个券的市场成交情况，对各个目标投资对象进行利差分析，包括信用利差，流动性利差，期权调整利差（OAS），并利用利率模型对利率进行模拟预测，选出定价合理或被低估，到期期限符合组合构建要求的固定收益品种。 (1) 类属资产配置策略 对类属资产配置进行决策的主要依据是对不同债券资产类收益与风险的估计和判断。我们基于对未来的宏观经济和利率环境的研究和预测，根据国债、金融债、企业债等不同品种的信用利差变动情况,以及各品种的市场容量和流动性情况,通过情景分析的方法，判断各个债券资产类属

	的预期回报，在不同债券品种之间进行配置。具体考量指标包括收益率分析、利差分析、信用等级分析和流动性分析，以此确定各类属资产的相对收益和风险因素，并以此进行投资判断依据。 （2）组合久期调整策略 在债券投资过程中,期限因素是决定债券风险收益特征最重要的因素。因此，我们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，从而确定合理的组合久期，以及组合采取的收益率曲线策略。并根据对市场利率水平的预期，在预期市场利率下降时，增加组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益，在预期利率上升时，减小组合久期，以规避债券价格下降的风险。除此以外,本基金的投资还将根据不同期限的收益率变动情况,在长期、中期和短期债券间进行配置，以期在收益率曲线调整的过程中获得较好收益。 (3) 骑乘策略 当收益率曲线比较陡峭时，通过分析收益率曲线各期限段的利差情况，买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，随着持有期限的增加，债券的剩余期限将会缩短，从而此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，而通过债券的收益率的下调获得资本利得收益。 (4) 信用利差策略 随着债券市场的发展，企业债和公司债的发行将快速发展，我们预计大批优质企业将在交易所或者银行间市场发行债券。在这种情况下，本基金将通过对行业经济周期、发行主体内外部评级和市场利差分析等判断，加强对企业债、资产抵押债券等新品种的投资，并通过对信用利差的分析和管理，获取超额收益。

	(5) 杠杆投资策略 在本基金的日常投资中，还将充分利用组合的回购杠杆操作，在严格头寸管理的基础上，在资金相对充裕的情况下进行风险可控的杠杆投资策略。 (6) 跨市场套利投资策略 目前我国的债券市场分成交易所和银行间两个投资市场，其参与主体、资金量、交易模式等方面均存在较大的差异，本基金将关注银行间市场和交易所市场之间的利差波动情况，以博取跨市场的套利机会。 3. 可转换债券投资策略 可转换债券由于兼顾权益证券和固定收益类证券的特性，具有抵御股价下行风险、分享股票上涨的投资回报，本基金管理人将通过对可转换债券股性和债性的分析，把握可转换债券的价值投向，同时紧密依托行业研究员对于个股基本面的走势判断，综合考虑上市公司基本情况、转债的股性债性等特性以及流动性等要素，选择适当的可转换债券品种。投资方式可以选择二级市场买入也可一级市场申购。本基金持有的可转换债券在进入转股期后可转换为股票持有，但必须在所持有的可转换债券转换成公司股票之日起三个交易日内卖出。 4．新股申购策略 本基金在参与股票一级市场投资的过程中，本基金管理人将充分发挥机构投资者在询价、定价方面的特长，依托公司现有的投研体系的支撑，全面深入的把握上市公司基本面状况，深入发掘其内在价值，在基金合同规定的额度内，积极参与新股申购（含增发新股）、询价和配售。 本基金的新股申购投资作为债券投资的补充，将紧密依托公司现有的定量分析模型，通过统一的价值评估框架和量化管理，综合考虑发行新股的上市公司的经营绩效增长潜

