

**光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金**  
**2017 年半年度报告**  
**2017 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：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十六日

## 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 25 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 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                              |    |
|----------------------------------------------|----|
| <b>1 重要提示及目录</b> .....                       | 2  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2  |
| <b>2 基金简介</b> .....                          | 5  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 7  |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 8  |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 8  |
| <b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                 | 8  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 8  |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 9  |
| <b>4 管理人报告</b> .....                         | 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.....              | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 12 |
| 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 |
| <b>5 托管人报告</b> .....                         | 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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....      | 15 |
| <b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....               | 16 |
| 6.1 资产负债表.....                               | 16 |
| 6.2 利润表.....                                 | 17 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 18 |
| 6.4 报表附注.....                                | 18 |
| <b>7 投资组合报告</b> .....                        | 36 |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 36 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 37 |
| 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.....       | 37 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 38 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 39 |
| 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.....      | 40 |
| 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.....   | 40 |
| 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.....   | 40 |
| 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.....      | 40 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....               | 40 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....               | 41 |
| 7.12 投资组合报告附注.....                           | 41 |
| <b>8 基金份额持有人信息</b> .....                     | 42 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                   | 42 |

|           |                                     |           |
|-----------|-------------------------------------|-----------|
| 8.2       | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....          | 42        |
| 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 ..... | 42        |
| <b>9</b>  | <b>开放式基金份额变动</b> .....              | <b>43</b> |
| <b>10</b> | <b>重大事件揭示</b> .....                 | <b>43</b> |
| 10.1      | 基金份额持有人大会决议 .....                   | 43        |
| 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 .....   | 43        |
| 10.3      | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 43        |
| 10.4      | 基金投资策略的改变 .....                     | 43        |
| 10.5      | 报告期内改聘会计师事务所情况 .....                | 43        |
| 10.6      | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....      | 43        |
| 10.7      | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....             | 44        |
| 10.8      | 其他重大事件 .....                        | 45        |
| <b>11</b> | <b>影响投资者决策的其他重要信息</b> .....         | <b>46</b> |
| <b>12</b> | <b>备查文件目录</b> .....                 | <b>46</b> |
| 12.1      | 备查文件目录 .....                        | 46        |
| 12.2      | 存放地点 .....                          | 47        |
| 12.3      | 查阅方式 .....                          | 47        |

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                      |             |
|-----------------|----------------------|-------------|
| 基金名称            | 光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金 |             |
| 基金简称            | 光大保德信铭鑫混合            |             |
| 基金主代码           | 002773               |             |
| 交易代码            | 002773               |             |
| 基金运作方式          | 契约型开放式               |             |
| 基金合同生效日         | 2016 年 10 月 17 日     |             |
| 基金管理人           | 光大保德信基金管理有限公司        |             |
| 基金托管人           | 中国民生银行股份有限公司         |             |
| 报告期末基金份额总额      | 500,051,954.31 份     |             |
| 基金合同存续期         | 不定期                  |             |
| 下属分级基金的基金简称     | 光大保德信铭鑫混合 A          | 光大保德信铭鑫混合 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 002773               | 002774      |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 500,044,336.62 份     | 7,617.69 份  |

### 2.2 基金产品说明

|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金力争在股票、债券和现金等大类资产的灵活配置与稳健投资下，获取长期、持续、稳定的合理回报。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将通过宏观经济基本面及证券市场双层面的数据进行研究，并通过定性定量分析、风险测算及组合优化，最终形成大类资产配置决策。</p> <p>（1）宏观经济运行的变化和国家的宏观调控政策将对证券市场产生深刻影响。本基金通过综合国内外宏观经济状况、国家财政政策、央行货币政策、物价水平变化趋势等因素，构建宏观经济分析平台；</p> <p>（2）运用历史数据并结合基金管理人内部的定性和定量分析模型，确定影响各类资产收益水平的先行指标，将上一步的宏观经济分析结果量化为对先行指标的影响，进而判断对各类资产收益的影响；</p> <p>（3）结合上述宏观经济对各类资产未来收益影响的分析结果和本基金投资组合的风险预算管理，确定各类资产的投资比重。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金将结合自上而下行业分析与自下而上研究入库的投资理念，在以整个宏观策略为前提，把握结构性调整机会，将行业分析与个股精选相结合，寻找出表现优异的子行业和优质个股，并将这些股票组成本基金的核心股票库。</p> <p>（1）行业分析</p> <p>在综合考虑行业的周期、竞争格局、技术进步、政府政策、社会习惯的改变等因素后，精选出行业地位高、行业的发展空间大的子行业。</p> <p>（2）个股选择</p> <p>本基金将在核心股票库的基础上，以定性和定量相结合的方式，从价值和</p> |

成长等因素对个股进行选择,综合考虑上市公司的增长潜力与市场估值水平,精选估值合理且成长性良好的上市公司进行投资。同时,本基金关注国家相关政策、事件可能对上市公司的当前或未来价值产生的重大影响,本基金将在深入挖掘这类政策、事件的基础上,对行业进行优化配置和动态调整。

#### 1) 定量分析

本基金结合盈利增长指标、现金流量指标、负债比率指标、估值指标、盈利质量指标等与上市公司经营有关的重要定量指标,对目标上市公司的价值进行深入挖掘,并对上市公司的盈利能力、财务质量和经营效率进行评析,为个股选择提供依据。

#### 2) 定性分析

本基金认为股票价格的合理区间并非完全由其财务数据决定,还必须结合企业学习与创新能力、企业发展战略、技术专利优势、市场拓展能力、公司治理结构和管理水平、公司的行业地位、公司增长的可持续性 etc 等定性因素,给予股票一定的折溢价水平,并最终决定股票合理的价格区间。根据上述定性定量分析的结果,本基金进一步从价值和成长两个纬度对备选股票进行评估。对于价值被低估且成长性良好的股票,本基金将重点关注;对于价值被高估但成长性良好,或价值被低估但成长性较差的股票,本基金将通过深入的调研和缜密的分析,有选择地进行投资;对于价值被高估且成长性较差的股票,本基金不予考虑投资。

#### 3、固定收益类品种投资策略

本基金投资于固定收益类品种的目的在于保证基金资产流动性的基础上,使基金资产得到更加合理有效的利用,从而提高投资组合收益。为此,本基金固定收益类资产的投资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。

#### 4、股指期货投资策略

本基金将在风险可控的前提下,以套期保值为目的,根据对现货和期货市场的分析,充分考虑股指期货的风险收益特征,通过多头或空头的套期保值策略,以改善投资组合的投资效果,实现股票组合的超额收益。

#### 5、国债期货投资策略

基金管理人可运用国债期货,以提高投资效率。本基金在国债期货投资中将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与国债期货的投资,以管理投资组合的利率风险,改善组合的风险收益特性。

#### 6、中小企业私募债券投资策略

与传统的信用债相比,中小企业私募债券采取非公开方式发行和交易,整体流动性相对较差,而且受到发债主体资产规模较小、经营波动性较高、信用基本面稳定性较差的影响,整体的信用风险相对较高。因此,对于中

