

光大保德信信用添益债券型证券投资基金
2020 年中期报告
2020 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：二〇二〇年八月三十一日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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.....	14
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.....	14
6 中期财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
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.....	41
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.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	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.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12 投资组合报告附注.....	48
8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
9 开放式基金份额变动	51
10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	52
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	52
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.9 其他重大事件	53
11 影响投资者决策的其他重要信息	54
12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	光大保德信信用添益债券型证券投资基金	
基金简称	光大保德信信用添益债券	
基金主代码	360013	
交易代码	360013	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年5月16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	439,062,216.73 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	光大保德信信用添益债券 A 类	光大保德信信用添益债券 C 类
下属分级基金的交易代码	360013	360014
报告期末下属分级基金的份额总额	294,629,160.51 份	144,433,056.22 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在充分控制风险和保持资产流动性的基础上，通过严格的信用分析和利差变动趋势分析，在获取当期收益的同时，力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在充分考虑债券市场运行状况和特征的基础上，将投资策略分解为资产配置策略、债券市场投资策略、股票市场投资策略和套利投资策略。结合国内债券市场的基本结构和流动性分析，本基金将债券市场投资策略主要分为利率策略、信用策略、可转债策略和杠杆策略。本基金将充分结合宏观经济和证券市场的形势，运用丰富的投资策略，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中证全债指数。
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。

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 负责人	姓名	毛宗倩	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	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), 6-7层、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	高迎欣

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.epf.com.cn
基金中期报告备置地点	光大保德信基金管理有限公司、中国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), 6-7 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 (2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日)	
	光大保德信信用添益债券 A 类	光大保德信信用添益债券 C 类
本期已实现收益	11,398,856.71	7,036,031.58
本期利润	12,020,289.20	5,874,300.17
加权平均基金份额本期利润	0.1146	0.0844
本期加权平均净值利润率	10.09%	7.45%
本期基金份额净值增长率	12.27%	12.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
	光大保德信信用添益债券 A 类	光大保德信信用添益债券 C 类
期末可供分配利润	31,094,540.43	14,892,702.60

期末可供分配基金份额利润	0.1055	0.1031
期末基金资产净值	338,858,035.31	165,742,823.63
期末基金份额净值	1.150	1.148
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)	
	光大保德信信用添益债券 A 类	光大保德信信用添益债券 C 类
基金份额累计净值增长率	78.58%	73.42%

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

光大保德信信用添益债券 A 类

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	3.60%	0.59%	-0.87%	0.13%	4.47%	0.46%
过去三个月	6.03%	0.70%	-0.39%	0.13%	6.42%	0.57%
过去六个月	12.27%	1.12%	2.52%	0.12%	9.75%	1.00%
过去一年	21.83%	0.84%	5.42%	0.09%	16.41%	0.75%
过去三年	28.30%	0.50%	16.96%	0.07%	11.34%	0.43%
自基金合同生效起至今	78.58%	0.35%	38.10%	0.08%	40.48%	0.27%

光大保德信信用添益债券 C 类

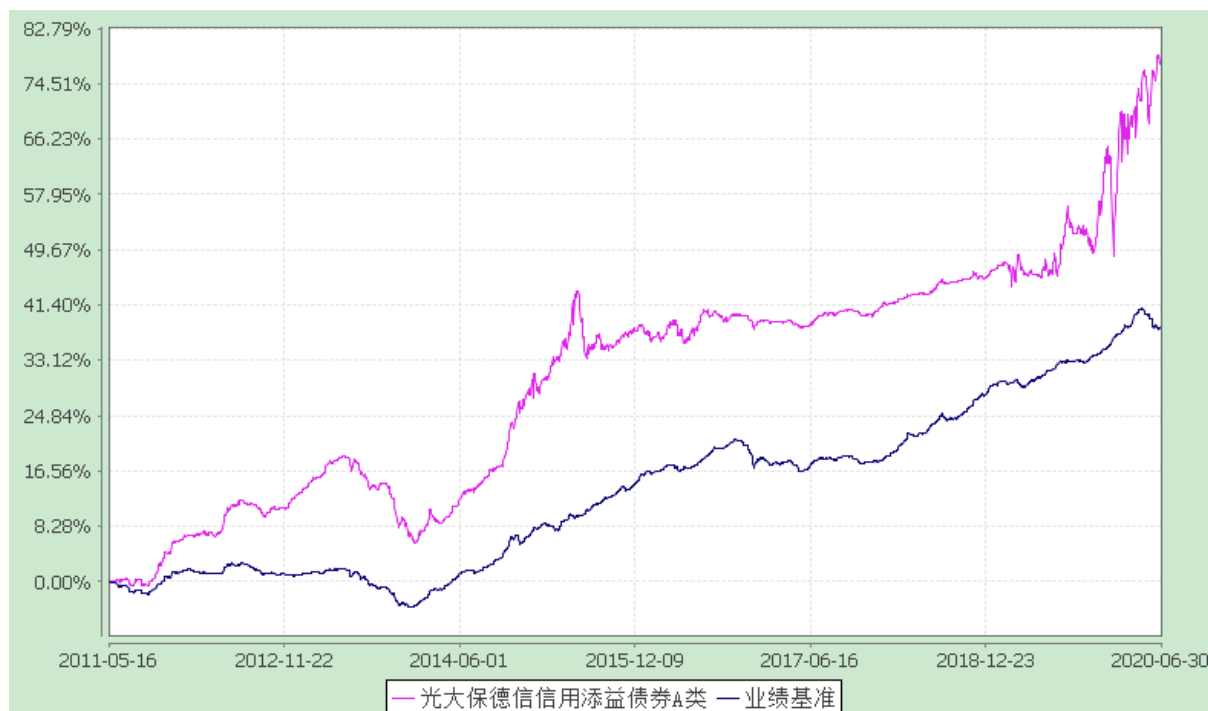
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.61%	0.57%	-0.87%	0.13%	4.48%	0.44%
过去三个月	6.05%	0.70%	-0.39%	0.13%	6.44%	0.57%
过去六个月	12.10%	1.13%	2.52%	0.12%	9.58%	1.01%
过去一年	21.44%	0.84%	5.42%	0.09%	16.02%	0.75%
过去三年	26.80%	0.50%	16.96%	0.07%	9.84%	0.43%
自基金合同生效起至今	73.42%	0.35%	38.10%	0.08%	35.32%	0.27%

