

**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**  
**2020 年年度报告**  
**2020 年 12 月 31 日**

基金管理人：光大保德信基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年三月三十一日

## §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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 30 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。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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                         | 9  |
| 2.4 信息披露方式                              | 10 |
| 2.5 其他相关资料                              | 10 |
| <b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>          | 10 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 10 |
| 3.2 基金净值表现                              | 11 |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况                       | 13 |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | 13 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 13 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 18 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 18 |
| 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             | 19 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 20 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 20 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 21 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 22 |
| 4.9 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       | 22 |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | 22 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 22 |
| 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 | 23 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见      | 23 |
| <b>§6 审计报告</b>                          | 23 |
| 6.1 审计意见                                | 23 |
| 6.2 形成审计意见的基础                           | 23 |
| 6.3 其他信息                                | 24 |
| 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任                     | 24 |
| 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任                     | 24 |
| <b>§7 年度财务报表</b>                        | 25 |
| 7.1 资产负债表                               | 25 |
| 7.2 利润表                                 | 27 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 28 |
| 7.4 报表附注                                | 30 |
| <b>§8 投资组合报告</b>                        | 57 |
| 8.1 期末基金资产组合情况                          | 57 |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合                      | 58 |
| 8.3 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 58 |
| 8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 58 |

|            |   |           |
|------------|---|-----------|
| 8.5        | 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 .....    | 59        |
| 8.6        | 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 ..... | 59        |
| 8.7        | 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 ..... | 59        |
| 8.8        | 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 .....    | 60        |
| 8.9        | 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....              | 60        |
| 8.11       | 投资组合报告附注 .....                          | 60        |
| <b>§9</b>  | <b>基金份额持有人信息</b> .....                  | <b>61</b> |
| 9.1        | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 61        |
| 9.2        | 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 .....     | 62        |
| 9.3        | 发起式基金发起资金持有份额情况 .....                   | 62        |
| <b>§10</b> | <b>开放式基金份额变动</b> .....                  | <b>62</b> |
| <b>§11</b> | <b>重大事件揭示</b> .....                     | <b>63</b> |
| 11.1       | 基金份额持有人大会决议 .....                       | 63        |
| 11.2       | 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 .....       | 63        |
| 11.3       | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....            | 63        |
| 11.4       | 基金投资策略的改变 .....                         | 63        |
| 11.5       | 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....                | 63        |
| 11.6       | 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                  | 63        |
| 11.7       | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....          | 63        |
| 11.8       | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                 | 64        |
| 11.9       | 其他重大事件 .....                            | 65        |
| <b>12</b>  | <b>影响投资者决策的其他重要信息</b> .....             | <b>67</b> |
| <b>§13</b> | <b>备查文件目录</b> .....                     | <b>67</b> |
| 13.1       | 备查文件目录 .....                            | 67        |
| 13.2       | 存放地点 .....                              | 68        |
| 13.3       | 查阅方式 .....                              | 68        |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                               |
|------------|-------------------------------|
| 基金名称       | 光大保德信尊享纯债定期开放债券型发起式证券投资<br>基金 |
| 基金简称       | 光大保德信尊享纯债定期开放债券发起式            |
| 基金主代码      | 005426                        |
| 交易代码       | 005426                        |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                        |
| 基金合同生效日    | 2019 年 8 月 1 日                |
| 基金管理人      | 光大保德信基金管理有限公司                 |
| 基金托管人      | 中国光大银行股份有限公司                  |
| 报告期末基金份额总额 | 955,750,204.90 份              |
| 基金合同存续期    | 不定期                           |

### 2.2 基金产品说明

|      |   |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金在控制信用风险、谨慎投资的前提下，力争在获取持有期收益的同时，实现基金资产的长期稳定增值。  |
| 投资策略 | <p>1、封闭期投资策略</p> <p>本基金将在控制信用风险、谨慎投资的前提下，力争在获取持有期收益的同时，实现基金资产的长期稳定增值。基于此目标，本基金将充分发挥基金管理人的研究优势，将规范的宏观研究、严谨的个券分析与积极主动的投资风格相结合，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，动态调整固定收益类资产配置比例，自上而下决定债券组合久期及债券类属配置；在严谨深入的基本面分析和信用分析基础上，综合考量各类债券的流动性、供求关系、风险及收益率水平等，自下而上地精选个券。</p> <p>（1）资产配置策略</p> <p>本基金根据工业增加值、通货膨胀率等宏观经济指标，结合国家货币政策和财政政策实施情况、市场收益率曲线变动情况、市场流动性情况，综合</p> |

|  |  |
|--|--|
|  | <p>分析债券市场的变动趋势。最终确定本基金在债券类资产中的投资比率，构建和调整债券投资组合。</p> <p>(2) 目标久期策略及凸性策略</p> <p>在组合的久期选择方面，本基金将综合分析宏观面的各个要素，主要包括宏观经济所处周期、货币财政政策动向、市场流动性变动情况等，通过对各宏观变量的分析，判断其对市场利率水平的影响方向和程度，从而确定本基金固定收益投资组合久期的合理范围。并且动态调整本基金的目标久期，即预期利率上升时适当缩短组合久期，在预期利率下降时适当延长组合久期，从而提高债券投资收益。</p> <p>由于债券价格与收益率之间往往存在明显的非线性关系，所以通过凸性管理策略为久期策略补充，可以更好地分析债券的利率风险。凸性越大，利率上行引起的价格损失越小，而利率下行带来的价格上升越大；反之亦然。本基金将通过严格的凸性分析，对久期策略做出适当的补充和修正。</p> <p>(3) 收益率曲线策略</p> <p>在确定了组合的整体久期后，组合将基于宏观经济研究和债券市场跟踪，结合收益率曲线的拟合和波动模拟模型，对未来的收益率曲线移动进行情景分析，从而根据不同期限的收益率变动情况，在期限结构配置上适时采取子弹型、哑铃型或者阶梯型等策略，进一步优化组合的期限结构，增强基金的收益。</p> <p>(4) 信用债投资策略</p> <p>信用类债券是本基金的重要投资对象，因此信用策略是本基金债券投资策略的重要部分。由于影响信用债券利差水平的因素包括市场整体的信用利差水平和信用债自身的信用情况变化，因此本基金的信用债投资策略可以具体分为市场整体信用利差曲线策略和单个信用债信用分析策略。</p> <p>1) 市场整体信用利差曲线策略</p> <p>本基金将从经济周期、市场特征和政策因素三方面考量信用利差曲线的整体走势。在经济周期向上阶段，企业盈利能力增强，经营现金流改善，则信用利差可能收窄，反之当经济周期不景气，企业的盈利能力减弱，信用利差扩大。同时本基金也将考虑市场容量、信用债结构以及流动性之间的相互关系，动态研究信用债市场的主要特征，为分析信用利差提供依据。</p> |
|--|--|

|  |   |
|--|---|
|  | <p>另外，政策因素也会对信用利差造成很大影响。这种政策影响集中在信用债市场的供给方面和需求方面。本基金将从供给和需求两方面分别评估政策对信用债市场的作用。</p> <p>本基金将综合各种因素，分析信用利差曲线整体及分行业走势，确定信用债券总的投资比例及分行业的投资比例。</p> <p>2) 单个信用债信用分析策略</p> <p>信用债的收益率水平及其变化很大程度上取决于其发行主体自身的信用水平，本基金将对不同信用类债券的信用等级进行评估，深入挖掘信用债的投资价值，增强本基金的收益。</p> <p>本基金主要通过发行主体偿债能力、抵押物质量、契约条款和公司治理情况等方面分析和评估单个信用债券的信用水平：</p> <p>信用债作为发行主体的一种融资行为，发行主体的偿债能力是首先需要考虑的重要因素。本基金将从行业和企业两个层面来衡量发行主体的偿债能力。A) 行业层面：包括行业发展趋势、政策环境和行业运营竞争状况；B) 企业层面：包括盈利指标分析、资产负债表分析和现金流分析等。</p> <p>抵押物作为信用债发行时的重要组成部分，是债券持有人分析和衡量该债券信用风险的关键因素之一。对于抵押物质量的考察主要集中在抵押物的现金流生成能力和资产增值能力。抵押物产生稳定现金流的能力越强、资产增值的潜力越大，则抵押物的质量越好，从而该信用债的信用水平也越高。</p> <p>契约条款是指在信用债发行时明确规定的，约束和限制发行人行为的条款内容。具体包含承诺性条款和限制性条款两方面，本基金首先分析信用债券中契约条款的合理性和可实施性，随后对发行人履行条款的情况进行动态跟踪与评估，发行人对契约条款的履行情况越良好，其信用水平也越高。对于通过发行债券开展融资活动的企业来说，该发行人的公司治理情况是该债券维持高信用等级的重要因素。本基金关注的公司治理情况包括持有人结构、股东权益与员工关系、运行透明度和信息披露、董事会结构和效率等。</p> <p>(5) 可转换债券投资策略</p> <p>本基金在分析宏观经济运行特征和证券市场趋势判断的前提下，在综合分</p> |
|--|---|