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>小企业私募债券的投资应采取更为谨慎的投资策略。本基金认为，投资该类债券的核心要点是对个券信用资质进行详尽的分析，并综合考虑发行人的企业性质、所处行业、资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素，确定最终的投资决策。</p> <p>7、证券公司短期公司债券投资策略<br/>本基金通过对证券公司短期公司债券发行人基本面的深入调研分析，结合发行人资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性以及债券流动性、信用利差、信用评级、违约风险等的综合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券进行投资。</p> <p>8、资产支持证券投资策略<br/>资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产支持证券。</p> <p>9、权证及其他品种投资策略<br/>本基金在权证投资中将权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价量化模型估算权证价值，主要考虑运用的策略有：价值挖掘策略、杠杆策略、双向权证策略、获利保护策略和套利策略等。<br/>同时，法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，本基金若认为有助于基金进行风险管理和组合优化的，可依据法律法规的规定履行适当程序后，运用金融衍生产品进行投资风险管理工作。</p> |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人                                | 基金托管人                 |
|-------------|------|--------------------------------------|-----------------------|
| 名称          |      | 光大保德信基金管理有限公司                        | 中国民生银行股份有限公司          |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 魏丹                                   | 罗菲菲                   |
|             | 联系电话 | 021-80262888                         | 010-58560666          |
|             | 电子邮箱 | epfservice@epf.com.cn                | tgbfxjdzx@cmbc.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 4008-202-888                         | 95568                 |
| 传真          |      | 021-80262468                         | 010-58560798          |
| 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层至10层       | 北京市西城区复兴门内大街2号        |
| 办公地址        |      | 上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢（北区3号楼）6层至10层 | 北京市西城区复兴门内大街2号        |

|       |        |        |
|-------|--------|--------|
| 邮政编码  | 200010 | 100031 |
| 法定代表人 | 林昌     | 洪崎     |

## 2.4 信息披露方式

|                      |                                |
|----------------------|--------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称       | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》         |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.epf.com.cn                 |
| 基金半年度报告备置地点          | 光大保德信基金管理有限公司、民生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 层至 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（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日） |             |
|---------------|--------------------------------------|-------------|
|               | 光大保德信铭鑫混合 A                          | 光大保德信铭鑫混合 C |
| 本期已实现收益       | 8,168,519.07                         | 254.62      |
| 本期利润          | 15,472,276.74                        | 505.69      |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0309                               | 0.0289      |
| 本期加权平均净值利润率   | 3.05%                                | 2.86%       |
| 本期基金份额净值增长率   | 3.10%                                | 3.04%       |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2017 年 6 月 30 日)                |             |
|               | 光大保德信铭鑫混合 A                          | 光大保德信铭鑫混合 C |
| 期末可供分配利润      | 10,718,416.57                        | 157.33      |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0214                               | 0.0207      |
| 期末基金资产净值      | 515,889,385.75                       | 7,853.06    |
| 期末基金份额净值      | 1.0317                               | 1.0309      |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2017 年 6 月 30 日)                |             |
|               | 光大保德信铭鑫混合 A                          | 光大保德信铭鑫混合 C |
| 基金份额累计净值增长率   | 3.17%                                | 3.09%       |

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。

(4) 本基金合同于 2016 年 10 月 17 日生效，未满一年。

### 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

光大保德信铭鑫混合 A

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | 1.11%    | 0.11%       | 3.09%      | 0.34%         | -1.98% | -0.23% |
| 过去三个月      | 1.71%    | 0.09%       | 3.10%      | 0.32%         | -1.39% | -0.23% |
| 过去六个月      | 3.10%    | 0.08%       | 5.20%      | 0.29%         | -2.10% | -0.21% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.17%    | 0.07%       | 4.17%      | 0.33%         | -1.00% | -0.26% |

光大保德信铭鑫混合 C

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | 1.10%    | 0.11%       | 3.09%      | 0.34%         | -1.99% | -0.23% |
| 过去三个月      | 1.68%    | 0.09%       | 3.10%      | 0.32%         | -1.42% | -0.23% |
| 过去六个月      | 3.04%    | 0.08%       | 5.20%      | 0.29%         | -2.16% | -0.21% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.09%    | 0.07%       | 4.17%      | 0.33%         | -1.08% | -0.26% |

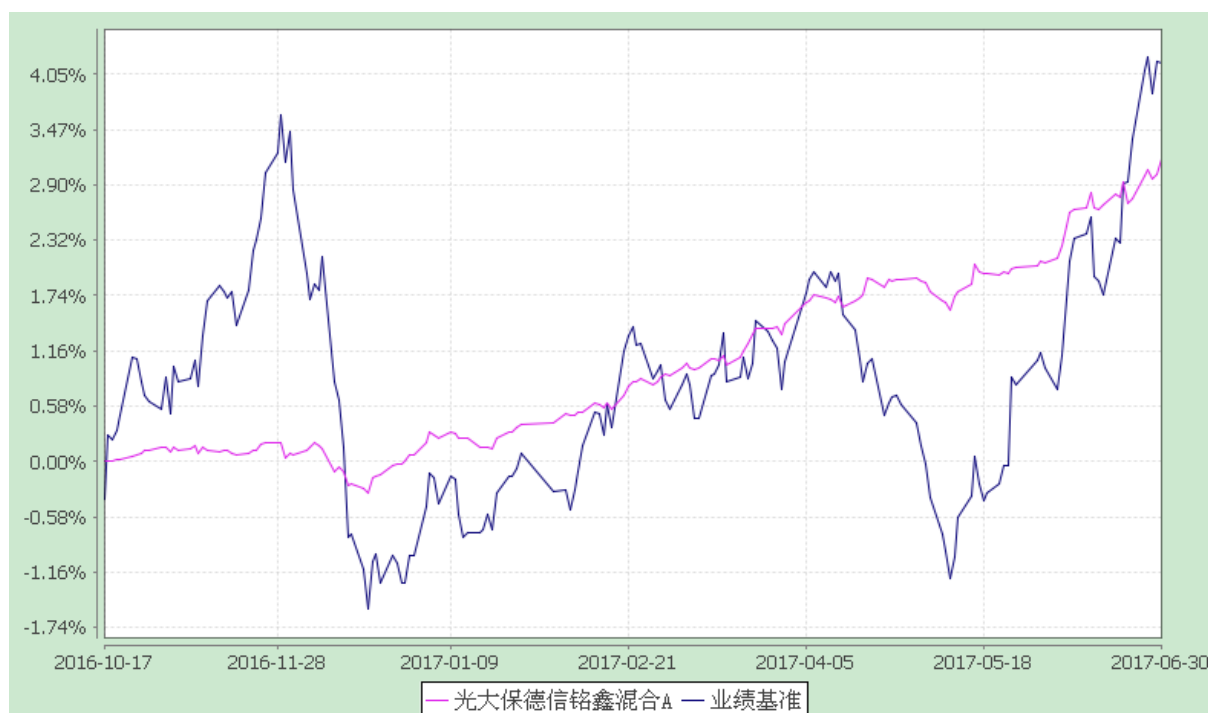
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金