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

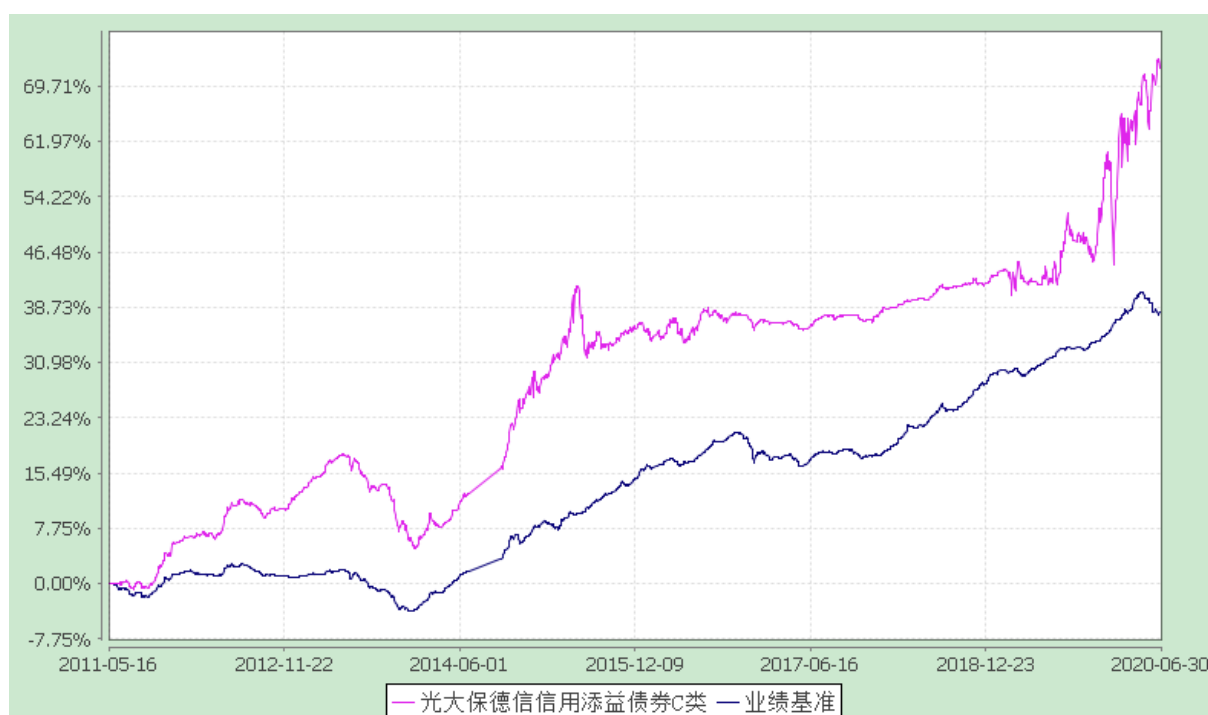
较

光大保德信信用添益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
 (2011年5月16日至2020年6月30日)

光大保德信信用添益债券 A 类



光大保德信信用添益债券 C 类



注：1、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，
 第 8 页共 56 页

经与基金托管人中国民生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“中债综合指数”变更为“中证全债指数”。

2、根据基金合同的规定，本基金建仓期为 2011 年 5 月 16 日至 2011 年 11 月 15 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 2020 年 6 月 30 日，光大保德信旗下管理着 52 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、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、光大保德信尊富 18 个月定期开放债券型证券投资基金、光大保德信多策略优选一年定期开放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、光大保德信裕鑫混合型证券投资基金、光大保德信瑞和混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄波	基金经理	2019-10-09	-	7 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；2019 年 6 月加入光大保德信基金管理有限公司，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、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的基金经理，2019 年 11 月至今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 月至今担任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的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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。

4.1.3 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

注：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

宏观方面，主要是受到疫情冲击又逐步恢复的过程。一季度受到疫情冲击明显，GDP 下行到多年低点-6.8%，生产端和需求端同时陷入停滞。二季度以来，在央行宽松的货币政策以及财政部积极的财政政策的支持下，经济有比较明显的好转，二季度已经上行至 3.2%。从具体的情况来看，二季度先是生产端有比较明显的修复，工业增加值显著上行，至 5 月之后，需求端的修复加快，地产和基建增速快速上行，体现出逆周期政策的发力，消费恢复的节奏相对偏慢。整个上半年，信用扩张的节奏快于经济增长，社会融资规模大幅扩张，对实体经济的恢复有所提振。

市场方面，利率随着经济的变化先下后上。疫情的冲击带来货币政策的显著放松，央行降息降准，使得利率在 4 月底达到上半年低点。之后随着经济逐步恢复，货币政策从超常规宽松中退出，利率随之上行，目前利率整体水平与年初水平较为接近。

基金在上半年积极参与权益市场、可转债市场投资。组合选取优质可转债和较低估值的权益资产配置：转债选择方面，兼顾转股溢价率、转债对于上市公司股票估值、转债价格等因素，选择高性价比转债配置；股票方面，坚持低估值、稳健成长的行业龙头配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内光大保德信信用添益债券 A 份额净值增长率为 12.27%，业绩比较基准收益率为 2.52%；光大保德信信用添益债券 C 份额净值增长率为 12.10%，业绩比较基准收益率为 2.52%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观方面，基本面因子将变强，欧美将在疫情中实现明显的经济反弹，国内预计下半年基建和出口比较强，地产和消费继续有所改善，预计下半年的 GDP 增速将逐步抬升。通胀方面，CPI 继续回落，PPI 筑底上行，PPI 带动盈利增速的过程值得关注。货币政策目前已经基本实现退出，回归中性，我们预计下半年货币政策将在中性水平保持稳定。我们认为下半年财政扩张的空间较大，专项债、特别国债和今年增加的赤字都将在下半年落地，继续驱动经济改善。