析可转换债券的债性特征、股性特征等因素的基础上，选择其中安全边际较高、股性活跃并具有较高上涨潜力的品种进行投资。结合行业分析和个券选择，对成长前景较好的行业和上市公司的可转换债券进行重点关注，选择投资价值较高的个券进行投资。

#### （6）中小企业私募债投资策略

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。

#### （7）资产支持证券投资策略

资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提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。

#### （8）证券公司短期公司债券投资策略

本基金将通过对证券行业分析、证券公司资产负债分析、公司现金流分析等调查研究，分析证券公司短期公司债券的违约风险及合理的利差水平，对证券公司短期公司债券进行独立、客观的价值评估。

基金投资证券公司短期公司债券，基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

#### （9）债券回购投资策略

在本基金的日常投资中，还将充分利用组合的债券回购操作，利用债券回购收益率低于债券收益率的机会，融入资金购买收益率较高的债券品种，在严格头寸管理的基础上，在资金相对充裕的情况下进行风险可控的债券回购投资策略以放大债券投资收益。



|        |  |
|--------|--|
|        | <p>(10) 国债期货投资策略</p> <p>基金管理人可运用国债期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。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。</p> <p>2、开放期投资策略</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。</p> |
| 业绩比较基准 | 中债总全价指数收益率。  |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金，但低于股票型基金和混合型基金。   |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人                                   | 基金托管人                     |
|-------------|------|---|---------------------------|
| 名称          |      | 光大保德信基金管理有限公司                           | 中国光大银行股份有限公司              |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 王许利                                     | 石立平                       |
|             | 联系电话 | (021) 80262888                          | 010-63639180              |
|             | 电子邮箱 | epfservice@epf.com.cn                   | shiliping@cebbank.com     |
| 客户服务电话      |      | 4008-202-888                            | 95595                     |
| 传真          |      | (021) 80262468                          | 010-63639132              |
| 注册地址        |      | 上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢，6层              | 北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心 |
| 办公地址        |      | 上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢（北区3号楼），6-7层、10层 | 北京市西城区太平桥大街25号<br>中国光大中心  |
| 邮政编码        |      | 200010                                  | 100033                    |
| 法定代表人       |      | 刘翔                                      | 李晓鹏                       |

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                 | 办公地址  |
|--------|--------------------|---|
| 会计师事务所 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） | 上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼                    |
| 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、基金净值表现及利润分配情况

### 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 | 2020 年         | 2019 年 8 月 1 日（基金合同生效日）至<br>2019 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------------|--|
| 本期已实现收益       | 17,623,205.72  | 5,557,337.69                                 |
| 本期利润          | 10,365,321.53  | 8,046,497.79                                 |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0051         | 0.0191                                       |
| 本期加权平均净值利润率   | 0.49%          | 1.90%  |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.42%          | 1.37%  |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2020 年末        | 2019 年末                                      |
| 期末可供分配利润      | -4,690,989.57  | 5,952,842.11                                 |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0049        | 0.0059                                       |
| 期末基金资产净值      | 966,764,804.12 | 1,016,793,361.79                             |
| 期末基金份额净值      | 1.0115         | 1.0078                                       |

| 3.1.3 累计期末指标 | 2020 年末 | 2019 年末 |
|--------------|---------|---------|
| 基金份额累计净值增长率  | 3.83%   | 1.37%   |

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）本基金合同生效于 2019 年 8 月 1 日，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

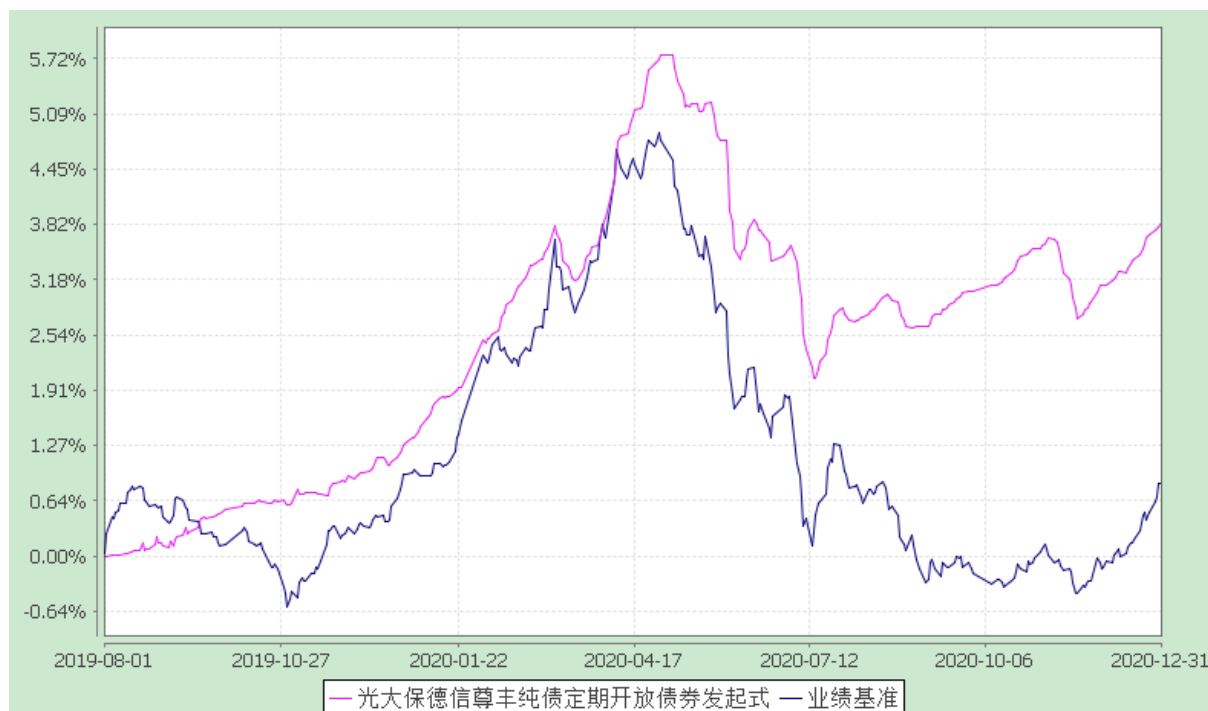
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 0.76%    | 0.06%       | 1.03%      | 0.08%         | -0.27% | -0.02% |
| 过去六个月      | 0.35%    | 0.07%       | -1.00%     | 0.12%         | 1.35%  | -0.05% |
| 过去一年       | 2.42%    | 0.10%       | -0.16%     | 0.15%         | 2.58%  | -0.05% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.83%    | 0.08%       | 0.83%      | 0.13%         | 3.00%  | -0.05% |

#### 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

光大保德信尊丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2019 年 8 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日)

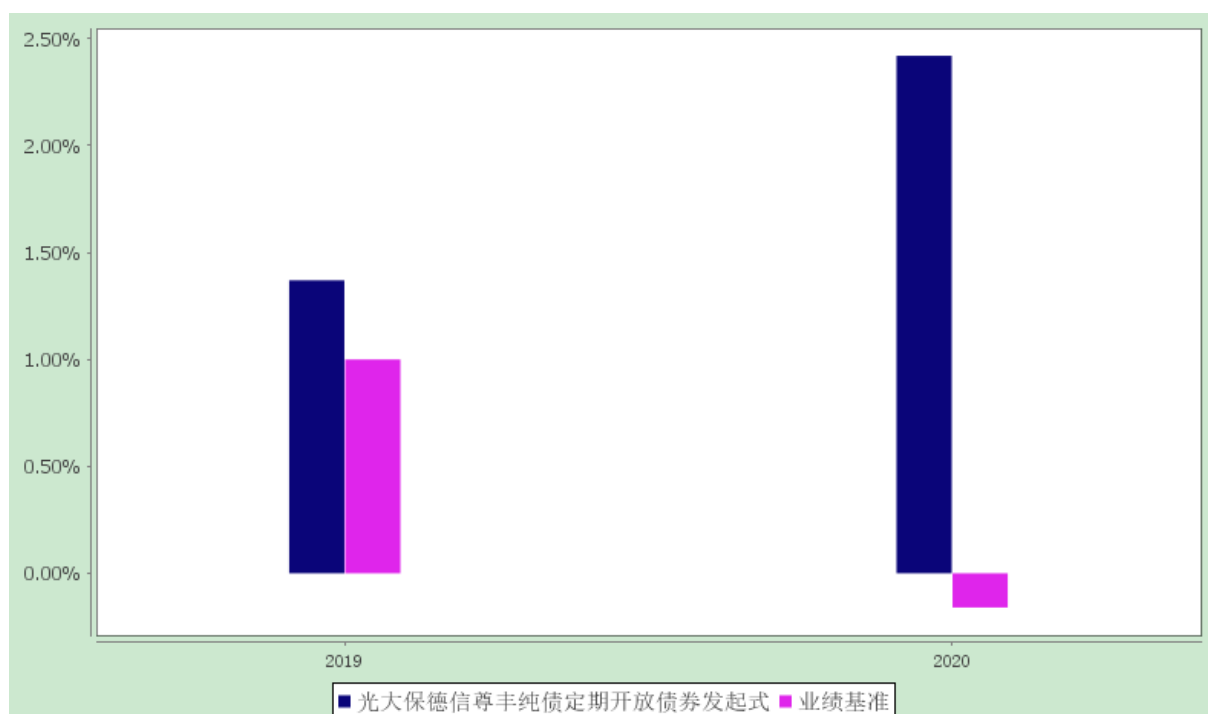


注：根据基金合同的规定，本基金建仓期为 2019 年 8 月 1 日至 2020 年 1 月 31 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