	力和市场估值水平，以合理的价格积极参与一级市场新股发行，为投资者获取稳定的套利回报，本基金申购的新股（含增发新股及分离交易可转债之权证部分）在挂牌交易上市首日起三个交易日内择机卖出。 5. 资产支持证券等品种投资策略 包括资产抵押贷款支持证券(ABS)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等在内的资产支持证券,其定价受多种因素影响,包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。本基金将深入分析上述基本面因素,并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型,评估其内在价值。	
业绩比较基准	中证全债指数收益率*80%+中证可转换债券指数收益率*15%+活期存款基准利率*5%	
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，低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	光大保德信增利收益债券 A	光大保德信增利收益债券 C
下属分级基金的交易代码	360008	360009
报告期末下属分级基金的份额总额	1,561,246,002.31 份	557,819,372.54 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日)	
	光大保德信增利收益债券 A	光大保德信增利收益债券 C

1.本期已实现收益	7,306,575.51	1,642,159.05
2.本期利润	23,938,344.69	8,414,209.32
3.加权平均基金份额本期利润	0.0136	0.0136
4.期末基金资产净值	2,237,657,233.93	780,428,773.57
5.期末基金份额净值	1.433	1.399

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、光大保德信增利收益债券 A：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.77%	0.12%	0.64%	0.04%	0.13%	0.08%
过去六个月	-0.28%	0.11%	1.96%	0.05%	-2.24%	0.06%
过去一年	0.28%	0.11%	3.44%	0.05%	-3.16%	0.06%
过去三年	14.64%	0.26%	14.20%	0.09%	0.44%	0.17%
过去五年	24.46%	0.23%	24.27%	0.08%	0.19%	0.15%
过去七年	46.67%	0.23%	35.21%	0.08%	11.46%	0.15%
过去十年	57.14%	0.20%	49.24%	0.08%	7.90%	0.12%
自基金合同生效起至今	126.59%	0.19%	115.27%	0.07%	11.32%	0.12%

2、光大保德信增利收益债券 C：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.72%	0.13%	0.64%	0.04%	0.08%	0.09%
过去六个月	-0.50%	0.12%	1.96%	0.05%	-2.46%	0.07%
过去一年	-0.07%	0.11%	3.44%	0.05%	-3.51%	0.06%
过去三年	13.28%	0.26%	14.20%	0.09%	-0.92%	0.17%
过去五年	22.17%	0.23%	24.27%	0.08%	-2.10%	0.15%
过去七年	42.92%	0.23%	35.21%	0.08%	7.71%	0.15%
过去十年	51.28%	0.20%	49.24%	0.08%	2.04%	0.12%
自基金合同	110.92%	0.19%	115.27%	0.07%	-4.35%	0.12%

生效起至今						

注：为更好地反映债券市场整体运行情况和本基金管理人旗下相关基金投资组合的运作情况，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，自2014年1月1日起，将本基金的业绩比较基准由原“中信标普全债指数”变更为“中证全债指数”；自2026年9月21日起，本基金的业绩比较基准由“中证全债指数”调整为“中证全债指数收益率*80%+中证可转换债券指数收益率*15%+活期存款基准利率*5%”。