市场层面，下半年经济上行，货币政策退出，在债券投资方面要继续保持谨慎。短期市场调整较快，有一定的交易性机会。整体而言，是经济改善驱动利率偏上行的过程。由于货币政策受制于疫情和就业两个问题，不太可能出现货币收紧的情况，所以利率上行的空间也是有限的。

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验，并具有广泛的代表性。

委员会对各相关部门和代表人员的分工如下：投资研究部和运营部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；运营部根据估值的专业技术对需要进行估值政策调整的品种提出初步意见提交估值委员会讨论，负责执行基金估值政策进行日常估值业务，负责与托管行、审计师、基金同业、监管机关沟通估值调整事项；监察稽核部就估值程序的合法合规发表意见；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，2020 年 1 月 14 日本基金 A 类每 10 份派发红利 0.23 元，C 类每 10 份派发红利 0.22 元；2020 年 5 月 6 日本基金 A 类每 10 份派发红利 0.73 元，C 类每 10 份派发红利 0.72 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

本基金本报告期内出现了连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况，该情况自 2018 年 7 月 26 日起出现，于 2020 年 2 月 20 日终止。本基金本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。

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合规守信、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、基金费用开支及利润分配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。

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 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：光大保德信信用添益债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	6,417,252.20	920,910.69
结算备付金		4,204,700.07	134,522.03
存出保证金		73,335.98	13,537.78
交易性金融资产	6.4.7.2	527,616,150.82	21,612,222.67
其中：股票投资		96,297,417.96	3,710,764.00
基金投资		-	-
债券投资		431,318,732.86	17,901,458.67
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	-	-
应收证券清算款		7,212,368.01	185,433.27
应收利息	6.4.7.5	1,028,669.70	94,434.09
应收股利		-	-
应收申购款		8,450,643.35	178,149.94
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		555,003,120.13	23,139,210.47
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
负债:		-	-
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		42,000,000.00	2,300,000.00
应付证券清算款		3,725,880.20	835,604.49
应付赎回款		4,065,680.11	56,482.14
应付管理人报酬		273,232.81	11,177.44
应付托管费		78,066.50	3,193.55
应付销售服务费		43,950.71	2,514.74
应付交易费用	6.4.7.7	153,720.68	9,739.44
应交税费		7,169.80	685.40
应付利息		-	-248.94
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	54,560.38	89,013.89
负债合计		50,402,261.19	3,308,162.15
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.7.9	439,062,216.73	17,837,151.24
未分配利润	6.4.7.10	65,538,642.21	1,993,897.08
所有者权益合计		504,600,858.94	19,831,048.32
负债和所有者权益总计		555,003,120.13	23,139,210.47

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额总额 439,062,216.73 份，其中 A 类基金份额净值 1.150 元，份额总额 294,629,160.51 份；C 类基金份额净值 1.148 元，份额总额 144,433,056.22 份。

6.2 利润表

会计主体：光大保德信信用添益债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020年1月1日至 2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至 2019年6月30日
一、收入		19,393,757.85	230,385.80
1.利息收入		869,208.93	314,265.43
其中：存款利息收入	6.4.7.11	48,223.31	9,938.90
债券利息收入		820,985.62	304,122.98
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		-	203.55
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		18,868,768.81	-196,459.70
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,369,413.70	-19,286.50
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	13,986,815.68	-182,713.99
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	512,539.43	5,540.79
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-540,298.92	106,799.14
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	196,079.03	5,780.93
减：二、费用		1,499,168.48	216,403.89
1. 管理人报酬		681,050.08	67,258.26
2. 托管费		194,585.77	19,216.67
3. 销售服务费		115,931.07	13,816.10
4. 交易费用	6.4.7.21	292,047.50	39,688.11
5. 利息支出		172,820.46	31,093.31
其中：卖出回购金融资产支出		172,820.46	31,093.31
6.税金及附加		2,053.60	595.62
7. 其他费用	6.4.7.22	40,680.00	44,735.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		17,894,589.37	13,981.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		17,894,589.37	13,981.91

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：光大保德信信用添益债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	17,837,151.24	1,993,897.08	19,831,048.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	17,894,589.37	17,894,589.37
三、本期基金份额交易产	421,225,065.49	63,231,525.26	484,456,590.75

生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	701,029,611.51	98,526,783.06	799,556,394.57
2.基金赎回款	-279,804,546.02	-35,295,257.80	-315,099,803.82
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）	-	-17,581,369.50	-17,581,369.50
五、期末所有者权益（基金净值）	439,062,216.73	65,538,642.21	504,600,858.94
项目	上年度可比期间		
	2019年1月1日至2019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）	17,306,396.35	863,385.54	18,169,781.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,981.91	13,981.91
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）	30,670.67	88,071.32	118,741.99
其中：1.基金申购款	8,481,508.51	440,560.61	8,922,069.12
2.基金赎回款	-8,450,837.84	-352,489.29	-8,803,327.13
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）	-	-254,555.80	-254,555.80
五、期末所有者权益（基金净值）	17,337,067.02	710,882.97	18,047,949.99

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：林昌，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

光大保德信信用添益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[2011]465号文《关于核准光大保德信信用添益债券型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人光大保德信基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2011年5月16日正式生效，首次设立募集规模为2,627,358,006.58份基金份额。本基金为契

约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为光大保德信基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