光大保德信尊享纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同于 2019 年 8 月 1 日生效，合同生效当年净值收益率按实际存续期计算，

未按整个自然年度折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度   | 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 | 年度利润分配合计      | 备注 |
|------|-------------|---------------|-----------|---------------|----|
| 2020 | 0.205       | 60,592,879.20 | -         | 60,592,879.20 | -  |
| 2019 | 0.059       | 1,239,000.00  | -         | 1,239,000.00  | -  |
| 合计   | 0.264       | 61,831,879.20 | -         | 61,831,879.20 | -  |

## §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 12 月 31 日，光大保德信旗下管理着 56 只开放式基金，即光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信货币市场基金、光大保德信红利混合型证券投资基金、光大保德信新增长混合型证券投资基金、光大保德信优势配置混合型证券投资基金、光大保德信增利收益债券型证券投资基金、光大保德信均衡精选混合型证券投资基金、光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信中小盘混合型证券投资基金、光大保德信信用添益债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动混合型证券投资基金、光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金、光大保德信现金宝货币市场基金、光大保德信银发商机主题混合型证券投资基金、光大保德信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、光大保德信安和债券型证券投资基金、光大保德信安祺债券型证券投资基金、光大保德信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、光大保德信尊合 87 个月定期开放债券型证券投资基金、光大保德信尊裕纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、光大保德信中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、光大保德信安瑞一年持有期债券型证券投资基金。

#### 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<br>(助理) 期限 |      | 证券从业<br>年限 | 说明   |
|----|------|----------------------|------|------------|--|
|    |      | 任职日期                 | 离任日期 |            |  |
| 毕凯 | 基金经理 | 2020-08-14           | -    | 3 年        | 毕凯先生，2012 年获得澳门科技大学学士学位，2014 年获得澳门科技大学会计学的硕士学位。2014 年 7 月至 2017 年 4 月在安永（中国）企业咨询有限公司担任高级咨询顾问；2017 年 5 月加入光大保德信基金管理有限公司，历任信用研究员，2020 年 8 月至今担任光大保德信尊丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2020 年 10 月至今担任光大保德信尊裕纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。 |

|    |                 |            |   |  |
|----|-----------------|------------|---|--|
| 沈荣 | 固定收益部投资副总监、基金经理 | 2019-08-10 | - | 8 年<br>沈荣先生，2007 年获得上海交通大学工学学士学位，2011 年获得上海财经大学金融学硕士学位。2007 年 7 月至 2008 年 9 月在上海电器科学研究所（集团）有限公司任职 CAD 开发工程师；2011 年 6 月至 2012 年 3 月在国金证券股份有限公司任职行业研究员；2012 年 3 月至 2014 年 4 月在宏源证券股份有限公司任职行业分析师、固定收益分析师；2014 年 4 月至 2017 年 6 月在平安养老保险股份有限公司任职债券助理研究经理、投资经理；2017 年 7 月加入光大保德信基金管理有限公司，现任公司固定收益部投资副总监，2017 年 8 月至今担任光大保德信货币市场基金的基金经理，2017 年 8 月至 2019 年 9 月担任光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 11 月至 2018 年 3 月担任光大保德信尊尚一年定期开放债券型证券投资基金（已清盘）的基金经理，2018 年 1 月至 2020 年 3 月担任光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金（2020 年 3 月起转型为光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金）的基金经理，2018 年 2 月至今担任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的基金经理，2018 年 3 月至 2019 年 11 月担任光大保德信多策略智选 18 个月定期开放混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 5 月至 2020 年 2 月担任光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 5 月至今担任光大保德信中高等级债券型证券投资基金、光大保德信尊富 18 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理，2018 年 6 月至今担任光大保德信超短债债券型证券投资基金的基金经理，2018 年 |
|----|-----------------|------------|---|--|

|     |                 |            |            |      |   |
|-----|-----------------|------------|------------|------|---|
|     |                 |            |            |      | 8 月至 2019 年 9 月担任光大保德信晟利债券型证券投资基金的基金经理，2018 年 9 月至 2019 年 9 月担任光大保德信安泽债券型证券投资基金的基金经理，2019 年 8 月至今担任光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2020 年 3 月至今担任光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金的基金经理，2020 年 8 月至今担任光大保德信尊合 87 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理，2020 年 12 月至今担任光大保德信安瑞一年持有期债券型证券投资基金的基金经理。  |
| 曾小丽 | 基金经理            | 2019-08-01 | 2020-08-14 | 5 年  | 曾小丽女士，2009 年获得天津外国语大学国际贸易专业学士学位，2011 年获得中国人民大学世界经济专业硕士学位。2011 年 7 月至 2014 年 7 月在大公国际资信评估有限公司历任分析师、处经理、技术总监/评审委员；2014 年 8 月加入光大保德信基金管理有限公司，历任信用研究员，现任固收研究负责人，2018 年 3 月至今担任光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 5 月至今担任光大保德信诚鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 10 月至 2019 年 11 月担任光大保德信增利收益债券型证券投资基金的基金经理，2018 年 10 月至 2020 年 2 月担任光大保德信安祺债券型证券投资基金的基金经理，2019 年 8 月至 2020 年 8 月担任光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。 |
| 周华  | 固定收益部投资副总监、基金经理 | 2019-08-01 | 2020-08-14 | 10 年 | 周华先生，香港大学金融学硕士。2009 年 7 月至 2011 年 5 月在第一创业证券股份有限公司担任债券交易员；2011 年 6 月至 2014 年 9 月在景顺长城基金管理有限公司担任债券交易员、信用研究员、投  |



|  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  | <p>资经理；2014 年 9 月至 2018 年 6 月在泰康资产管理有限责任公司担任固定收益投资总监；2018 年 6 月加入光大保德信基金管理有限公司，任职固定收益部投资副总监一职，2018 年 8 月至 2019 年 12 月担任光大保德信永利纯债债券型证券投资基金的基金经理，2018 年 8 月至 2020 年 10 月担任光大保德信晟利债券型证券投资基金的基金经理，2018 年 8 月至今担任光大保德信安诚债券型证券投资基金的基金经理，2018 年 9 月至 2021 年 1 月担任光大保德信安泽债券型证券投资基金的基金经理，2018 年 10 月至今担任光大保德信安和债券型证券投资基金、光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金的基金经理，2018 年 10 月至 2019 年 11 月担任光大保德信信用添益债券型证券投资基金的基金经理，2018 年 11 月至 2019 年 12 月担任光大保德信多策略精选 18 个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2019 年 8 月至 2020 年 8 月担任光大保德信尊丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2020 年 6 月至今担任光大保德信裕鑫混合型证券投资基金的基金经理，2020 年 9 月至今担任光大保德信尊裕纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。</p> |
|--|--|--|--|---|

注：对基金的首任基金经理，其任职日期按基金合同生效日填写，离任日期为公司决定确定的解聘日期；非首任基金经理，其任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规，制定了《光大保德信基金管理有限公司公平交易制度》，并建立《投资研究管理制度》及细则、《集中交易管理制度》、《异常交易监控与报告制度》、《投资对象备选库建立与维护管理办法》等制度作为公平交易执行的制度保障。在投资管理活动中公平的对待公司管理包括开放式基金、特定客户资产管理组合在内的所有组合，范围包括股票、债券等所有投资品种，以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。实行事前控制、事中监控、事后分析的全过程控制，形成有效的公平交易体系。具体的控制方法包括：

事前控制：1、研究人员通过内部晨会、邮件和统一的研究报告平台系统发布投资建议，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策等方面均享有平等机会；2、各个投资主体有明确的职责和权限划分，投资组合经理在权限范围内自主决策，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离；3、建立规范的一级市场股票债券询价申购和配售等审批流程、银行间债券价格公允性审批流程；建立和定期维护二级市场投资对象备选库和银行间市场交易对手库。

事中监控：1、主动管理型的基金，严禁同一投资组合或不同投资组合在同一交易日进行股票的反向交易，严禁不同投资组合在同一交易日进行债券的反向交易，确有需要进行日内反向交易的，需要进行严格的审批流程；2、交易环节中所有指令严格按照“时间优先、价格优先”的原则执行指令，交易所指令均需通过恒生系统公平交易模块进行分发和委托下单。