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

光大保德信增利收益债券型证券投资基金

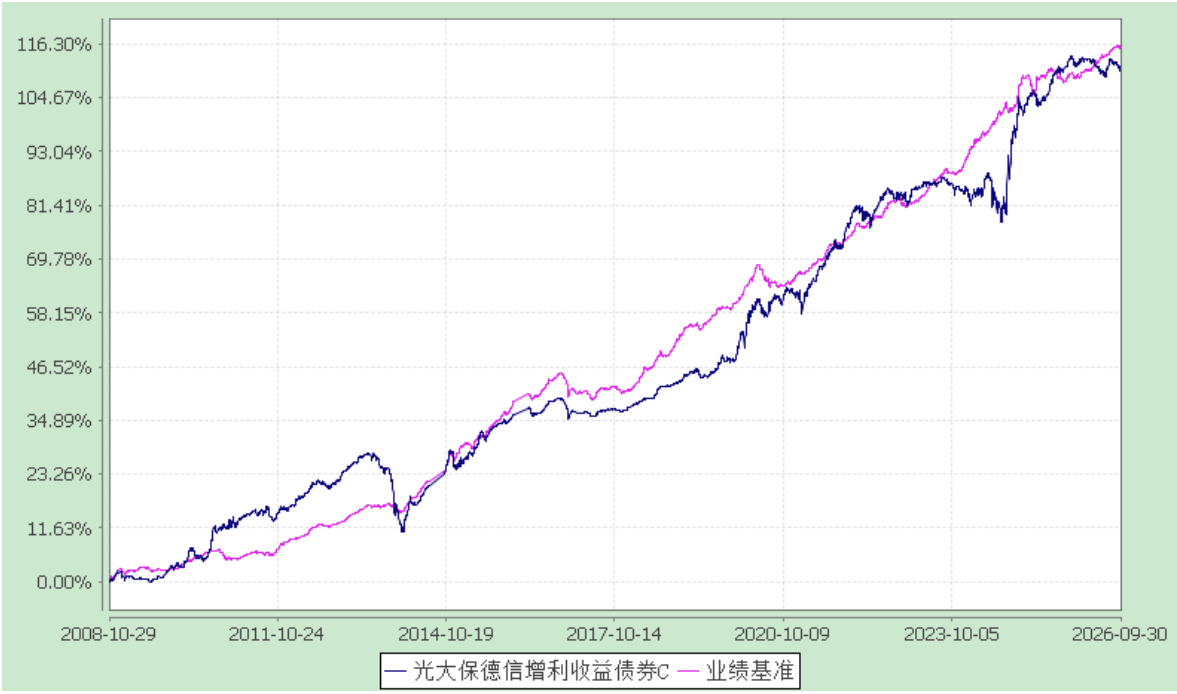
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2008 年 10 月 29 日至 2026 年 9 月 30 日)

1．光大保德信增利收益债券 A：



2．光大保德信增利收益债券 C：



注：为更好地反映债券市场整体运行情况和本基金管理人旗下相关基金投资组合的运作情况，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，自 2014 年 1 月 1 日起，将本基金的业绩比较基准由原“中信标普全债指数”变更为“中证全债指数”；自 2026 年 9 月 21 日起，本基金的业绩比较基准由“中证全债指数”调整为“中证全债指数收益率*80%+中证可转换债券指数收益率*15%+活期存款基准利率*5%”。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄波	副总经理、首席投资总监、固收管理总部负责人、固收多策略投资	2019-10-09	-	14 年	黄波先生，2009 年毕业于南京大学，2012 年获得复旦大学金融学硕士学位。2012 年 7 月至 2016 年 5 月在平安养老保险股份有限公司任职固定收益部助理投资经理；2016 年 5 月至 2017 年 9 月在长信基金管理有限公司任职固定收益部专户投资经理；2017 年 9 月至 2019 年 6 月在圆信永丰基金管理有限公司任职专户投资部副总监；

	团队长、固收专户团队长、基金经理				2019 年 6 月加入光大保德信基金管理有限公司，先后担任基金经理、固收管理总部负责人、固收多策略投资团队长、固收专户团队长、总经理助理，现任公司副总经理、首席投资总监、固收管理总部负责人、固收多策略投资团队长、固收专户团队长、基金经理，2019 年 10 月至 2024 年 9 月担任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（已清盘）的基金经理，2019 年 10 月至今担任光大保德信中高等级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、光大保德信增利收益债券型证券投资基金、光大保德信信用添益债券型证券投资基金的基金经理，2019 年 11 月至 2020 年 12 月担任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的基金经理，2020 年 1 月至 2023 年 4 月担任光大保德信欣鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2020 年 1 月至 2022 年 10 月担任光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2020 年 10 月至今担任光大保德信安泽债券型证券投资基金的基金经理，2020 年 12 月至今担任光大保德信安瑞一年持有期债券型证券投资基金的基金经理，2021 年 6 月至 2026 年 4 月担任光大保德信安阳一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。