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 A 类和 C 类基金份额。对于 A 类基金份额，投资者申购时需缴纳申购费，赎回基金份额时缴纳赎回费；对于 C 类基金份额，投资者申购时无需缴纳申购费，赎回基金份额时缴纳赎回费。赎回时份额持有不满 30 天的，收取赎回费，持有满 30 天以上（含 30 天）的，不收取赎回费。

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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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）。本基金为债券型基金，可投资的固定收益类品种主要包括公司债券、企业债券、可转换债券、短期融资券、金融债、资产支持证券、国债、央行票据等。本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，其中对金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转债、分离交易可转债、资产支持证券等非国家信用债券的投资比例不低于固定收益类资产的 80%。本基金投资于股票、权证等非固定收益类证券的比例为基金资产的 0%-20%。现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金可以直接从二级市场购入股票或权证、参与一级市场股票首次发行或增发新股，并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票派发以及因投资可分离债券而产生的权证等。如果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，可以将其纳入本基金的投资范围。

本基金的业绩比较基准为：中证全债指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1、印花税

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

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

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

6.4.6.2、 增值税

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

以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本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。对本基金在 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，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.6.3、城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

6.4.6.4、企业所得税

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

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

暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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

6.4.6.5、 个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

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

6.4.7重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	6,417,252.20
定期存款	-
存款期限 1 个月内	-
存款期限 3 个月-1 年	-
其他存款	-
合计	6,417,252.20

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	89,752,616.45	96,297,417.96	6,544,801.51
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	413,097,975.50	406,673,932.86
	银行间市场	24,781,174.58	24,644,800.00
	合计	437,879,150.08	431,318,732.86
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	527,631,766.53	527,616,150.82	-15,615.71

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

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	5,045.93
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,892.20
应收债券利息	1,021,698.57
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-

应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	33.00
合计	1,028,669.70

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 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	153,078.55
银行间市场应付交易费用	642.13
合计	153,720.68

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	628.34
应付证券出借违约金	-
其他	-
预提费用	53,932.04
合计	54,560.38

6.4.7.9 实收基金

光大保德信信用添益债券 A 类

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	8,444,083.21	8,444,083.21
本期申购	416,583,836.07	416,583,836.07
本期赎回（以“-”号填列）	-130,398,758.77	-130,398,758.77
本期末	294,629,160.51	294,629,160.51

光大保德信信用添益债券 C 类

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	9,393,068.03	9,393,068.03
本期申购	284,445,775.44	284,445,775.44
本期赎回（以“-”号填列）	-149,405,787.25	-149,405,787.25
本期末	144,433,056.22	144,433,056.22

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

光大保德信信用添益债券 A 类

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	373,722.30	579,745.75	953,468.05
本期利润	11,398,856.71	621,432.49	12,020,289.20
本期基金份额交易产生的变动数	29,848,994.50	11,933,156.13	41,782,150.63
其中：基金申购款	42,492,001.46	15,890,476.48	58,382,477.94
基金赎回款	-12,643,006.96	-3,957,320.35	-16,600,327.31
本期已分配利润	-10,527,033.08	-	-10,527,033.08
本期末	31,094,540.43	13,134,334.37	44,228,874.80

光大保德信信用添益债券 C 类

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	396,594.43	643,834.60	1,040,429.03
本期利润	7,036,031.58	-1,161,731.41	5,874,300.17
本期基金份额交易产生的变动数	14,514,413.01	6,934,961.62	21,449,374.63
其中：基金申购款	28,500,366.76	11,643,938.36	40,144,305.12
基金赎回款	-13,985,953.75	-4,708,976.74	-18,694,930.49
本期已分配利润	-7,054,336.42	-	-7,054,336.42
本期末	14,892,702.60	6,417,064.81	21,309,767.41

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	36,547.33
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	11,415.88
其他	260.10
合计	48,223.31

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	62,046,288.00
减：卖出股票成本总额	57,676,874.30
买卖股票差价收入	4,369,413.70

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 2020年1月1日至2020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	13,986,815.68
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	13,986,815.68

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 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	353,537,008.58
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑	337,735,612.75

付) 成本总额	
减: 应收利息总额	1,814,580.15
买卖债券(、债转股及债券到期兑付) 差价收入	13,986,815.68

6.4.7.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16 贵金属投资收益

本基金本报告期末进行贵金属投资。

6.4.7.17 衍生工具收益

6.4.7.17.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.17.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.18 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	512,539.43
其中: 证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	512,539.43

6.4.7.19 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1.交易性金融资产	-540,298.92
——股票投资	6,577,207.28
——债券投资	-7,117,506.20
——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	-540,298.92

6.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	194,957.66
基金转换费收入	1,121.37
合计	196,079.03

6.4.7.21 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	291,532.50
银行间市场交易费用	515.00
合计	292,047.50

6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	14,918.54
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行间汇划费用	7,161.46
帐户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	40,680.00

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（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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
光大证券	123,962,856.01	60.61%	9,859,513.58	39.09%

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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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

		额的比例		额的比例
光大证券	592,009,125.05	55.19%	51,543,684.03	33.12%

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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	87,000,000.00	5.56%	23,280,000.00	19.88%

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 2020年1月1日至2020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	112,967.27	60.09%	94,677.24	61.85%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	8,985.09	38.58%	8,452.24	41.26%

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	681,050.08	67,258.26
其中：支付销售机构的客户维护费	219,375.09	23,632.25

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.70% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% / \text{当年天数}$$

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。由基金管理人于次月首日起 5 个工作日内向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	194,585.77	19,216.67

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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。由基金管理人于次月首日起 5 个工作日内向基金托管人并发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

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		
	2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	光大保德信信用添益债券 A 类	光大保德信信用添益债券 C 类	合计
光大保德信	-	7,689.59	7,689.59
中国民生银行	-	9,014.54	9,014.54
光大证券	-	102.38	102.38
合计	-	16,806.51	16,806.51
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2019年1月1日至2019年6月30日		