事后分析：对公平交易的事后分析主要集中在对同一投资组合或不同投资组合临近交易日的反向交易和不同投资组合临近交易日的同向交易，同时在每季度和每年度，对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。特别的，对同一投资组合经理管理的不同投资组合之间的同向交易和反向交易重点进行分析。若出现异常交易行为，则及时进行核查并在向中国证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中对此做

专项说明。

对于公平交易同向交易价差分析，具体的分析方法如下：第一步，在 A 组合买入或者卖出某只证券的当日（3 日、5 日）内，统计 A 组合在此期间的买入或者卖出该股票的均价，同时统计 B 组合在同期、同方向交易同一只证券的均价，然后比较两者的均价差异，其中买入溢价率 = (B 组合交易均价/A 组合交易均价-1)，卖出溢价率 = (A 组合交易均价/B 组合交易均价-1)；第二步，将发生的所有交易价差汇总进行 T 检验，置信区间 95%，得到交易价差是否趋近于 0 的判断结果，并计算 A 组合与 B 组合同向交易中占优次数的比例为占优比例，用溢价率乘以成交量较少方的成交量计算得到 B 组合对 A 组合溢价金额大小，将所有同向交易溢价金额求和，除以 A 组合平均资产净值来计算对 A 组合净值的影响，称为单位溢价率。判断同向交易价格是否有显著差异有以下四条标准：交易价差不趋向于零、样本数大于 30、单位溢价率大于 1%、占优比例不在 45%-55%之间。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行。在同向交易价差分析中，本基金在同日内、3 日内、5 日内同向成交价格与其他投资组合无显著差异，未发现存在违反公平交易原则的现象。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金与公司旗下其他投资组合在交易所市场与银行间市场未发生较少单边成交量大于 5% 的同日反向交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度，受到新冠疫情大幅冲击，全球经济衰退已成定局，国内经济同比增长为负。在良好的疫情防控的基础上，我国经济展现出巨大韧性。货币政策大幅宽松，强化逆周期调节，收益率快速下行。

二季度，在常态化疫情防控中经济社会运行基本趋于正常，经济加快恢复增长。收益率沿着经济复苏、利率债供给增大，收益率曲线一路向上，曲线从牛陡转为熊平。

三季度，经济持续修复，出口、地产拉动使增速略超预期，三产修复快于二产，风险资产未体现疫情影响。监管层重申政策维稳，强调流动性调控重心为“稳杠杆”。

四季度，永煤事件发生后，市场情绪受到极大影响，收益率先上后下。但监管层强调“保持宏观杠杆率基本稳定”的调控目标，交易情绪回暖。货币政策更加灵活适度、精准导向。引导市场利率围

绕公开市场操作利率和中期借贷便利利率平稳运行。

总体来看，20 年黑天鹅频飞，全球经济陷入衰退，而随着全球各大央行提供的源源不断地流动性，无风险利率创新低，风险资产与基本面出现背离，并被不断推高。受益于较快的控制疫情，经济的强劲恢复，我国央行坚持灵活适度、精准导向的货币政策，呵护市场的同时也给实体经济提供了良好支持。

本报告期内，本基金产品保持了仓位调整的灵活性，组合配置上维持资产负债匹配原则，维持中短久期策略。在信用债券评级方面，以高等级信用品种为主，用以获取票息收益和债券结构性机会。通过审慎和积极的管理，在保持组合流动性的基础上，力求为投资者赚取收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内份额净值增长率为 2.42%，业绩比较基准收益率为-0.16%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年，随着经济持续修复以及海内外疫情的缓和，流动性的边际收紧会是市场的主要关注点。“稳杠杆”意味着不会出现类似 2018 年的社融增速大幅下滑；“不急转弯”背景下，央行“结构重于总量”的政策操作思路有望延续。但同时也应留意海内外疫情的反复以及全球疫苗接种进度以及后续效果带来的不确定性。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在开展内部监察稽核工作时本着合规运作、防范风险、保障基金份额持有人利益的宗旨，由独立于各业务部门的督察长和监察稽核部、风险管理部对公司的经营管理、基金的投资运作、基金的销售等公司所有业务及员工行为规范等方面进行定期和不定期检查，及时发现问题并督促相关部门进行整改，并定期制作监察稽核报告报董事会和公司管理层。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面：

督察长和监察稽核部督促、协助各业务部门按照法律法规和监管机构规定对相关制度的合法性、规范性和时效性完善各项内部管理制度和业务流程，明确风险控制职责并具体落实相应措施，提高全体员工的风险意识，有效保障基金份额持有人的利益。

督察长和监察稽核部、风险管理部针对各部门具体业务建立了相应的检查指标及检查重点，通过现场检查、电脑监控、人员询问、重点抽查等一系列方法，定期对公司和基金日常运作的各项业

务进行合法合规检查，并对基金投资交易行为过程实施实时监控，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理，并按规定定期出具监察稽核报告报送董事会和公司管理层。此外，监察稽核部每年实施若干内部审计项目，以风险为导向，对公司重要业务环节提出流程改进建议。

根据中国证监会的规定，督察长和监察稽核部及时准确地向监管机关报送各项报告，并对公司所有对外信息，包括基金法定信息披露、基金产品宣传推介材料等的合法合规情况进行事前审阅，确保其内容真实、准确、完整并符合中国证监会的相关规定。督察长和监察稽核部组织、协调各相关部门及时完成信息披露，确保公司的信息披露工作严格按照中国证监会规定的时间和方式进行。

在全公司范围内开展持续的学习和培训。督察长和监察稽核部先后组织了新员工入司培训，对相关人员进行了法律法规的专项培训和年度监察培训，并组织员工开展学习、讨论，提高和加深了公司员工对基金法律法规的认识和理解，明确风险控制职责，树立全员内控意识。

根据董事会和管理层的要求，以及法规要求和公司业务发展的需要，督察长和监察稽核部以风险为导向，计划并实施了数个内部专项审计项目，及时发现潜在的问题和风险，促使公司规范运作，切实保障基金份额持有人的合法权益。

通过上述工作，在本报告期内，本基金管理人对本基金的管理始终按照法律法规、基金合同、招募说明书和公司制度进行，充分维护和保障了基金持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用资金资产，以风险控制为核心，进一步提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

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

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

#### 4.8 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 年分红：60,592,879.20 元。

#### 4.9 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

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

### §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，中国光大银行股份有限公司在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（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报

告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

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

本基金本报告期分红：60,592,879.20 元。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金 2019 年年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

## §6 审计报告

安永华明（2021）审字第 60467078\_B26 号

光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

我们审计了光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和净值变动情况。

### 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报

表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 其他信息

光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

### 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的财务报告过程。

### 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发



现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

石静筠 蒋燕华

上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼

2021 年 3 月 30 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产    | 附注号     | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|-------|---------|-------------------------|--------------------------|
| 资产：   |         | -                       | -                        |
| 银行存款  | 7.4.7.1 | 1,709,818.12            | 722,071.25               |
| 结算备付金 |         | 147,287.53              | 447,841.31               |

|                 |            |                                 |                                  |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 存出保证金           |            | 67,459.13                       | 9,569.67                         |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 1,069,874,000.00                | 1,417,561,000.00                 |
| 其中：股票投资         |            | -                               | -                                |
| 基金投资            |            | -                               | -                                |
| 债券投资            |            | 1,069,874,000.00                | 1,417,561,000.00                 |
| 资产支持证券投资        |            | -                               | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                               | -                                |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | -                               | -                                |
| 应收证券清算款         |            | -                               | -                                |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 18,667,199.18                   | 24,952,910.42                    |
| 应收股利            |            | -                               | -                                |
| 应收申购款           |            | -                               | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                               | -                                |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                               | -                                |
| <b>资产总计</b>     |            | <b>1,090,465,763.96</b>         | <b>1,443,693,392.65</b>          |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2020 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2019 年 12 月 31 日</b> |
| 负 债：            |            | -                               | -                                |
| 短期借款            |            | -                               | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                               | -                                |
| 衍生金融负债          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | 122,914,295.62                  | 426,055,135.92                   |
| 应付证券清算款         |            | -                               | -                                |
| 应付赎回款           |            | -                               | -                                |
| 应付管理人报酬         | 7.4.10.2   | 326,100.81                      | 344,458.97                       |
| 应付托管费           | 7.4.10.2   | 81,525.20                       | 86,114.72                        |
| 应付销售服务费         |            | -                               | -                                |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 19,375.27                       | 32,288.31                        |

|                   |          |                         |                         |
|-------------------|----------|-------------------------|-------------------------|
| 应交税费              |          | 75,147.51               | 125,904.19              |
| 应付利息              |          | 34,515.43               | 176,128.75              |
| 应付利润              |          | -                       | -                       |
| 递延所得税负债           |          | -                       | -                       |
| 其他负债              | 7.4.7.8  | 250,000.00              | 80,000.00               |
| <b>负债合计</b>       |          | <b>123,700,959.84</b>   | <b>426,900,030.86</b>   |
| <b>所有者权益：</b>     |          | -                       | -                       |
| 实收基金              | 7.4.7.9  | 955,750,204.90          | 1,008,900,209.77        |
| 未分配利润             | 7.4.7.10 | 11,014,599.22           | 7,893,152.02            |
| <b>所有者权益合计</b>    |          | <b>966,764,804.12</b>   | <b>1,016,793,361.79</b> |
| <b>负债和所有者权益总计</b> |          | <b>1,090,465,763.96</b> | <b>1,443,693,392.65</b> |