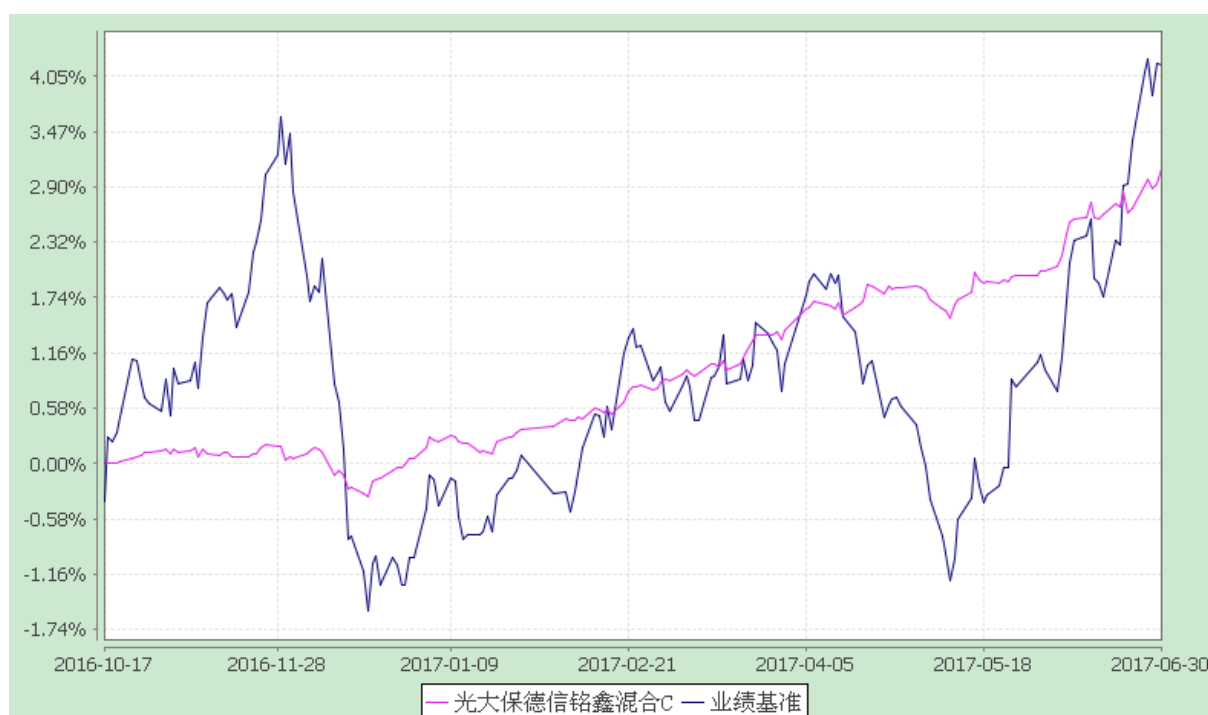
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016 年 10 月 17 日至 2017 年 6 月 30 日)

光大保德信铭鑫混合 A



光大保德信铭鑫混合 C



注：根据基金合同的规定，本基金建仓期为 2016 年 10 月 17 日至 2017 年 4 月 16 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

## 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 2017 年 6 月 30 日，光大保德信旗下管理着 37 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、光大保德信添天盈月度理财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、光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金、光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金、光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信一带一路战略主题混合型证券投资基金、光大保德信耀钱包货币市场基金、光大保德信欣鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信尊享一年定期开放债券型证券投资基金、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、光大保德信吉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、光大保德信铭鑫灵活配置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、光大保德信安祺债券型证券投资基金、光大保德信安和债券型证券投资基金、光大保德信事件驱动灵活配置混合型证券投资基金、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。

#### 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 |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|-----|------|------------|------|-----|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 杨烨超 | 基金经理 | 2016-10-17 | -    | 6 年 | 杨烨超先生，硕士。2007 年毕业于复旦大学世界经济系，2010 年获得复旦大学世界经济系的硕士学位。自 2010 年 7 月加入光大保德信基金管理有限公司，先后担任市场部产品助理、产品经理（负责产品设计研究等），2014 年 3 月至 2015 年 11 月担任固定收益部研究员，现任光大保德信耀钱包货币市场基金基金经理、光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、光大保德信永鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、光大保德信恒利纯债债券型证券投资基金基金经理、光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、光大保德信诚鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、光大保德信永利纯债债券型证券投资基金基金经理、光大保德信货币市场基金基金经理。 |

注：1、“任职日期”和“离任日期”分别为公司决定确定的聘任日期和解聘日期；  
2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 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 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

2017 年上半年国内经济整体表现较好，呈现一定的韧性。一季度 GDP 实现 6.9% 增长，延续去年四季度以来的回升态势，工业生产和固定资产投资均有较好表现，消费略有下滑。二季度经济数据出现一定波动，4 月单月制造业投资增速回落，基建和房地产投资 4 月稳定。进入 5 月经济表现出一定的韧性，工业生产超预期，工业企业盈利增速保持高位，固定资产投资受基建和房地产增速拖累有所回落。但进入 6 月后，高频数据显示，部分工业原材料价格反弹，高炉开工率回升，经济继续保持一定的韧性。通货膨胀方面，CPI 今年 1-2 月由于春节错位有所扰动，3 月以来逐步抬升，整体通胀压力一般。今年以来全球经济进入弱复苏态势，带动出口增速整体较好。展望下半年，在房地产调控和金融监管的共同作用下，基本面总需求不足或将使经济增长动力较弱，另一方面叠加去年下半年高基数影响，经济下半年仍面临较大的回落压力。

货币政策方面，2017 年上半年央行维持稳健中性的基调，虽然总量政策维持稳定，在资金面的波动在加大，资金价格中枢明显抬升。一季度央行两次上调公开市场逆回购、中期借贷便利（MLF）以及常备借贷便利（SLF）等货币政策工具的操作利率，除了价格提升外，一季度总量上为净回笼。进入二季度，一行三会密集出台多项金融监管措施，尤其是银监会的“三三四”等监管措施引发市场担忧，资金面承压，利率也明显上行。虽然二季度末市场流动性整体宽松，平稳跨季，但预计未来货币政策基调仍将以经济基本面为中心，继续保持稳健中性。

市场运行方面，2017 年上半年利率在震荡中整体上行，面临的主要影响包括国内较强的经济基本面、金融监管超预期、海外启动加息周期等压力，10 年国债波动区间为 3.1%-3.7%，10 年国开为 3.7%-4.4%。二季度由于超预期的金融监管和经济数据利率出现快速上行并触及今年的高点，期限利差收至历史极低位置，收益率曲线异常平坦。5 月中旬以来，由于严监管的缓和及流动性相对宽松，利率经历一波平稳下行。