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	光大保德信信用添益债券A类	光大保德信信用添益债券C类	合计
光大保德信	-	183.24	183.24
中国民生银行	-	6,132.07	6,132.07
光大证券	-	14.84	14.84
合计	-	6,330.15	6,330.15

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0.30%。本基金C类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

$$H=E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人于次月首日起5个工作日内向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于5个工作日内从基金资产中一次性支付给注册登记机构，由注册登记机构支付给基金销售机构。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 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

本报告期内和上年度可比期间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及上年度末均未投资本基金。

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		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年6月30日		2019年1月1日至2019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
民生银行	6,417,252.20	36,547.33	1,444,581.68	8,463.56

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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 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。

6.4.11 利润分配情况

光大保德信信用添益债券 A 类

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	2020-01-14	2020-01-14	2020-01-14	0.230	147,100.57	81,871.68	228,972.25	-
2	2020-05-06	2020-05-06	2020-05-06	0.730	7,146,341.16	3,151,719.67	10,298,060.83	-
合计				0.960	7,293,441.73	3,233,591.35	10,527,033.08	-

光大保德信信用添益债券 C 类

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	2020-01-14	2020-01-14	2020-01-14	0.220	214,305.35	84,723.02	299,028.37	-
2	2020-05-06	2020-05-06	2020-05-06	0.720	5,674,490.22	1,080,817.83	6,755,308.05	-

合计			0.940	5,888,795.57	1,165,540.85	7,054,336.42	-
----	--	--	-------	--------------	--------------	--------------	---

6.4.12 期末（2020 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

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未有银行间市场债券正回购，因此无正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本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 4,200,000.00 元，于 2020 年 7 月 7 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，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 2020年6月30日	上年末 2019年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	21,942,000.00	-
合计	21,942,000.00	-

注：未评级债券包括国债,政策性金融债。

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 2020年6月30日	上年末 2019年12月31日
AAA	96,387,823.48	3,384,964.30
AAA 以下	307,964,409.38	13,299,476.37
未评级	5,024,500.00	1,217,018.00
合计	409,376,732.86	17,901,458.67

注：未评级债券包括政策性金融债。

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 2020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							
银行存款	6,417,252.20	-	-	-	-	-	6,417,252.20
结算备付金	4,204,700.07	-	-	-	-	-	4,204,700.07
存出保证金	73,335.98	-	-	-	-	-	73,335.98
交易性金融资产	-	10,525,109.50	353,737,296.96	67,056,326.40	-	96,297,417.96	527,616,150.82
应收证券清算款	-	-	-	-	-	7,212,368.01	7,212,368.01
应收利息	-	-	-	-	-	1,028,669.70	1,028,669.70
应收申购款	-	-	-	-	-	8,450,643.35	8,450,643.35
资产总计	10,695,288.25	10,525,109.50	353,737,296.96	67,056,326.40	-	112,989,099.02	555,003,120.13
负债							
卖出回购金融资产	42,000,000.00	-	-	-	-	-	42,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	3,725,880.20	3,725,880.20
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,065,680.11	4,065,680.11
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	273,232.81	273,232.81
应付托管费	-	-	-	-	-	78,066.50	78,066.50
应付交易费用	-	-	-	-	-	153,720.68	153,720.68
其他负债	-	-	-	-	-	54,560.38	54,560.38

应交税费	-	-	-	-	-	7,169.80	7,169.80
应付销售服务费	-	-	-	-	-	43,950.71	43,950.71
负债总计	42,000,000.00	-	-	-	-	8,402,261.19	50,402,261.19
利率敏感度缺口	-31,304,711.75	10,525,109.50	353,737,296.96	67,056,326.40	-	104,586,837.83	504,600,858.94
上年度末 2019 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							
银行存款	920,910.69	-	-	-	-	-	920,910.69
结算备付金	134,522.03	-	-	-	-	-	134,522.03
存出保证金	13,537.78	-	-	-	-	-	13,537.78
交易性金融资产	638,668.80	3,094,233.40	10,753,986.47	3,414,570.00	-	3,710,764.00	21,612,222.67
应收证券清算款	-	-	-	-	-	185,433.27	185,433.27
应收利息	-	-	-	-	-	94,434.09	94,434.09
应收申购款	-	-	-	-	-	178,149.94	178,149.94
资产总计	1,707,639.30	3,094,233.40	10,753,986.47	3,414,570.00	-	4,168,781.30	23,139,210.47
负债							
卖出回购金融资产	2,300,000.00	-	-	-	-	-	2,300,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	835,604.49	835,604.49
应付赎回款	-	-	-	-	-	56,482.14	56,482.14
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	11,177.44	11,177.44
应付托管费	-	-	-	-	-	3,193.55	3,193.55
应付交易费用	-	-	-	-	-	9,739.44	9,739.44
其他负债	-	-	-	-	-	89,013.89	89,013.89
应交税费	-	-	-	-	-	685.40	685.40
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,514.74	2,514.74
应付利息	-	-	-	-	-	-248.94	-248.94

负债总计	2,300,000.0 0	-	-	-	-	1,008,162.1 5	3,308,162.1 5
利率敏感度缺口	-592,360.70	3,094,233.4 0	10,753,986. 47	3,414,570.0 0	-	3,160,619.1 5	19,831,048. 32

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 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
		基准利率上升 1%	减少约 497,004.20
基准利率下降 1%	增加约 497,004.20	增加约 36,823.34	

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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。

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

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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	96,297,417.9 6	19.08	3,710,764.00	18.71
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	387,366,632. 86	76.77	14,030,370.67	70.75
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	483,664,050. 82	95.85	17,741,134.67	89.46

注：债券投资包含可转换债券、可交换债券。

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：人民币元）	
		本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 1%	增加约 3,223,943.45	减少约 74,070.75
	业绩比较基准下降 1%	减少约 3,223,943.45	增加约 74,070.75