注：（1）报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0115 元，基金份额总额 955,750,204.90 份。

（2）本基金基金合同于 2019 年 8 月 1 日生效。上年度可比期间自 2019 年 8 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目          | 附注号      | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 8 月 1 日（基<br>金合同生效日）至<br>2019 年 12 月 31 日 |
|-------------|----------|---|---|
| <b>一、收入</b> |          | <b>30,551,095.85</b>                      | <b>9,940,399.49</b>   |
| 1.利息收入      |          | 90,659,307.99                             | 7,246,583.75  |
| 其中：存款利息收入   | 7.4.7.11 | 205,816.38                                | 135,323.74  |
| 债券利息收入      |          | 89,479,508.00                             | 6,992,060.10  |
| 资产支持证券利息收入  |          | -   | -   |
| 买入返售金融资产收入  |          | 973,983.61                                | 119,199.91  |

|                            |          |                      |                     |
|----------------------------|----------|----------------------|---------------------|
| 证券出借利息收入                   |          | -                    | -                   |
| 其他利息收入                     |          | -                    | -                   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           |          | -52,850,327.95       | 204,655.64          |
| 其中：股票投资收益                  | 7.4.7.12 | -                    | -                   |
| 基金投资收益                     |          | -                    | -                   |
| 债券投资收益                     | 7.4.7.13 | -52,850,327.95       | 204,655.64          |
| 资产支持证券投资收益                 | 7.4.7.14 | -                    | -                   |
| 贵金属投资收益                    | 7.4.7.15 | -                    | -                   |
| 衍生工具收益                     | 7.4.7.16 | -                    | -                   |
| 股利收益                       | 7.4.7.17 | -                    | -                   |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 7.4.7.18 | -7,257,884.19        | 2,489,160.10        |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |          | -                    | -                   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 7.4.7.19 | -                    | -                   |
| <b>减：二、费用</b>              |          | <b>20,185,774.32</b> | <b>1,893,901.70</b> |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2 | 8,303,188.00         | 687,330.15          |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2 | 2,075,796.97         | 171,832.48          |
| 3. 销售服务费                   |          | -                    | -                   |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.20 | 48,841.30            | 24,652.45           |
| 5. 利息支出                    |          | 9,199,145.18         | 909,278.39          |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 9,199,145.18         | 909,278.39          |
| 6. 税金及附加                   |          | 311,602.87           | 17,293.77           |
| 7. 其他费用                    | 7.4.7.21 | 247,200.00           | 83,514.46           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>10,365,321.53</b> | <b>8,046,497.79</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                    | -                   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>10,365,321.53</b> | <b>8,046,497.79</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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）                        | 1,008,900,209.77                                     | 7,893,152.02   | 1,016,793,361.79  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 10,365,321.53  | 10,365,321.53     |
| 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）      | -53,150,004.87                                       | 53,349,004.87  | 199,000.00        |
| 其中：1.基金申购款                             | 1,946,849,995.13                                     | 53,149,004.87  | 1,999,999,000.00  |
| 2.基金赎回款                                | -2,000,000,000.00                                    | 200,000.00     | -1,999,800,000.00 |
| 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） | -  | -60,592,879.20 | -60,592,879.20    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 955,750,204.90                                       | 11,014,599.22  | 966,764,804.12    |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2019 年 8 月 1 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 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）                        | 210,000,000.00                                       | -              | 210,000,000.00    |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本                   | -  | 8,046,497.79   | 8,046,497.79      |

|  |                  |               |                  |
|--|------------------|---------------|------------------|
| 期利润)                                   |                  |               |                  |
| 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)      | 798,900,209.77   | 1,085,654.23  | 799,985,864.00   |
| 其中：1.基金申购款                             | 998,900,209.77   | 1,098,790.23  | 999,999,000.00   |
| 2.基金赎回款                                | -200,000,000.00  | -13,136.00    | -200,013,136.00  |
| 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) | -                | -1,239,000.00 | -1,239,000.00    |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 1,008,900,209.77 | 7,893,152.02  | 1,016,793,361.79 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从 7.1 至 7.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人: 刘翔, 主管会计工作负责人: 贺敬哲, 会计机构负责人: 王永万

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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(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[2017]2052号《关于准予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注册的批复》及机构部函[2019]817号《关于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延期募集备案的回函》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 2019 年 8 月 1 日生效, 首次设立募集规模为 210,000,000.00 份基金份额。本基金为契约型开放式, 存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为光大保德信基金管理有限公司, 基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金投资于国内依法发行和上市交易的国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、次级债、中小企业私募债、证券公司短期公司债券、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、同业存单、货币市场工具、银行存款、国债期货等法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具, 但须符合中国证监会的相关规定。

本基金不投资股票或权证。可转债仅投资二级市场可分离交易可转债的纯债部分。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%。但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期开始前 10 个工作日、开放期及开放期结束后 10 个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制。开放期内，本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制，但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。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。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

本基金业绩比较基准为：中债总全价指数收益率。

#### 7.4.2 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。

#### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及自 2020 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括债券投资等；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的债券等，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也



没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (2) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息；

#### (3) 国债期货投资

买入或卖出国债期货投资于成交日确认为国债期货投资。国债期货初始合约价值按成交金额确认；

国债期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，国债期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新

评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2)不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4)如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金

额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5)债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(6)资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7)国债期货投资收益/(损失)于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(8)公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(9)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4)本基金每一基金份额享有同等分配权；

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 税项

##### 7.4.6.1 增值税

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

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

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

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

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

#### 7.4.6.2 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（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。

#### 7.4.6.3 企业所得税

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

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

#### 7.4.6.4 个人所得税

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

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末              | 上年度末             |
|----------------|------------------|------------------|
|                | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
| 活期存款           | 1,709,818.12     | 722,071.25       |
| 定期存款           | -                | -                |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                | -                |
| 存款期限 1-3 个月    | -                | -                |
| 存款期限 3 个月以上    | -                | -                |
| 存款期限 1 个月内     | -                | -                |
| 存款期限 3 个月-1 年  | -                | -                |
| 其他存款           | -                | -                |
| 合计             | 1,709,818.12     | 722,071.25       |

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末              |                  |                  |               |
|---------------|------------------|------------------|------------------|---------------|
|               | 2020 年 12 月 31 日 |                  |                  |               |
|               | 成本               | 公允价值             | 公允价值变动           |               |
| 股票            | -                | -                | -                |               |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                | -                | -                |               |
| 债券            | 交易所市场            | 70,977,242.48    | 70,739,000.00    | -238,242.48   |
|               | 银行间市场            | 1,003,665,481.61 | 999,135,000.00   | -4,530,481.61 |
|               | 合计               | 1,074,642,724.09 | 1,069,874,000.00 | -4,768,724.09 |
| 资产支持证券        | -                | -                | -                |               |
| 基金            | -                | -                | -                |               |
| 其他            | -                | -                | -                |               |
| 合计            | 1,074,642,724.09 | 1,069,874,000.00 | -4,768,724.09    |               |
| 项目            | 上年度末             |                  |                  |               |
|               | 2019 年 12 月 31 日 |                  |                  |               |
|               | 成本               | 公允价值             | 公允价值变动           |               |

|               |                  |                  |                  |
|---------------|------------------|------------------|------------------|
| 股票            | -                | -                | -                |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                | -                | -                |
| 债券            | 交易所市场            | 415,317,425.64   | 414,745,000.00   |
|               | 银行间市场            | 999,754,414.26   | 1,002,816,000.00 |
|               | 合计               | 1,415,071,839.90 | 1,417,561,000.00 |
| 资产支持证券        | -                | -                | -                |
| 基金            | -                | -                | -                |
| 其他            | -                | -                | -                |
| 合计            | 1,415,071,839.90 | 1,417,561,000.00 | 2,489,160.10     |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 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。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2020年12月31日 | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 应收活期存款利息   | 186.67             | 644.49              |
| 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  | 72.93              | 221.65              |
| 应收债券利息     | 18,666,906.25      | 24,952,039.55       |
| 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         | 33.33         | 4.73          |
| 合计         | 18,667,199.18 | 24,952,910.42 |