注：对基金的非首任基金经理，其任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

4.2管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规的规定和基金合同、招募说明书等有关法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为充分保护持有人利益，确保本基金管理人旗下各基金在获得投研团队、交易团队支持等各方面得到公平对待，本基金管理人从投研制度设计、组织结构设计、工作流程制定、技术系统建设和完善、公平交易执行效果评估等各方面出发，建设形成了有效的公平交易执行体系。本报告期，本基金管理人各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的现象。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金与其他投资组合未发生交易所公开竞价同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的交易。

4.4报告期内基金投资策略和运作分析

三季度，实际 GDP 增速较二季度小幅回升。增长动力上，社会消费品零售转弱，汽车零售降幅走阔，其他政策效应进一步消退，因此消费修复力度有限。固定资产投资累计同比降幅持续扩大，制造业投资与基建投资虽边际企稳但仍在负增长区间，房地产开发投资仍处于调整，建筑业新订单偏弱，地产对总投资的影响尚未实质性缓解。外需表现强劲，出口总额延续高增，对东盟出口保持韧性，科技产业链出口持续扩张，AI 相关需求和全球电子产业链高景气构成核心支撑，净出口对经济贡献显著。物价方面，受外部环境推动，国际油价明显上行，国内 PPI 同比回升，能源和 AI 产业链价格上行集中，CPI 运行温和，核心 CPI 低位持稳，中下游行业利润有一定压力。海外方面，美国三季度 GDP 增长强劲，但结构上 K 型特征强化，算力相关投资高增而居民消费边际弱化；劳动力市场转冷，失业率反弹，时薪涨幅放缓，但核心通胀仍具粘性，美联储在呵护就业与抗通胀之间权衡更加艰难。

展望四季度，国内实际 GDP 增速有望保持在合理区间。投资端，政策性金融工具和新型政策性工具有序投放，基建投资增速有望从低位回升，成为稳增长的核心抓手；但地产整体仍难有明显好转，拖累斜率或边际放缓。出口方面，AI 相关需求和亚洲电子产业链景气仍在高位，四季

度出口大幅回落的可能性较低，但随出口基数抬高和国际贸易环境不确定性上升，对经济增长的拉动作用可能边际减弱。整体看，四季度经济在政策托底下或延续温和修复态势，基建投资的回升强度、消费的企稳程度以及海外贸易环境的变化是核心观察变量。

基金保持高信用资质配置、注重组合流动性管理的特征：信用债以精选中短久期的高等级信用债配置为主，分散投资，保障组合固收资产具有良好的流动性；转债市场三季度先涨后跌，组合转债仓位先降后升。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内本基金 A 份额净值增长率为 0.77%，业绩比较基准收益率为 0.64%，C 份额净值增长率为 0.72%，业绩比较基准收益率为 0.64%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	3,713,563,154.50	97.67
	其中：债券	3,713,563,154.50	97.67
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	33,135,565.68	0.87
7	其他资产	55,609,903.34	1.46
8	合计	3,802,308,623.52	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 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投资的股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	207,141,461.36	6.86
2	央行票据	-	-
3	金融债券	834,772,274.53	27.66
	其中：政策性金融债	225,016,920.55	7.46
4	企业债券	536,652,158.38	17.78
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	1,270,403,135.62	42.09
7	可转债（可交换债）	854,701,894.72	28.32
8	同业存单	9,892,229.89	0.33
9	其他	-	-
10	合计	3,713,563,154.50	123.04

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	243970	25 中证 G8	2,100,000	213,844,841.09	7.09
2	102280558	22 川能投 MTN001	1,500,000	154,313,663.01	5.11
3	241191	24 光明 01	1,500,000	151,320,821.93	5.01
4	243921	25GTHT14	1,400,000	143,435,623.02	4.75
5	113042	上银转债	1,000,680	117,552,895.35	3.89