本基金在 1 季度日常操作中债券部分保持了相对较低的杠杆和久期，在收益率震荡上行的过程中，较好地保持了票息收益，控制了组合波动。2 季度前半段本基金仍保持低久期低杠杆，进入 6 月后久期略有提高，获取了一部分资本利得收益。我们认为债券市场当前已经具备了一定的配置价值，但市场可能仍有波动，基金配置应攻守兼备，控制久期并获取稳定票息收益。中长期看利率的走势还是与基本面走势保持一致，在判断经济下行风险尚未消除的前提下，2017 年债券市场仍有机

会，但期间的波动不可忽视。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内 A 类份额净值增长率为 3.10%，业绩比较基准收益率为 5.20%，C 类份额净值增长率为 3.04%，业绩比较基准收益率为 5.20%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金将会密切关注国际国内经济形势和货币、财政政策的动态，在固定收益类资产投资方面，本基金将严控组合信用风险，规避低等级信用债的持仓，增持优质信用债，控制组合久期和杠杆，择机参与利率债的阶段性行情来增强组合投资收益，争取提高组合收益率的确定性和稳定性。在权益市场方面，适度参与权益市场行情，从获得绝对收益的角度，在控制组合净值波动的前提下，为组合增强收益。

#### 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（包括权益、固定收益业务板块）、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特别估值方案，同时审慎平衡托管行、审计师意见和基金同业的惯常做法，与托管行沟通后形成建议，经公司管理层批准后由运营部具体执行。估值委员会提交建议一般需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；投资研究部负责估值政策调整对投资业绩影响的评估；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**

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

#### **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**

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，本基金未进行利润分配

#### **5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            | -                              | -                                |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 116,209,627.66                 | 103,708,042.35                   |
| 结算备付金           |            | 1,449,749.19                   | 4,542,024.72                     |
| 存出保证金           |            | 60,628.83                      | 21,048.85                        |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 554,438,587.04                 | 349,788,442.79                   |
| 其中：股票投资         |            | 50,270,587.04                  | 37,807,912.19                    |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 504,168,000.00                 | 311,980,530.60                   |
| 资产支持证券投资        |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | 14,000,000.00                  | 41,000,000.00                    |
| 应收证券清算款         |            | 974,889.04                     | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 10,558,107.06                  | 2,947,879.06                     |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | -                              | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 697,691,588.82                 | 502,007,437.77                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2017 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2016 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            | -                              | -                                |
| 短期借款            |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          |            | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | 181,169,528.24                 | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                              | 996,666.68                       |
| 应付赎回款           |            | -                              | -                                |
| 应付管理人报酬         | 6.4.10.2   | 253,014.42                     | 254,046.35                       |
| 应付托管费           | 6.4.10.2   | 63,253.61                      | 63,511.57                        |
| 应付销售服务费         | 6.4.10.2   | 0.60                           | 2.17                             |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 97,080.46                      | 85,762.51                        |
| 应交税费            |            | -                              | -                                |



|               |          |                |                |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应付利息          |          | 37,911.78      | -              |
| 应付利润          |          | -              | -              |
| 递延所得税负债       |          | -              | -              |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 173,560.90     | 144,000.00     |
| 负债合计          |          | 181,794,350.01 | 1,543,989.28   |
| <b>所有者权益：</b> |          | -              | -              |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 500,051,954.31 | 500,090,320.11 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 15,845,284.50  | 373,128.38     |
| 所有者权益合计       |          | 515,897,238.81 | 500,463,448.49 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 697,691,588.82 | 502,007,437.77 |

## 6.2 利润表

会计主体：光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号      | 本期                              |                      |
|-----------------------|----------|---------------------------------|----------------------|
|                       |          | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |                      |
| <b>一、收入</b>           |          |                                 | <b>18,300,100.27</b> |
| 1.利息收入                |          |                                 | 8,219,526.02         |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11 |                                 | 2,079,355.66         |
| 债券利息收入                |          |                                 | 5,801,769.50         |
| 资产支持证券利息收入            |          |                                 | -                    |
| 买入返售金融资产收入            |          |                                 | 338,400.86           |
| 其他利息收入                |          |                                 | -                    |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |          |                                 | 2,776,537.64         |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12 |                                 | 2,454,525.34         |
| 基金投资收益                | 6.4.7.13 |                                 | -                    |
| 债券投资收益                | 6.4.7.14 |                                 | -52,967.03           |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.15 |                                 | -                    |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.16 |                                 | -                    |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.17 |                                 | -                    |
| 股利收益                  | 6.4.7.18 |                                 | 374,979.33           |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.19 |                                 | 7,304,008.74         |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |          |                                 | -                    |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.20 |                                 | 27.87                |
| <b>减：二、费用</b>         |          |                                 | <b>2,827,317.84</b>  |
| 1. 管理人报酬              |          |                                 | 1,508,229.22         |
| 2. 托管费                |          |                                 | 377,057.30           |
| 3. 销售服务费              |          |                                 | 9.08                 |
| 4. 交易费用               | 6.4.7.21 |                                 | 203,776.78           |
| 5. 利息支出               |          |                                 | 550,053.00           |

|                            |          |                      |
|----------------------------|----------|----------------------|
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 550,053.00           |
| 6. 其他费用                    | 6.4.7.22 | 188,192.46           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>15,472,782.43</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                    |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>15,472,782.43</b> |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |               |                |
|----------------------------------------|---------------------------------------|---------------|----------------|
|                                        | 实收基金                                  | 未分配利润         | 所有者权益合计        |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 500,090,320.11                        | 373,128.38    | 500,463,448.49 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                     | 15,472,782.43 | 15,472,782.43  |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -38,365.80                            | -626.31       | -38,992.11     |
| 其中：1.基金申购款                             | -                                     | -             | -              |
| 2.基金赎回款                                | -38,365.80                            | -626.31       | -38,992.11     |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                                     | -             | -              |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 500,051,954.31                        | 15,845,284.50 | 515,897,238.81 |

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：包爱丽，主管会计工作负责人：梅雷军，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

光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2016]676 号《关于准予光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资

基金注册的批复》准予，由光大保德信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 500,090,305.82 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1291 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 10 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 500,090,320.11 份基金份额，其中认购资金利息折合 14.29 份基金份额。本基金的基金管理人为光大保德信基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司(以下简称“中国民生银行”)。

根据《光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购费、申购费、赎回费、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的称为 A 类基金份额；不收取认购费或前后端申购费，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。A 类、C 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告两类基金份额净值和两类基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、固定收益类金融工具(包括国债、金融债、公司债、证券公司短期公司债、企业债、地方政府债、次级债、中小企业私募债券、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、货币市场工具、中期票据、资产支持证券、债券回购、央行票据、银行存款等)、权证、股指期货、国债期货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相关规定)。其中货币市场工具可投资于现金、通知存款、短期融资券、一年以内(含)的银行定期存款和大额存单、剩余期限在三百九十七天以内(含三百九十七天)的债券、中期票据和资产支持证券，期限在一年以内(含)的债券回购和央行票据等金融工具。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“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，也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业

务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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<年度报告和半年度报告>》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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 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的说明