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -                       | -                        |
| 银行间市场应付交易费用 | 19,375.27               | 32,288.31                |
| 合计          | 19,375.27               | 32,288.31                |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                       | -                        |
| 应付赎回费       | -                       | -                        |
| 应付证券出借违约金   | -                       | -                        |
| 其他          | -                       | -                        |
| 应付银行划款手续费   | -                       | -                        |
| 应付转出费       | -                       | -                        |
| 预提审计费       | 90,000.00               | 40,000.00                |
| 预提信息披露费     | 160,000.00              | 40,000.00                |
| 合计          | 250,000.00              | 80,000.00                |

#### 7.4.7.9 实收基金



金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |                   |
|---------------|--|-------------------|
|               | 基金份额（份）                                | 账面金额              |
| 上年度末          | 1,008,900,209.77                       | 1,008,900,209.77  |
| 本期申购          | 1,946,849,995.13                       | 1,946,849,995.13  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,000,000,000.00                      | -2,000,000,000.00 |
| 本期末           | 955,750,204.90                         | 955,750,204.90    |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

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           | 5,952,842.11   | 1,940,309.91  | 7,893,152.02   |
| 本期利润           | 17,623,205.72  | -7,257,884.19 | 10,365,321.53  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 32,325,841.80  | 21,023,163.07 | 53,349,004.87  |
| 其中：基金申购款       | 25,284,913.00  | 27,864,091.87 | 53,149,004.87  |
| 基金赎回款          | 7,040,928.80   | -6,840,928.80 | 200,000.00     |
| 本期已分配利润        | -60,592,879.20 | -             | -60,592,879.20 |
| 本期末            | -4,690,989.57  | 15,705,588.79 | 11,014,599.22  |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 8 月 1 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日 |
|----------|--|--|
| 活期存款利息收入 | 93,246.06                              | 50,245.13  |
| 定期存款利息收入 | -                                      | 83,891.11  |

|           |            |            |
|-----------|------------|------------|
| 其他存款利息收入  | -          | -          |
| 结算备付金利息收入 | 111,292.79 | 1,175.02   |
| 其他        | 1,277.53   | 12.48      |
| 合计        | 205,816.38 | 135,323.74 |

#### 7.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2020年1月1日至2020年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2019年8月1日（基金合同<br>生效日）至2019年12月31<br>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 | -52,850,327.95                  | 204,655.64  |
| 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                           | -52,850,327.95                  | 204,655.64  |

##### 7.4.7.13.2 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>2020年1月1日至2020年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2019年8月1日（基金合同生<br>效日）至2019年12月31日 |
|------------------------|---------------------------------|---|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 5,438,499,586.43                | 1,103,284,237.59                              |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 5,396,045,596.10                | 1,089,285,675.79                              |
| 减：应收利息总额               | 95,304,318.28                   | 13,793,906.16                                 |
| 买卖债券差价收入               | -52,850,327.95                  | 204,655.64                                    |

##### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——赎回差价收入。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——申购差价收入。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无股利收益。

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 | 上年度可比期间<br>2019年8月1日（基金合同生效<br>日）至2019年12月31日 |
|------------|-----------------------------|---|
| 1.交易性金融资产  | -7,257,884.19               | 2,489,160.10                                  |
| ——股票投资     | -                           | -   |
| ——债券投资     | -7,257,884.19               | 2,489,160.10                                  |
| ——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                     | -7,257,884.19 | 2,489,160.10 |

#### 7.4.7.18 其他收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他收入。

#### 7.4.7.19 交易费用

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12月31日 | 2019年8月1日（基金合同生效日）至2019年12月31日 |
| 交易所市场交易费用 | 4,853.80              | 3,227.45                       |
| 银行间市场交易费用 | 43,987.50             | 21,425.00                      |
| 交易基金产生的费用 | -                     | -                              |
| 其中：申购费    | -                     | -                              |
| 赎回费       | -                     | -                              |
| 合计        | 48,841.30             | 24,652.45                      |

#### 7.4.7.20 其他费用

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12月31日 | 2019年8月1日（基金合同生效日）至2019年12月31日 |
| 审计费用    | 90,000.00             | 40,000.00                      |
| 信息披露费   | 120,000.00            | 40,000.00                      |
| 证券出借违约金 | -                     | -                              |
| 帐户维护费   | 36,000.00             | 3,000.00                       |

|      |            |           |
|------|------------|-----------|
| 其他费用 | 1,200.00   | 514.46    |
| 合计   | 247,200.00 | 83,514.46 |

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

| 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          | 基金管理人、基金发起人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国光大银行股份有限公司（简称“光大银行”） | 基金托管人、基金代销机构              |
| 光大证券股份有限公司（简称“光大证券”）   | 基金管理人的股东                  |
| 保德信投资管理有限公司            | 基金管理人的股东                  |
| 光大保德信资产管理有限公司          | 基金管理人控制的子公司               |

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 |              | 上年度可比期间<br>2019年8月1日（基金合同生效日）<br>至2019年12月31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  | -                           | -            | -   | -            |

注：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股票交易。

##### 7.4.10.1.2 权证交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 |                  | 上年度可比期间<br>2019年8月1日（基金合同生效日）<br>至2019年12月31日 |                  |
|-------|-----------------------------|------------------|---|------------------|
|       | 成交金额                        | 占当期权证成交<br>总额的比例 | 成交金额  | 占当期权证成交<br>总额的比例 |
| 光大证券  | -                           | -                | -   | -                |

注：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。

#### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 |                      | 上年度可比期间<br>2019年8月1日（基金合同生效日）<br>至2019年12月31日 |                      |
|-------|-----------------------------|----------------------|---|----------------------|
|       | 成交金额                        | 占当期债<br>券成交总<br>额的比例 | 成交金额  | 占当期债<br>券成交总<br>额的比例 |
| 光大证券  | 2,120,064,696.69            | 100.00%              | 492,837,242.21                                | 100.00%              |

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 |                            | 上年度可比期间<br>2019年8月1日（基金合同生效日）<br>至2019年12月31日 |                            |
|-------|-----------------------------|----------------------------|---|----------------------------|
|       | 成交金额                        | 占当期债<br>券回购成<br>交总额的<br>比例 | 成交金额  | 占当期债<br>券回购成<br>交总额的<br>比例 |
| 光大证券  | 13,936,000,000.00           | 100.00%                    | 1,778,200,000.00                              | 100.00%                    |

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2020年1月1日至2020年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2019年8月1日（基金合同<br>生效日）至2019年12月31<br>日 |
|-----------------|---------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 8,303,188.00                    | 687,330.15  |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 4,852,820.08                    | 288,592.54  |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.40% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2020年1月1日至2020年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2019年8月1日（基金合同<br>生效日）至2019年12月31<br>日 |
|----------------|---------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,075,796.97                    | 171,832.48  |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金托管费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

#### 7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                        | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31<br>日 | 上年度可比期间<br>2019年8月1日（基金合同生效<br>日）至2019年12月31日 |
|---------------------------|---------------------------------|---|
| 基金合同生效日（2019年8月1日）持有的基金份额 | -                               | 10,000,000.00                                 |
| 期初持有的基金份额                 | 10,000,000.00                   | -   |
| 期间申购/买入总份额                | 0.00                            | -   |
| 期间因拆分变动份额                 | 0.00                            | -   |
| 减：期间赎回/卖出总份额              | 0.00                            | -   |
| 期末持有的基金份额                 | 10,000,000.00                   | 10,000,000.00                                 |
| 期末持有的基金份额占基金总<br>份额比例     | 1.05%                           | 0.99%   |

注：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

7.4.10.4.2 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

份额单位：份

| 关联方名称            | 本期末 2020 年 12 月 31 日 |                              | 上年度末 2019 年 12 月 31 日 |                          |
|------------------|----------------------|------------------------------|-----------------------|--------------------------|
|                  | 持有的基金份额              | 持有的基金<br>份额占基金<br>总份额的比<br>例 | 持有的基金份额               | 持有的基金份<br>额占基金总份<br>额的比例 |
| 中国光大银行股<br>份有限公司 | 945,750,204.90       | 98.95%                       | 998,900,209.77        | 99.01%                   |

7.4.10.5 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>2020年1月1日至2020年12月31日 | 上年度可比期间 |
|-------|-----------------------------|---------|
|       |                             |         |



|      |              |           |                                    |           |
|------|--------------|-----------|------------------------------------|-----------|
|      |              |           | 2019年8月1日（基金合同生效日）<br>至2019年12月31日 |           |
|      | 期末余额         | 当期利息收入    | 期末余额                               | 当期利息收入    |
| 光大银行 | 1,709,818.12 | 93,246.06 | 722,071.25                         | 50,245.13 |