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	96,297,417.96	17.35
	其中：股票	96,297,417.96	17.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	431,318,732.86	77.71
	其中：债券	431,318,732.86	77.71
	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	10,621,952.27	1.91
8	其他各项资产	16,765,017.04	3.02
9	合计	555,003,120.13	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	1,308,000.00	0.26
B	采矿业	4,033,000.00	0.80
C	制造业	63,302,764.96	12.55
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	3,885,000.00	0.77
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,001,360.00	0.59
J	金融业	14,653,761.00	2.90

K	房地产业	2,875,400.00	0.57
L	租赁和商务服务业	-	-
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	3,238,132.00	0.64
S	综合	-	-
	合计	96,297,417.96	19.08

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	601066	中信建投	130,000	5,119,400.00	1.01
2	002460	赣锋锂业	90,600	4,853,442.00	0.96
3	603960	克来机电	155,820	4,350,494.40	0.86
4	601318	中国平安	60,000	4,284,000.00	0.85
5	603690	至纯科技	100,000	4,138,000.00	0.82
6	600754	锦江酒店	140,000	3,885,000.00	0.77
7	300450	先导智能	80,000	3,696,800.00	0.73
8	300618	寒锐钴业	51,800	3,212,636.00	0.64
9	002008	大族激光	80,000	2,876,000.00	0.57
10	000002	万科 A	110,000	2,875,400.00	0.57
11	002078	太阳纸业	300,000	2,856,000.00	0.57
12	300118	东方日升	172,500	2,587,500.00	0.51
13	300233	金城医药	80,000	2,460,000.00	0.49
14	002353	杰瑞股份	75,000	2,325,000.00	0.46
15	603993	洛阳钼业	600,000	2,202,000.00	0.44
16	000725	京东方 A	450,000	2,101,500.00	0.42
17	002548	金新农	260,000	2,051,400.00	0.41
18	601966	玲珑轮胎	100,000	2,020,000.00	0.40
19	000338	潍柴动力	140,500	1,927,660.00	0.38
20	300207	欣旺达	100,000	1,890,000.00	0.37

21	600547	山东黄金	50,000	1,831,000.00	0.36
22	300168	万达信息	80,000	1,765,600.00	0.35
23	002241	歌尔股份	60,000	1,761,600.00	0.35
24	600567	山鹰纸业	593,300	1,750,235.00	0.35
25	000651	格力电器	30,000	1,697,100.00	0.34
26	600373	中文传媒	139,400	1,642,132.00	0.33
27	300182	捷成股份	400,000	1,596,000.00	0.32
28	600690	海尔智家	90,000	1,593,000.00	0.32
29	002142	宁波银行	60,000	1,576,200.00	0.31
30	002562	兄弟科技	300,000	1,575,000.00	0.31
31	600183	生益科技	50,000	1,463,500.00	0.29
32	600216	浙江医药	70,000	1,348,200.00	0.27
33	300498	温氏股份	60,000	1,308,000.00	0.26
34	000001	平安银行	101,400	1,297,920.00	0.26
35	000100	TCL 科技	200,000	1,240,000.00	0.25
36	300454	深信服	6,000	1,235,760.00	0.24
37	601009	南京银行	167,700	1,229,241.00	0.24
38	601881	中国银河	100,000	1,147,000.00	0.23
39	600114	东睦股份	109,000	1,131,420.00	0.22
40	000887	中鼎股份	140,000	1,099,000.00	0.22
41	300568	星源材质	53,688	999,670.56	0.20
42	000630	铜陵有色	500,000	965,000.00	0.19
43	300832	新产业	3,700	637,103.00	0.13
44	000860	顺鑫农业	10,000	569,800.00	0.11
45	603026	石大胜华	20,000	533,800.00	0.11
46	600273	嘉化能源	53,100	464,094.00	0.09
47	300393	中来股份	50,000	334,000.00	0.07
48	002422	科伦药业	15,000	315,000.00	0.06
49	002340	格林美	49,000	243,530.00	0.05
50	600887	伊利股份	4,000	124,520.00	0.02
51	600276	恒瑞医药	1,200	110,760.00	0.02

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	601066	中信建投	6,431,025.62	32.43
2	002460	赣锋锂业	5,426,552.00	27.36
3	300450	先导智能	5,371,319.00	27.09
4	603690	至纯科技	5,186,866.00	26.16

5	603960	克来机电	4,942,767.60	24.92
6	601318	中国平安	4,347,601.00	21.92
7	002008	大族激光	4,079,194.00	20.57
8	000725	京东方 A	3,987,850.00	20.11
9	600754	锦江酒店	3,949,048.00	19.91
10	002174	游族网络	3,122,217.00	15.74
11	000002	万科 A	3,099,800.00	15.63
12	002562	兄弟科技	3,090,390.00	15.58
13	300618	寒锐钴业	2,870,420.00	14.47
14	300059	东方财富	2,831,737.00	14.28
15	600547	山东黄金	2,722,961.61	13.73
16	002078	太阳纸业	2,600,500.00	13.11
17	002241	歌尔股份	2,591,700.00	13.07
18	300118	东方日升	2,490,208.00	12.56
19	603993	洛阳钼业	2,398,000.00	12.09
20	300233	金城医药	2,381,832.00	12.01
21	002387	维信诺	2,299,594.00	11.60
22	601966	玲珑轮胎	2,213,666.00	11.16
23	300724	捷佳伟创	2,205,900.00	11.12
24	600567	山鹰纸业	2,140,968.00	10.80
25	300182	捷成股份	2,126,072.00	10.72
26	002548	金新农	2,098,706.00	10.58
27	600373	中文传媒	2,082,044.00	10.50
28	600216	浙江医药	2,000,093.00	10.09
29	300207	欣旺达	1,963,600.00	9.90
30	000100	TCL 科技	1,962,660.00	9.90
31	000338	潍柴动力	1,923,435.00	9.70
32	002745	木林森	1,912,200.00	9.64
33	002353	杰瑞股份	1,893,450.00	9.55
34	000651	格力电器	1,748,767.00	8.82
35	300168	万达信息	1,676,494.00	8.45
36	300832	新产业	1,600,000.00	8.07
37	601881	中国银河	1,574,700.00	7.94
38	002142	宁波银行	1,525,684.00	7.69
39	600690	海尔智家	1,470,500.00	7.42
40	600183	生益科技	1,425,000.00	7.19
41	300498	温氏股份	1,370,000.00	6.91
42	002402	和而泰	1,360,700.16	6.86
43	000001	平安银行	1,322,772.00	6.67
44	600699	均胜电子	1,286,715.00	6.49
45	601009	南京银行	1,266,135.00	6.38
46	603799	华友钴业	1,168,196.00	5.89
47	000887	中鼎股份	1,150,123.00	5.80
48	600114	东睦股份	1,055,150.00	5.32