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一致。

#### 6.4.5 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、国家税务总局财税字[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 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[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，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[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。

#### 6.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[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、国家税务总局财税字[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。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目   | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 16,209,627.66          |
| 定期存款 | 100,000,000.00         |
| 其他存款 | -                      |
| 合计   | 116,209,627.66         |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日 |                |                |
|---------------|------------------------|----------------|----------------|
|               | 成本                     | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票            | 46,424,228.26          | 50,270,587.04  | 3,846,358.78   |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                      | -              | -              |
| 债券            | 交易所市场                  | -              | -              |
|               | 银行间市场                  | 502,887,505.89 | 504,168,000.00 |
|               | 合计                     | 502,887,505.89 | 504,168,000.00 |
| 资产支持证券        | -                      | -              | -              |
| 基金            | -                      | -              | -              |
| 其他            | -                      | -              | -              |
| 合计            | 549,311,734.15         | 554,438,587.04 | 5,126,852.89   |

#### 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

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日 |           |
|-------|------------------------|-----------|
|       | 账面余额                   | 其中：买断式逆回购 |
| 上交所市场 | 14,000,000.00          | -         |
| 合计    | 14,000,000.00          | -         |

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目        | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日 |
|-----------|------------------------|
| 应收活期存款利息  | 2,885.80               |
| 应收定期存款利息  | 2,370,278.72           |
| 应收其他存款利息  | -                      |
| 应收结算备付金利息 | 652.40                 |
| 应收债券利息    | 8,190,407.50           |

|            |               |
|------------|---------------|
| 应收买入返售证券利息 | -6,144.66     |
| 应收申购款利息    | -             |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -             |
| 其他         | 27.30         |
| 合计         | 10,558,107.06 |

注：其他应收利息为应收结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2017年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 89,177.84         |
| 银行间市场应付交易费用 | 7,902.62          |
| 合计          | 97,080.46         |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2017年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | -                 |
| 其他          | -                 |
| 应付银行划款手续费   | -                 |
| 应付转出费       | -                 |
| 预提审计费       | 24,795.19         |
| 预提信息披露费     | 148,765.71        |
| 合计          | 173,560.90        |

#### 6.4.7.9 实收基金

光大保德信铭鑫混合 A

金额单位：人民币元

| 项目   | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |                |
|------|----------------------------|----------------|
|      | 基金份额                       | 账面金额           |
| 上年度末 | 500,066,339.19             | 500,066,339.19 |

|               |                |                |
|---------------|----------------|----------------|
| 本期申购          | -              | -              |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -22,002.57     | -22,002.57     |
| 本期末           | 500,044,336.62 | 500,044,336.62 |

光大保德信铭鑫混合 C

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |            |
|---------------|----------------------------|------------|
|               | 基金份额                       | 账面金额       |
| 上年度末          | 23,980.92                  | 23,980.92  |
| 本期申购          | -                          | -          |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -16,363.23                 | -16,363.23 |
| 本期末           | 7,617.69                   | 7,617.69   |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

光大保德信铭鑫混合 A

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末           | 2,550,167.15  | -2,177,051.48 | 373,115.67    |
| 本期利润           | 8,168,519.07  | 7,303,757.67  | 15,472,276.74 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -269.65       | -73.63        | -343.28       |
| 其中：基金申购款       | -             | -             | -             |
| 基金赎回款          | -269.65       | -73.63        | -343.28       |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 10,718,416.57 | 5,126,632.56  | 15,845,049.13 |

光大保德信铭鑫混合 C

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分   | 未实现部分   | 未分配利润合计 |
|----------------|---------|---------|---------|
| 上年度末           | 117.08  | -104.37 | 12.71   |
| 本期利润           | 254.62  | 251.07  | 505.69  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -214.37 | -68.66  | -283.03 |
| 其中：基金申购款       | -       | -       | -       |
| 基金赎回款          | -214.37 | -68.66  | -283.03 |
| 本期已分配利润        | -       | -       | -       |
| 本期末            | 157.33  | 78.04   | 235.37  |



**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 39,629.75                  |
| 定期存款利息收入  | 2,023,681.36               |
| 其他存款利息收入  | -                          |
| 结算备付金利息收入 | 15,701.50                  |
| 其他        | 343.05                     |
| 合计        | 2,079,355.66               |

**6.4.7.12 股票投资收益**

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 64,868,570.73              |
| 减：卖出股票成本总额 | 62,414,045.39              |
| 买卖股票差价收入   | 2,454,525.34               |

**6.4.7.13 基金投资收益**

本基金本报告期无基金投资收益。

**6.4.7.14 债券投资收益****6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | -52,967.03                 |
| 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                            | -52,967.03                 |

**6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

| 项目                    | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-----------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 210,823,745.25             |

|                         |                |
|-------------------------|----------------|
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 207,854,700.00 |
| 减：应收利息总额                | 3,022,012.28   |
| 买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入   | -52,967.03     |

#### 6.4.7.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末进行资产支持证券投资。

#### 6.4.7.16 贵金属投资收益

本基金本报告期末投资贵金属。

#### 6.4.7.17 衍生工具收益

本基金本报告期末进行衍生工具投资。

#### 6.4.7.18 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 374,979.33                 |
| 基金投资产生的股利收益 | -                          |
| 合计          | 374,979.33                 |

#### 6.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产  | 7,304,008.74               |
| ——股票投资     | 5,406,514.41               |
| ——债券投资     | 1,897,494.33               |
| ——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       | -                          |
| 合计         | 7,304,008.74               |

#### 6.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 25.35                      |
| 转换费收入   | 2.52                       |
| 合计      | 27.87                      |

**6.4.7.21 交易费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 200,701.78                 |
| 银行间市场交易费用 | 3,075.00                   |
| 合计        | 203,776.78                 |

**6.4.7.22 其他费用**

单位：人民币元

| 项目     | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |
|--------|----------------------------|
| 审计费用   | 24,795.19                  |
| 信息披露费  | 148,765.71                 |
| 银行汇划费用 | 2,231.56                   |
| 帐户维护费  | 12,000.00                  |
| 其他费用   | 400.00                     |
| 合计     | 188,192.46                 |

**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**

截至资产负债表日，本基金无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影响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（简称“光大保德信”） | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国民生银行股份有限公司（简称“民生银行”）   | 基金托管人、基金销售机构        |
| 光大证券股份有限公司（简称“光大证券”）     | 基金管理人的股东、基金销售机构     |

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<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |              |
|-------|----------------------------|--------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票成交总额的比例 |
| 光大证券  | 51,863,979.92              | 38.65%       |

##### 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<br>2017年1月1日至2017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  | 47,263.78                  | 38.14%     | 35,162.27 | 39.43%       |

#### 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 |
|----|----|
|----|----|

|                 | 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-----------------|----------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,508,229.22         |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 0.00                 |

注：支付基金管理人光大保德信基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                   |
|----------------|----------------------|
|                | 2017年1月1日至2017年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 377,057.30           |