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同，本基金不能投资于股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金不能投资于国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不能投资于国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券中，25GTHT14(243921 SH)的发行主体国泰海通证券股份有限公司于 2025 年 12 月 5 日收到深圳证券交易所的监管函（大中小深证函[2025]1200 号）、于 2026 年 3 月 2 日收到中国证券监督管理委员会上海监管局出具的警示函、于 2026 年 8 月 17 日收到外汇管理局的行政处罚（上海汇管罚字[2026]22 号）。

上银转债（113042 SH）的发行主体上海银行股份有限公司于 2026 年 1 月 28 日收到上海金融监管局的行政处罚（沪金罚决字[2026]17-20、22、23 号），于 2026 年 8 月 23 日收到上海金融监管局的行政处罚（沪金罚决字[2026]108 号）。

基金管理人按照内部研究工作规范对该发行主体进行分析后将其列入基金投资对象备选库并跟踪研究。该行政处罚事件发生后，基金管理人密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

除上述证券外，报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定备选股票库之外的股票。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	164,495.70
2	应收证券清算款	54,948,225.58
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	497,182.06
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	55,609,903.34

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113042	上银转债	117,552,895.35	3.89
2	118034	晶能转债	113,297,882.77	3.75
3	110085	通 22 转债	81,398,468.48	2.70
4	127089	晶澳转债	70,695,673.90	2.34
5	113053	隆 22 转债	61,263,766.91	2.03
6	127061	美锦转债	60,851,504.16	2.02
7	113605	大参转债	58,611,782.00	1.94
8	113052	兴业转债	45,398,201.25	1.50
9	123107	温氏转债	45,246,036.42	1.50
10	113043	财通转债	30,120,002.04	1.00
11	118031	天 23 转债	28,548,044.88	0.95
12	118005	天奈转债	27,658,784.95	0.92
13	118022	锂科转债	23,258,794.15	0.77
14	127045	牧原转债	17,253,305.95	0.57
15	128142	新乳转债	15,508,907.38	0.51
16	123113	仙乐转债	14,441,269.16	0.48
17	123117	健帆转债	9,829,711.04	0.33
18	127040	国泰转债	9,183,300.03	0.30
19	113051	节能转债	6,642,064.14	0.22
20	113666	爱玛转债	4,788,131.51	0.16
21	123119	康泰转 2	4,687,147.07	0.16
22	127062	垒知转债	4,453,326.00	0.15
23	127030	盛虹转债	4,012,895.18	0.13

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	光大保德信增利收益债券A	光大保德信增利收益债券C
本报告期期初基金份额总额	1,936,183,083.68	731,006,025.67
报告期期间基金总申购份额	55,140,633.00	15,798,266.83
减：报告期期间基金总赎回份额	430,077,714.37	188,984,919.96

报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	1,561,246,002.31	557,819,372.54

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期内基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在持有、申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期不存在单一投资者持有基金份额比例超过20%的情形。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据 2026 年 8 月 22 日《光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告》，2026 年 9 月 21 日起基金管理人将光大保德信增利收益债券型证券投资基金的业绩比较基准由中证全债指数调整为中证全债指数收益率*80%+中证可转换债券指数收益率*15%+活期存款基准利率*5%，并对基金合同等法律文件有关条款进行修订。详情请见公告。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

1、中国证监会批准光大保德信增利收益债券型证券投资基金设立的文件

2、光大保德信增利收益债券型证券投资基金基金合同

3、光大保德信增利收益债券型证券投资基金招募说明书

4、光大保德信增利收益债券型证券投资基金托管协议

5、光大保德信增利收益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增利收益债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

9、中国证监会要求的其他文件

9.2存放地点

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

9.3查阅方式

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

光大保德信基金管理有限公司

二〇二六年十月二十七日