49	300454	深信服	1,050,900.00	5.30
50	600703	三安光电	1,021,250.00	5.15
51	300568	星源材质	1,003,420.00	5.06
52	600967	内蒙一机	993,970.00	5.01
53	000630	铜陵有色	970,000.00	4.89
54	300073	当升科技	952,400.00	4.80
55	601636	旗滨集团	882,560.00	4.45
56	000783	长江证券	854,398.00	4.31
57	600026	中远海能	749,406.00	3.78
58	603026	石大胜华	700,817.00	3.53
59	600340	华夏幸福	622,342.00	3.14
60	002391	长青股份	619,666.00	3.12
61	000860	顺鑫农业	553,500.00	2.79
62	002456	欧菲光	540,957.00	2.73
63	600273	嘉化能源	515,867.00	2.60
64	601688	华泰证券	512,004.00	2.58
65	600110	诺德股份	473,800.00	2.39
66	603612	索通发展	465,500.00	2.35
67	600000	浦发银行	451,733.00	2.28
68	002444	巨星科技	441,900.00	2.23
69	000401	冀东水泥	414,773.00	2.09
70	600466	蓝光发展	407,519.00	2.05

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	300059	东方财富	3,215,449.69	16.21
2	002174	游族网络	3,150,335.00	15.89
3	300450	先导智能	2,739,639.00	13.81
4	000725	京东方 A	2,479,359.00	12.50
5	002387	维信诺	2,464,995.00	12.43
6	300724	捷佳伟创	2,423,800.00	12.22
7	601066	中信建投	2,240,226.00	11.30
8	002745	木林森	2,157,618.00	10.88
9	603690	至纯科技	1,994,000.00	10.05
10	002402	和而泰	1,751,104.48	8.83
11	002241	歌尔股份	1,657,026.00	8.36
12	002008	大族激光	1,655,069.84	8.35
13	002562	兄弟科技	1,598,604.00	8.06
14	002460	赣锋锂业	1,592,800.00	8.03
15	603960	克来机电	1,488,854.00	7.51

16	600699	均胜电子	1,360,103.00	6.86
17	600703	三安光电	1,240,000.00	6.25
18	603799	华友钴业	1,229,200.00	6.20
19	000100	TCL 科技	1,227,512.00	6.19
20	300832	新产业	1,083,634.00	5.46
21	600967	内蒙一机	1,070,000.00	5.40
22	300073	当升科技	1,051,150.00	5.30
23	600547	山东黄金	1,040,661.00	5.25
24	601636	旗滨集团	988,008.00	4.98
25	600216	浙江医药	913,708.00	4.61
26	000783	长江证券	815,805.00	4.11
27	600026	中远海能	784,709.99	3.96
28	601688	华泰证券	731,694.00	3.69
29	601881	中国银河	669,750.00	3.38
30	002391	长青股份	667,083.00	3.36
31	300207	欣旺达	645,000.00	3.25
32	600340	华夏幸福	588,413.00	2.97
33	002456	欧菲光	522,559.00	2.64
34	002444	巨星科技	517,500.00	2.61
35	600000	浦发银行	469,753.00	2.37
36	000401	冀东水泥	459,604.00	2.32
37	603612	索通发展	449,176.00	2.27
38	600030	中信证券	440,470.00	2.22
39	600406	国电南瑞	397,204.00	2.00

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	142,495,820.82
卖出股票的收入（成交）总额	62,046,288.00

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	7,003,500.00	1.39
2	央行票据	-	-

3	金融债券	19,963,000.00	3.96
	其中：政策性金融债	19,963,000.00	3.96
4	企业债券	16,985,600.00	3.37
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	387,366,632.86	76.77
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	431,318,732.86	85.48

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	132018	G 三峡 EB1	333,080	36,958,556.80	7.32
2	128094	星帅转债	143,060	16,712,269.20	3.31
3	200306	20 进出 06	150,000	14,938,500.00	2.96
4	113547	索发转债	116,160	13,552,387.20	2.69
5	128048	张行转债	118,036	13,268,426.76	2.63

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投资股指期货。

7.10.2 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 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投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金所投资的可转债张行转债（128048）的发行主体江苏张家港农村商业银行股份有限公司于 2019 年 12 月 31 日收到银保监会苏州监管分局发布的行政处罚决定（苏州银保监罚决字（2019）43 号），主要内容为：张家港行源数据差错致使报表错报且责令改正逾期不改正，罚款 25 万元。

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。

除上述情况外，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。

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	73,335.98
2	应收证券清算款	7,212,368.01
3	应收股利	-
4	应收利息	1,028,669.70
5	应收申购款	8,450,643.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	16,765,017.04
---	----	---------------