注：支付基金托管人中国民生银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

#### 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                   |             |      |
|----------------|----------------------|-------------|------|
|                | 2017年1月1日至2017年6月30日 |             |      |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费     |             |      |
|                | 光大保德信铭鑫混合 A          | 光大保德信铭鑫混合 C | 合计   |
| 光大保德信基金管理有限公司  | -                    | 9.15        | 9.15 |
| 合计             | -                    | 9.15        | 9.15 |

注：支付基金销售机构的销售服务费光大保德信铭鑫混合基金 C 级按前一日基金资产净值 0.1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给光大保德信基金公司，再由光大保德信基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{光大保德信铭鑫混合基金 C 级日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

#### 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

本基金本报告期末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 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未投资本基金。

#### 6.4.10.4.2 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未投资本基金。

#### 6.4.10.5 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<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |              |
|-------|----------------------------|--------------|
|       | 期末余额                       | 当期利息收入       |
| 民生银行  | 66,209,627.66              | 1,045,186.11 |

#### 6.4.10.6 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。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2017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 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.2.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 6.4.12.2.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 06 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 181,169,528.24 元，均于 2017 年 7 月 4 日到期。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。

#### 6.4.13 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政策和程序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，制定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。

本基金管理人风险管理部门建立了对基金进行风险评估的数量化系统，可以从各个不同的层面对基金所承受的各类风险进行密切跟踪。

#### 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于同一发行主体发行的信用类投资品种不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

本基金所持大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，均能及时变现。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资产的公允价值。

本基金管理人风险管理部门从资产配置、行业配置、个股选择等层面制定相应的流动性指标，设定相应的预警阈值，并通过风险评估系统对这些流动性指标进行持续的监测、评估，根据评估结果及时提出流动性风险管理建议。

本基金管理人通过设定对单一证券的投资比例限制，建立相应的授权审批制度，在保护基金持有人利益最大化的前提下，有效管理基金因在单一证券投资比例过高所带来的个股流动性风险。

本基金管理人通过制定流通受限证券的投资流程及风险处置预案，有效管理基金投资流通受限证券所承受的流动性风险。

本基金管理人通过分析本基金持有人结构、密切跟踪监控基金申购赎回趋势，有效预测本基金的流动性需求。同时，本基金管理人通过进行基金变现能力测试得出基金在各市场情形下的变现能力，通过情景分析及压力测试，评估基金在极端情形下面临的流动性风险。

#### 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银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金通过监控组合的久期来管理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<br>2017年6月<br>30日 | 1个月以内 | 1-3<br>个月 | 6个月以内 | 3个月<br>-1年 | 1<br>年<br>以<br>内 | 1-5年 | 5<br>年<br>以<br>上 | 不计息 | 合计 |
|-----------------------|-------|-----------|-------|------------|------------------|------|------------------|-----|----|



|                         |                 |                 |                 |                 |                  |                |                  |                |                 |
|-------------------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|------------------|----------------|------------------|----------------|-----------------|
| 资产                      |                 |                 |                 |                 |                  |                |                  |                |                 |
| 银行存款                    | 16,209,627.66   |                 | -100,000,000.00 |                 | -                | -              | -                | -              | -116,209,627.66 |
| 结算备付金                   | 1,449,749.19    |                 | -               |                 | -                | -              | -                | -              | 1,449,749.19    |
| 存出保证金                   | 60,628.83       |                 | -               |                 | -                | -              | -                | -              | 60,628.83       |
| 交易性金融资产                 |                 | -265,221,000.00 |                 | -160,339,000.00 |                  | -78,608,000.00 |                  | -50,270,587.04 | 554,438,587.04  |
| 买入返售证券                  | 14,000,000.00   |                 | -               |                 | -                | -              |                  | -              | 14,000,000.00   |
| 应收利息                    |                 |                 |                 |                 |                  |                |                  | -10,558,107.06 | 10,558,107.06   |
| 应收证券清算款                 |                 |                 |                 |                 |                  |                |                  | 974,889.04     | 974,889.04      |
| 资产总计                    | 31,720,005.68   | 265,221,000.00  | 100,000,000.00  | 160,339,000.00  |                  | -78,608,000.00 |                  | -61,803,583.14 | 697,691,588.82  |
| 负债                      |                 |                 |                 |                 |                  |                |                  |                |                 |
| 应付赎回款                   |                 |                 |                 |                 |                  |                |                  |                |                 |
| 应付管理人报酬                 |                 |                 |                 |                 |                  |                |                  | 253,014.42     | 253,014.42      |
| 应付托管费                   |                 |                 |                 |                 |                  |                |                  | 63,253.61      | 63,253.61       |
| 应付销售服务费                 |                 |                 |                 |                 |                  |                |                  | 0.60           | 0.60            |
| 应付交易费用                  |                 |                 |                 |                 |                  |                |                  | 97,080.46      | 97,080.46       |
| 应付利息                    |                 |                 |                 |                 |                  |                |                  | 37,911.78      | 37,911.78       |
| 卖出回购金融资产款               | 181,169,528.24  |                 |                 |                 |                  |                |                  |                | -181,169,528.24 |
| 其他负债                    |                 |                 |                 |                 |                  |                |                  | 173,560.90     | 173,560.90      |
| 负债总计                    | 181,169,528.24  |                 |                 |                 |                  |                |                  | 624,821.77     | 181,794,350.01  |
| 利率敏感度缺口                 | -149,449,522.56 | 265,221,000.00  | 100,000,000.00  | 160,339,000.00  |                  | -78,608,000.00 |                  | -61,178,761.37 | 515,897,238.81  |
| 上年度末<br>2016年12月<br>31日 | 1个月以内           | 1-3<br>个月       | 6个月以内           | 3个月<br>-1年      | 1<br>年<br>以<br>内 | 1-5<br>年       | 5<br>年<br>以<br>上 | 不计息            | 合计              |
| 资产                      |                 |                 |                 |                 |                  |                |                  |                |                 |
| 银行存款                    | 3,708,042.35    |                 |                 | -100,000,000.00 |                  |                |                  |                | -103,708,042.35 |
| 结算备付金                   | 4,542,024.72    |                 |                 |                 |                  |                |                  |                | 4,542,024.72    |
| 存出保证金                   | 21,048.85       |                 |                 |                 |                  |                |                  |                | 21,048.85       |

|         |               |  |  |                 |  |            |                |                |
|---------|---------------|--|--|-----------------|--|------------|----------------|----------------|
| 交易性金融资产 |               |  |  | -311,810,000.00 |  | 170,530.60 | -37,807,912.19 | 349,788,442.79 |
| 买入返售证券  | 41,000,000.00 |  |  |                 |  |            |                | 41,000,000.00  |
| 应收利息    |               |  |  |                 |  |            | 2,947,879.06   | 2,947,879.06   |
| 应收证券清算款 |               |  |  |                 |  |            |                |                |
| 资产总计    | 49,271,115.92 |  |  | -411,810,000.00 |  | 170,530.60 | -40,755,791.25 | 502,007,437.77 |
| 负债      |               |  |  |                 |  |            |                |                |
| 应付赎回款   |               |  |  |                 |  |            |                |                |
| 应付管理人报酬 |               |  |  |                 |  |            | 254,046.35     | 254,046.35     |
| 应付托管费   |               |  |  |                 |  |            | 63,511.57      | 63,511.57      |
| 应付销售服务费 |               |  |  |                 |  |            | 2.17           | 2.17           |
| 应付交易费用  |               |  |  |                 |  |            | 85,762.51      | 85,762.51      |
| 应付证券清算款 |               |  |  |                 |  |            | 996,666.68     | 996,666.68     |
| 其他负债    |               |  |  |                 |  |            | 144,000.00     | 144,000.00     |
| 负债总计    |               |  |  |                 |  |            | 1,543,989.28   | 1,543,989.28   |
| 利率敏感度缺口 | 49,271,115.92 |  |  | -411,810,000.00 |  | 170,530.60 | -39,211,801.97 | 500,463,448.49 |