#### 7.4.10.6 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日      | 除息日    |            | 每 10 份<br>基金份额<br>分红数 | 现金形式<br>发放总额      | 再投资形<br>式发放总<br>额 | 利润分配合<br>计        | 备注 |
|----|------------|--------|------------|-----------------------|-------------------|-------------------|-------------------|----|
|    |            | 场<br>内 | 场<br>外     |                       |                   |                   |                   |    |
| 1  | 2020-08-27 | -      | 2020-08-27 | 0.205                 | 60,592,879.2<br>0 | -                 | 60,592,879.2<br>0 | -  |
| 合计 |            |        |            | 0.205                 | 60,592,879.2<br>0 | -                 | 60,592,879.2<br>0 | -  |

#### 7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 122,914,295.62 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码      | 债券名称              | 回购到期日      | 期末估值<br>单价 | 数量（张）        | 期末估值总额         |
|-----------|-------------------|------------|------------|--------------|----------------|
| 101901508 | 19 华发集团<br>MTN006 | 2021-01-05 | 100.58     | 239,000.00   | 24,038,620.00  |
| 101901411 | 19 广州金控<br>MTN001 | 2021-01-04 | 100.65     | 500,000.00   | 50,325,000.00  |
| 101901301 | 19 陆家嘴<br>MTN002  | 2021-01-04 | 100.60     | 237,000.00   | 23,842,200.00  |
| 101900364 | 19 南昌城投<br>MTN001 | 2021-01-06 | 102.73     | 200,000.00   | 20,546,000.00  |
| 101901270 | 19 兆润投资<br>MTN002 | 2021-01-06 | 101.06     | 118,000.00   | 11,925,080.00  |
| 合计        |                   |            |            | 1,294,000.00 | 130,676,900.00 |

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金管理人制定了内部管理制度和流程来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理体系包括三个层次：第一层次是基于自我评估和管理的业务/职能部门；第二层次是公司经营层的风险管理工作委员会；第三层次是董事会下设的风险管理委员会。

各业务/职能部门是公司风险管理工作最直接的实施者，负责根据公司风险管理政策和制度，制订本部门的风险管理计划、工作流程及相关管理责任，并报请风险管理工作委员会审议批准；对本部门的主要风险指标，以及相关的测量、管理方法提出建议，并及时更新，报请风险管理工作委员会审议批准；实施本部门的风险管理日常工作，定期进行自我评估，并向风险管理工作委员会报告评估情况。

风险管理工作委员会是公司经营层面负责风险管理的最高权力机构，根据公司董事会和风险管理工作委员会制订的风险管理政策和授权，负责公司日常的风险管理工作。

风险管理委员会是公司风险管理的最高权力机构，其机构组成、运行方式和相应职责应由董事

会规定。

#### 7.4.13.2 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。

##### 7.4.13.2.1 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<br>2020年12月31日 | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | -                  | -                   |
| A-1 以下 | -                  | -                   |
| 未评级    | 10,011,000.00      | -                   |
| 合计     | 10,011,000.00      | -                   |

注：未评级债券包括：政策性金融债。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2020年12月31日 | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | -                  | -                   |
| A-1 以下 | -                  | -                   |
| 未评级    | 107,567,000.00     | -                   |
| 合计     | 107,567,000.00     | -                   |

注：本基金持有同业存单的主体评级均为 AA+及以上评级。

#### 7.4.13.2.4 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<br>2020年12月31日 | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 765,400,000.00     | 1,334,493,000.00    |
| AAA 以下 | 136,761,000.00     | 83,068,000.00       |
| 未评级    | 50,135,000.00      | -                   |
| 合计     | 952,296,000.00     | 1,417,561,000.00    |

注：未评级债券包括：政策性金融债。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.3 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于约定开放日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于开放期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

回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

#### 7.4.13.3.1 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%。于开放期内，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 7.4.12。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%。

于开放期内，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。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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、清算备付金、存出保证金、债券投资。本基金通过监控组合的久期来评估基金面临的利率风险。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2020年12月<br>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                   | 1,709,818.12   | -     | -              | -              | -    | -             | 1,709,818.12     |
| 结算备付金                  | 147,287.53     | -     | -              | -              | -    | -             | 147,287.53       |
| 存出保证金                  | 67,459.13      | -     | -              | -              | -    | -             | 67,459.13        |
| 交易性金融资产                | -              | -     | 167,713,000.00 | 902,161,000.00 | -    | -             | 1,069,874,000.00 |
| 应收证券清算款                | -              | -     | -              | -              | -    | -             | -                |
| 应收利息                   | -              | -     | -              | -              | -    | 18,667,199.18 | 18,667,199.18    |
| 资产总计                   | 1,924,564.78   | -     | 167,713,000.00 | 902,161,000.00 | -    | 18,667,199.18 | 1,090,465,763.96 |
| 负债                     |                |       |                |                |      |               |                  |
| 卖出回购金融资产               | 122,914,295.62 | -     | -              | -              | -    | -             | 122,914,295.62   |
| 应付管理人报酬                | -              | -     | -              | -              | -    | 326,100.81    | 326,100.81       |

|                             |                         |        |                    |                      |       |                   |                      |
|-----------------------------|-------------------------|--------|--------------------|----------------------|-------|-------------------|----------------------|
| 应付托管费                       | -                       | -      | -                  | -                    | -     | 81,525.20         | 81,525.20            |
| 应付交易费用                      | -                       | -      | -                  | -                    | -     | 19,375.27         | 19,375.27            |
| 其他负债                        | -                       | -      | -                  | -                    | -     | 250,000.00        | 250,000.00           |
| 应交税费                        | -                       | -      | -                  | -                    | -     | 75,147.51         | 75,147.51            |
| 应付利息                        | -                       | -      | -                  | -                    | -     | 34,515.43         | 34,515.43            |
| 负债总计                        | 122,914,29<br>5.62      | -      | -                  | -                    | -     | 786,664.22        | 123,700,95<br>9.84   |
| 利率敏感度缺口                     | -<br>120,989,73<br>0.84 | -      | 167,713,00<br>0.00 | 902,161,00<br>0.00   | -     | 17,880,534.<br>96 | 966,764,80<br>4.12   |
| 上年度末<br>2019 年 12 月<br>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                        | 722,071.25              | -      | -                  | -                    | -     | -                 | 722,071.25           |
| 结算备付金                       | 447,841.31              | -      | -                  | -                    | -     | -                 | 447,841.31           |
| 存出保证金                       | 9,569.67                | -      | -                  | -                    | -     | -                 | 9,569.67             |
| 交易性金融资产                     | -                       | -      | -                  | 1,417,561,0<br>00.00 | -     | -                 | 1,417,561,0<br>00.00 |
| 应收证券清算款                     | -                       | -      | -                  | -                    | -     | -                 | -                    |
| 应收利息                        | -                       | -      | -                  | -                    | -     | 24,952,910.<br>42 | 24,952,910.<br>42    |
| 资产总计                        | 1,179,482.2<br>3        | -      | -                  | 1,417,561,0<br>00.00 | -     | 24,952,910.<br>42 | 1,443,693,3<br>92.65 |
| 负债                          |                         |        |                    |                      |       |                   |                      |
| 卖出回购金融资产                    | 426,055,13<br>5.92      | -      | -                  | -                    | -     | -                 | 426,055,13<br>5.92   |
| 应付管理人报酬                     | -                       | -      | -                  | -                    | -     | 344,458.97        | 344,458.97           |
| 应付托管费                       | -                       | -      | -                  | -                    | -     | 86,114.72         | 86,114.72            |
| 应付交易费用                      | -                       | -      | -                  | -                    | -     | 32,288.31         | 32,288.31            |
| 其他负债                        | -                       | -      | -                  | -                    | -     | 80,000.00         | 80,000.00            |
| 应交税费                        | -                       | -      | -                  | -                    | -     | 125,904.19        | 125,904.19           |
| 应付利息                        | -                       | -      | -                  | -                    | -     | 176,128.75        | 176,128.75           |
| 负债总计                        | 426,055,13              | -      | -                  | -                    | -     | 844,894.94        | 426,900,03           |

|         |                         |   |   |                      |   |                   |                      |
|---------|-------------------------|---|---|----------------------|---|-------------------|----------------------|
|         | 5.92                    |   |   |                      |   |                   | 0.86                 |
| 利率敏感度缺口 | -<br>424,875,65<br>3.69 | - | - | 1,417,561,0<br>00.00 | - | 24,108,015.<br>48 | 1,016,793,3<br>61.79 |

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |   |                                 |                     |
|----|---|---------------------------------|---------------------|
| 假设 | 影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动；<br>利率变动范围合理。 |                                 |                     |
| 分析 | 相关风险变量的变动                               | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币元） |                     |
|    |   | 本期末<br>2020年12月31日              | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|    | 基准利率上升1%                                | 减少约 22,603,385.26               | 减少约 31,070,413.40   |
|    | 基准利率下降1%                                | 增加约 22,603,385.26               | 增加约 31,070,413.40   |

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。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

##### 7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。



#### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 0.00 元，属于第二层次的余额为人民币 1,069,874,000.00 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元（于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 0.00 元，属于第二层次的余额为人民币 1,417,561,000.00 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元）。