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	132018	G 三峡 EB1	36,958,556.80	7.32
2	113547	索发转债	13,552,387.20	2.69
3	128048	张行转债	13,268,426.76	2.63
4	110062	烽火转债	12,346,290.00	2.45
5	128021	兄弟转债	12,182,045.76	2.41
6	123002	国祯转债	11,455,656.32	2.27
7	128057	博彦转债	11,017,611.42	2.18
8	110051	中天转债	10,838,625.00	2.15
9	123027	蓝晓转债	10,145,440.26	2.01
10	123030	九洲转债	8,286,089.50	1.64
11	113536	三星转债	7,789,643.00	1.54
12	128051	光华转债	7,282,948.40	1.44
13	113556	至纯转债	7,013,500.00	1.39
14	113550	常汽转债	6,902,061.60	1.37
15	127005	长证转债	5,014,586.88	0.99
16	128039	三力转债	4,929,138.00	0.98
17	110060	天路转债	4,868,391.60	0.96
18	110041	蒙电转债	4,680,993.60	0.93
19	113025	明泰转债	4,573,596.30	0.91
20	110042	航电转债	4,280,835.00	0.85
21	113552	克来转债	4,275,130.60	0.85
22	128049	华源转债	4,126,800.00	0.82
23	128075	远东转债	4,042,196.53	0.80
24	127013	创维转债	3,870,270.60	0.77
25	113544	桃李转债	3,641,240.00	0.72
26	123033	金力转债	2,727,250.00	0.54
27	113518	顾家转债	2,550,165.00	0.51
28	128019	久立转 2	2,487,821.85	0.49
29	113543	欧派转债	2,239,020.00	0.44
30	128034	江银转债	2,231,928.00	0.44
31	128084	木森转债	2,215,983.00	0.44
32	113534	鼎胜转债	2,181,800.00	0.43
33	110056	亨通转债	2,141,820.00	0.42
34	113028	环境转债	2,102,900.00	0.42
35	113557	森特转债	1,771,761.80	0.35

36	123012	万顺转债	1,676,865.60	0.33
37	110063	鹰 19 转债	1,598,550.00	0.32
38	113029	明阳转债	1,184,764.50	0.23
39	113020	桐昆转债	1,157,380.80	0.23
40	128066	亚泰转债	1,037,926.48	0.21
41	113019	玲珑转债	989,760.00	0.20
42	110034	九州转债	805,560.00	0.16
43	110047	山鹰转债	539,050.00	0.11
44	128083	新北转债	532,334.40	0.11
45	113546	迪贝转债	517,250.00	0.10
46	113549	白电转债	421,600.00	0.08
47	128058	拓邦转债	407,759.70	0.08
48	123026	中环转债	265,003.60	0.05

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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
光大保德信信用添益债券 A 类	14,419	20,433.40	109,504,411.25	37.17%	185,124,749.26	62.83%
光大保德信信用添益债券 C 类	7,391	19,541.75	17,111,458.44	11.85%	127,321,597.78	88.15%
合计	21,810	20,131.23	126,615,869.69	28.84%	312,446,347.04	71.16%

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	光大保德信信用添益债券 A 类	31,854.52	0.01%
	光大保德信信用添益债券 C 类	0.00	0.00%
	合计	31,854.52	0.01%

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	光大保德信信用添益债券 A 类	0~10
	光大保德信信用添益债券 C 类	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	光大保德信信用添益债券 A 类	0
	光大保德信信用添益债券 C 类	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	光大保德信信用添益债券 A 类	光大保德信信用添益债券 C 类
基金合同生效日（2011 年 5 月 16 日）基金份额总额	677,320,442.33	1,950,037,564.25
本报告期期初基金份额总额	8,444,083.21	9,393,068.03
本报告期基金总申购份额	416,583,836.07	284,445,775.44
减：本报告期基金总赎回份额	130,398,758.77	149,405,787.25
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	294,629,160.51	144,433,056.22

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，经公司十届四次董事会会议审议通过，自 2020 年 2 月 11 日起，包爱丽女士正式离任公司总经理，由本基金管理人董事长林昌先生代任公司总经理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金在本报告期内的投资策略未发生改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金报告期内未持有基金。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所情况。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

10.8 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	
东方证券	1	80,561,147.81	39.39%	75,026.62	39.91%	-
光大证券	1	123,962,856.01	60.61%	112,967.27	60.09%	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-

注：（1）报告期内新增租用证券公司交易单元：中信建投证券(46694、010072)

报告期内未停止租用交易单元。

（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。

10.8.2 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
东方证券	480,120,587.67	44.78%	1,478,400,000.00	94.44%	-	-
光大证券	592,009,125.05	55.22%	87,000,000.00	5.56%	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-

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	光大保德信信用添益债券型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资的公告	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	2020-01-08

		息披露报纸	
2	光大保德信信用添益债券型证券投资基金分红公告	同上	2020-01-10
3	光大保德信信用添益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	2020-01-13
4	光大保德信信用添益债券型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	同上	2020-01-17
5	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	2020-02-12
6	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	2020-02-22
7	光大保德信信用添益债券型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	同上	2020-04-22
8	光大保德信信用添益债券型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资的公告	同上	2020-04-27
9	光大保德信信用添益债券型证券投资基金分红公告	同上	2020-04-29
10	光大保德信信用添益债券型证券投资基金 2019 年年度报告	同上	2020-04-30
11	光大保德信信用添益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	2020-04-30
12	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	2020-05-14
13	光大保德信信用添益债券型证券投资基金招募说明书（更新）	同上	2020-06-29
14	光大保德信信用添益债券型证券投资基金招募说明书摘要（更新）	同上	2020-06-29

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	20200205-20200420	0.00	47,698,836.25	0.00	47,698,836.25	10.86%
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

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信用添益债券型证券投资基金设立的文件
- 2、光大保德信信用添益债券型证券投资基金基金合同
- 3、光大保德信信用添益债券型证券投资基金招募说明书
- 4、光大保德信信用添益债券型证券投资基金托管协议
- 5、光大保德信信用添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信用添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

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

光大保德信基金管理有限公司

二〇二〇年八月三十一日