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 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<br>影响金额（单位：人民币万元） |                     |
|-----------|-----------|----------------------------------|---------------------|
|           |           | 本期末<br>2017年6月30日                | 上年度末<br>2016年12月31日 |
|           |           | 基准利率上升 1%                        | 减少约 324             |
| 基准利率下降 1% | 增加约 324   | 增加约 20                           |                     |

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

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金管理人风险管理部门通过监控基金的大类资产配置比例，行业及个股集中度，行业配置相对业绩基准的偏离度，重仓行业及个股的业绩表现，研究深度等，评估并有效管理基金面临的市场价格风险。

##### 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<br>2017 年 6 月 30 日 |               | 上年度末<br>2016 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  | 50,270,587.04          | 9.74          | 37,807,912.19            | 7.55          |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                      | -             | -                        | -             |
| 交易性金融资产—债券投资  | 504,168,000.00         | 97.73         | 311,980,530.60           | 62.34         |
| 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            | 554,438,587.04         | 107.47        | 349,788,442.79           | 69.89         |

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 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：人民币万元）         |                          |
|--|-------------|------------------------|--------------------------|
|  |             | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日 |
|  | 业绩比较基准上升 1% | 增加约 78                 | 增加约 9                    |
|  | 业绩比较基准下降 1% | 减少约 78                 | 减少约 9                    |

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 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金无需要说明的其他事项。

## 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              | 50,270,587.04  | 7.21         |
|    | 其中：股票             | 50,270,587.04  | 7.21         |
| 2  | 固定收益投资            | 504,168,000.00 | 72.26        |
|    | 其中：债券             | 504,168,000.00 | 72.26        |
|    | 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          | 14,000,000.00  | 2.01         |
|    | 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      | 117,659,376.85 | 16.86        |
| 7  | 其他各项资产            | 11,593,624.93  | 1.66         |
| 8  | 合计                | 697,691,588.82 | 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         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | -             | -            |
| C  | 制造业              | 31,615,500.28 | 6.13         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -            |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | 2,468,400.00  | 0.48         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -             | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -             | -            |
| J  | 金融业              | 6,825,000.00  | 1.32         |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 9,361,686.76  | 1.81         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -             | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -             | -            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -            |
| P  | 教育               | -             | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -             | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -             | -            |
| S  | 综合               | -             | -            |
|    | 合计               | 50,270,587.04 | 9.74         |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未通过沪港通投资股票。

## 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  | 000418 | 小天鹅 A | 169,984.00  | 7,953,551.36 | 1.54         |
| 2  | 601398 | 工商银行  | 1,300,000.0 | 6,825,000.00 | 1.32         |

|    |        |      |            |              |      |
|----|--------|------|------------|--------------|------|
|    |        |      | 0          |              |      |
| 3  | 600138 | 中青旅  | 312,086.00 | 6,572,531.16 | 1.27 |
| 4  | 600332 | 白云山  | 154,100.00 | 4,475,064.00 | 0.87 |
| 5  | 600885 | 宏发股份 | 99,100.00  | 3,953,099.00 | 0.77 |
| 6  | 600519 | 贵州茅台 | 7,300.00   | 3,444,505.00 | 0.67 |
| 7  | 000811 | 烟台冰轮 | 182,133.00 | 3,178,220.85 | 0.62 |
| 8  | 601888 | 中国国旅 | 92,540.00  | 2,789,155.60 | 0.54 |
| 9  | 002271 | 东方雨虹 | 70,000.00  | 2,597,000.00 | 0.50 |
| 10 | 002372 | 伟星新材 | 134,700.00 | 2,516,196.00 | 0.49 |
| 11 | 000417 | 合肥百货 | 299,200.00 | 2,468,400.00 | 0.48 |
| 12 | 600566 | 济川药业 | 48,069.00  | 1,828,064.07 | 0.35 |
| 13 | 000858 | 五粮液  | 30,000.00  | 1,669,800.00 | 0.32 |

#### 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  | 000418 | 小天鹅 A | 14,873,899.44 | 2.97            |
| 2  | 601398 | 工商银行  | 8,996,648.00  | 1.80            |
| 3  | 600276 | 恒瑞医药  | 5,833,604.80  | 1.17            |
| 4  | 300166 | 东方国信  | 4,271,989.38  | 0.85            |
| 5  | 600885 | 宏发股份  | 3,795,846.00  | 0.76            |
| 6  | 002415 | 海康威视  | 3,259,727.12  | 0.65            |
| 7  | 601939 | 建设银行  | 3,085,000.00  | 0.62            |
| 8  | 600028 | 中国石化  | 2,930,000.00  | 0.59            |
| 9  | 600332 | 白云山   | 2,740,200.00  | 0.55            |
| 10 | 000417 | 合肥百货  | 2,719,901.00  | 0.54            |
| 11 | 600566 | 济川药业  | 2,548,724.00  | 0.51            |
| 12 | 601888 | 中国国旅  | 2,440,018.10  | 0.49            |
| 13 | 600138 | 中青旅   | 2,250,676.58  | 0.45            |
| 14 | 000858 | 五粮液   | 2,157,071.09  | 0.43            |
| 15 | 002372 | 伟星新材  | 2,143,112.00  | 0.43            |
| 16 | 002271 | 东方雨虹  | 2,021,363.00  | 0.40            |
| 17 | 600519 | 贵州茅台  | 1,711,334.98  | 0.34            |
| 18 | 600547 | 山东黄金  | 1,538,644.00  | 0.31            |
| 19 | 603626 | 科森科技  | 47,049.60     | 0.01            |
| 20 | 603639 | 海利尔   | 30,089.70     | 0.01            |

##### 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  | 600566 | 济川药业  | 9,828,282.94 | 1.96            |
| 2  | 000418 | 小天鹅 A | 7,607,558.00 | 1.52            |
| 3  | 600885 | 宏发股份  | 6,522,588.49 | 1.30            |
| 4  | 600276 | 恒瑞医药  | 6,001,611.00 | 1.20            |
| 5  | 600741 | 华域汽车  | 5,239,850.36 | 1.05            |
| 6  | 002701 | 奥瑞金   | 4,298,335.00 | 0.86            |
| 7  | 600332 | 白云山   | 4,162,433.00 | 0.83            |
| 8  | 300166 | 东方国信  | 4,011,726.00 | 0.80            |
| 9  | 002415 | 海康威视  | 3,291,158.64 | 0.66            |
| 10 | 601939 | 建设银行  | 3,061,190.00 | 0.61            |
| 11 | 600028 | 中国石化  | 2,934,000.00 | 0.59            |
| 12 | 601398 | 工商银行  | 2,365,000.00 | 0.47            |
| 13 | 600519 | 贵州茅台  | 1,255,500.00 | 0.25            |
| 14 | 600547 | 山东黄金  | 1,135,487.08 | 0.23            |
| 15 | 000858 | 五粮液   | 914,219.00   | 0.18            |
| 16 | 603111 | 康尼机电  | 818,800.00   | 0.16            |
| 17 | 000811 | 烟台冰轮  | 281,405.25   | 0.06            |
| 18 | 601375 | 中原证券  | 213,560.00   | 0.04            |
| 19 | 603877 | 太平鸟   | 127,402.80   | 0.03            |
| 20 | 603626 | 科森科技  | 110,323.20   | 0.02            |

### 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 | 69,470,205.83 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 64,868,570.73 |

### 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      | -             | -             |
| 2  | 央行票据      | -             | -             |
| 3  | 金融债券      | 89,595,000.00 | 17.37         |
|    | 其中：政策性金融债 | 89,595,000.00 | 17.37         |
| 4  | 企业债券      | -             | -             |

|    |           |                |       |
|----|-----------|----------------|-------|
| 5  | 企业短期融资券   | 190,480,000.00 | 36.92 |
| 6  | 中期票据      | 59,180,000.00  | 11.47 |
| 7  | 可转债（可交换债） | -              | -     |
| 8  | 同业存单      | 164,913,000.00 | 31.97 |
| 9  | 其他        | -              | -     |
| 10 | 合计        | 504,168,000.00 | 97.73 |

### 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  | 111697479 | 16 贵阳银行 CD038   | 1,000,000 | 96,680,000.00 | 18.74        |
| 2  | 170205    | 17 国开 05        | 600,000   | 59,724,000.00 | 11.58        |
| 3  | 111695527 | 16 福建海峡银行 CD028 | 500,000   | 48,455,000.00 | 9.39         |
| 4  | 041759014 | 17 义乌国资 CP001   | 300,000   | 30,000,000.00 | 5.82         |
| 5  | 170204    | 17 国开 04        | 300,000   | 29,871,000.00 | 5.79         |

### 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策



本基金本报告期末未投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

## 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 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。

## 7.12 投资组合报告附注

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

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

### 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   | 60,628.83     |
| 2  | 应收证券清算款 | 974,889.04    |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 10,558,107.06 |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |

|   |    |               |
|---|----|---------------|
| 9 | 合计 | 11,593,624.93 |
|---|----|---------------|

#### 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有处于转股期的可转债。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 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  |
| 光大保德信铭鑫混合 A | 67        | 7,463,348.31 | 499,999,000.00 | 99.99% | 45,336.62 | 0.01%   |
| 光大保德信铭鑫混合 C | 273       | 27.90        | -              | -      | 7,617.69  | 100.00% |
| 合计          | 340       | 1,470,741.04 | 499,999,000.00 | 99.99% | 52,954.31 | 0.01%   |

#### 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 | 光大保德信铭鑫混合 A | 241.74     | 0.00%    |
|                  | 光大保德信铭鑫混合 C | 4,934.85   | 64.78%   |
|                  | 合计          | 5,176.59   | 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 | 光大保德信铭鑫混合 A | 0    |
|                                | 光大保德信铭鑫混合 C | 0~10 |
|                                | 合计          | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 光大保德信铭鑫混合 A | 0    |
|                                | 光大保德信铭鑫混合 C | 0    |
|                                | 合计          | 0    |

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                              | 光大保德信铭鑫混合 A    | 光大保德信铭鑫混合 C |
|---------------------------------|----------------|-------------|
| 基金合同生效日(2016 年 10 月 17 日)基金份额总额 | 500,066,339.19 | 23,980.92   |
| 本报告期期初基金份额总额                    | 500,066,339.19 | 23,980.92   |
| 本报告期基金总申购份额                     | -              | -           |
| 减：本报告期基金总赎回份额                   | 22,002.57      | 16,363.23   |
| 本报告期基金拆分变动份额                    | -              | -           |
| 本报告期期末基金份额总额                    | 500,044,336.62 | 7,617.69    |

## 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

经公司九届十一次董事会会议审议通过，自 2017 年 8 月 1 日起，董文卓先生正式担任公司副总经理一职。

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 报告期内改聘会计师事务所情况

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。

### 10.6 管理人、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，本基金的基金管理人和基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未有受监管

部门稽查或处罚的情形发生。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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 | 1      | 51,863,979.92 | 38.65%       | 47,263.78 | 38.14%     | -  |
| 东方证券 | 1      | 82,322,350.30 | 61.35%       | 76,666.84 | 61.86%     | -  |

注：（1）报告期内租用证券公司交易单元变更情况

报告期内未新增和停止租用交易单元。

（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，并报本管

理人董事会批准。

经董事会批准后，由本管理人交易部门、运营部门配合完成专用交易单元的具体租用事宜。

### 10.7.2 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 | -          | -            | -                | -            | -    | -            |
| 东方证券 | 236,803.88 | 100.00%      | 2,048,500,000.00 | 100.00%      | -    | -            |

### 10.8 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 2016 年 12 月 31 日资产净值公告                                         | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2017-01-03 |
| 2  | 光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告                                              | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2017-01-23 |
| 3  | 光大保德信基金管理有限公司关于对通过网上直销平台（包括移动终端平台）进行光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金的申购、定期定额投资和基金转换实行费率优惠的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2017-02-18 |
| 4  | 光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告                                     | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2017-02-18 |
| 5  | 光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告                                                  | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2017-03-28 |
| 6  | 光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告摘要                                                | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2017-03-28 |
| 7  | 光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告                                              | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2017-04-21 |
| 8  | 光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）                                                    | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2017-05-31 |
| 9  | 光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基                                                              | 《中国证券报》、《上海证           | 2017-05-31 |

|              |            |
|--------------|------------|
| 金招募说明书（更新）摘要 | 券报》、《证券时报》 |
|--------------|------------|

## 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              | 20170101-20170630      | 499,999,000.00 | -    | -    | 499,999,000.00 | 99.99% |
| 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

无

## 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铭鑫灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- 2、光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 3、光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- 4、光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 5、光大保德信铭鑫灵活配置混合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铭鑫灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

## 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 层至 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：4008-202-888，021-80262888。公司网址：[www.epf.com.cn](http://www.epf.com.cn)。

光大保德信基金管理有限公司

二〇一七年八月二十六日