##### 7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### 7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

#### 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

#### 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2021 年 3 月 30 日经本基金的基金管理人批准。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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<br>(%) |
|----|----|----|------------------|
|    |    |    |                  |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 1 | 权益投资              | -                | -      |
|   | 其中：股票             | -                | -      |
| 2 | 基金投资              | -                | -      |
| 3 | 固定收益投资            | 1,069,874,000.00 | 98.11  |
|   | 其中：债券             | 1,069,874,000.00 | 98.11  |
|   | 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      | 1,857,105.65     | 0.17   |
| 8 | 其他各项资产            | 18,734,658.31    | 1.72   |
| 9 | 合计                | 1,090,465,763.96 | 100.00 |

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

## 8.3 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.3.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

### 8.3.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

### 8.3.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未持有股票。

## 8.4 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      | 60,146,000.00    | 6.22   |
|    | 其中：政策性金融债 | 60,146,000.00    | 6.22   |
| 4  | 企业债券      | 70,739,000.00    | 7.32   |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -      |
| 6  | 中期票据      | 831,422,000.00   | 86.00  |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -      |
| 8  | 同业存单      | 107,567,000.00   | 11.13  |
| 9  | 其他        | -                | -      |
| 10 | 合计        | 1,069,874,000.00 | 110.67 |

#### 8.5 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  | 101900329 | 19 湘高速 MTN002        | 900,000 | 91,710,000.00 | 9.49         |
| 2  | 102000143 | 20 四川投资(疫情防控债)MTN001 | 700,000 | 69,510,000.00 | 7.19         |
| 3  | 101901411 | 19 广州金控 MTN001       | 500,000 | 50,325,000.00 | 5.21         |
| 4  | 101901508 | 19 华发集团 MTN006       | 500,000 | 50,290,000.00 | 5.20         |
| 5  | 160421    | 16 农发 21             | 500,000 | 50,135,000.00 | 5.19         |

#### 8.6 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。

#### 8.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.8 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。

## 8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.9.2 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.10.1 本期国债期货投资政策

基金管理人可运用国债期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。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。

### 8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 8.11 投资组合报告附注

8.11.1 债券 20 浦发银行 CD469 (112009469.IB) 的发行主体上海浦东发展银行股份有限公司于 2020 年 8 月 10 日收到上海银保监局行政处罚信息公开表(沪银保监银罚决字〔2020〕12 号)，主要内容为：上海浦东发展银行股份有限公司 2013 年至 2018 年，该行存在下列违法违规事实：1. 未按专营部门制规定开展同业业务；2. 同业投资资金违规投向“四证”不全的房地产项目；3. 延迟支付同业投资资金吸收存款；4. 为银行理财资金投向非标准化债权资产违规提供担保；5. 未按规定进行贷款资金支付管理与控制；6. 个人消费贷款贷后管理未尽职；7. 通过票据转贴现业务调节信贷规模；8. 银行承兑汇票业务保证金来源审核未尽职；9. 办理无真实贸易背景的贴现业务；10. 委托贷款资金来源审查未尽职；11. 未按权限和程序办理委托贷款业务；12. 未按权限和程序办理非融资性保函业务。中国银行保险监督管理委员会上海监管局作出行政处罚决定为责令改正、并处罚款共计 2100 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。

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

8.11.2 本基金未投资超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.11.3 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   | 67,459.13     |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 18,667,199.18 |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 18,734,658.31 |

### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的<br>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<br>比例 | 持有份额 | 占总份额<br>比例 |
| 2 | 477,875,102.4 | 955,750,204.90 | 100.00%    | 0.00 | 0.00%      |
|   | 5             |                |            |      |            |

### 9.2 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                                 | 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<br>研究部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0                 |

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金的基金经理均未持有本基金的份额。

### 9.3 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额总数        | 持有份额<br>占基金总<br>份额比例 | 发起份额总数        | 发起份额<br>占基金总<br>份额比例 | 发起份额承<br>诺持有期限   |
|-------------|---------------|----------------------|---------------|----------------------|------------------|
| 基金管理人固有资金   | 10,000,000.00 | 1.05%                | 10,000,000.00 | 1.05%                | 生效之日起<br>不少于 3 年 |
| 基金管理人高级管理人员 | -             | -                    | -             | -                    | -                |
| 基金经理等人员     | -             | -                    | -             | -                    | -                |
| 基金管理人股东     | -             | -                    | -             | -                    | -                |
| 其他          | -             | -                    | -             | -                    | -                |
| 合计          | 10,000,000.00 | 1.05%                | 10,000,000.00 | 1.05%                | 生效之日起<br>不少于 3 年 |

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

|                          |                  |
|--------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2019年8月1日)基金份额总额 | 210,000,000.00   |
| 本报告期期初基金份额总额             | 1,008,900,209.77 |
| 本报告期基金总申购份额              | 1,946,849,995.13 |
| 减：本报告期基金总赎回份额            | 2,000,000,000.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额             | -                |

|             |                |
|-------------|----------------|
| 本报告期末基金份额总额 | 955,750,204.90 |
|-------------|----------------|

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

1、本报告期内，经公司十届十次董事会会议审议通过，自 2020 年 11 月 6 日起，林昌先生正式离任公司董事长，公司总经理刘翔先生代任公司董事长，自 2020 年 11 月 23 日起，公司总经理刘翔先生不再代任公司董事长，王翠婷女士正式担任公司董事长。

2、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。经公司十届六次董事会会议审议通过，自 2020 年 7 月 24 日起，公司董事长林昌先生不再代任公司总经理，刘翔先生正式担任公司总经理。

3、经公司十届七次董事会会议审议通过，自 2020 年 8 月 1 日起，李常青先生正式离任公司副总经理、光大保德信资产管理有限公司执行董事，公司总经理刘翔先生兼任光大保德信资产管理有限公司执行董事。

4、经公司十届五次董事会会议审议通过，自 2020 年 11 月 12 日起，翟昱磊正式担任公司首席市场总监。

5、2020 年 7 月，中国光大银行股份有限公司聘任李守靖先生担任资产托管部总经理职务。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 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。

### 11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金聘任安永华明会计师事务所为其审计的会计师事务所情况。报告年度应支付给安永华明会计师事务所的报酬是 9 万元整，目前该审计机构已提供审计服务的连续年限为 2 年。

### 11.7 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。

## 11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 交易单元数量 | 股票交易 |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|--------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
|        |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 中信建投证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 光大证券   | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |

注：（1）报告期内租用证券公司交易单元变更情况：无。

（2）选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

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

基本选择标准如下：

- 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币；
- 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- 经营行为规范，近两年未发生重大违规行为而受到证监会处罚；
- 内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求，并能为本基金提供全面的信息服务；
- 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务；
- 对于某一领域的研究实力超群，或是能够提供全方面，高质量的服务。

（3）选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

- 投资研究团队按照（2）中列出的有关经营情况、治理情况的选择标准，对备选的证券经营机构进行初步筛选；
- 对通过初选的各证券经营机构，投资研究团队各成员在其分管行业或领域的范围内，对该机构所提供的研究报告和信息资讯进行评分。
- 根据各成员评分，得出各证券经营机构的综合评分。



□投资研究团队根据各机构的得分排名，拟定要选用其专用交易单元的证券经营机构。

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

### 11.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 债券交易             |              | 回购交易              |              | 权证交易 |              |
|--------|------------------|--------------|-------------------|--------------|------|--------------|
|        | 成交金额             | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额              | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 中信建投证券 | -                | -            | -                 | -            | -    | -            |
| 光大证券   | 2,120,064,696.69 | 100.00%      | 13,936,000,000.00 | 100.00%      | -    | -            |

### 11.9 其他重大事件

| 序号 | 公告事项  | 法定披露方式                               | 法定披露日期     |
|----|---|--------------------------------------|------------|
| 1  | 光大保德信基金管理有限公司旗下基金 2019 年 12 月 31 日基金份额净值及累计净值公告 | 基金管理人公司网站、中国证监会基金电子披露网站及本基金选定的信息披露报纸 | 2020-01-01 |
| 2  | 光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金 2019 年第 4 季度报告       | 同上                                   | 2020-01-17 |
| 3  | 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 |
| 4  | 光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告           | 同上                                   | 2020-02-19 |
| 5  | 光大保德信基金管理有限公司关于曾小丽女士休生育假期间旗下基金管理安排的公告           | 同上                                   | 2020-02-21 |
| 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  | 光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书(更新)             | 同上                                   | 2020-04-08 |
| 8  | 光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书摘要(更新)           | 同上                                   | 2020-04-08 |
| 9  | 光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金 2020 年第 1 季度报告       | 同上                                   | 2020-04-22 |
| 10 | 光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金 2019 年年度报告           | 同上                                   | 2020-04-30 |
| 11 | 光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式                            | 同上                                   | 2020-05-26 |

|    |  |    |            |
|----|--|----|------------|
|    | 证券投资基金开放申购、赎回业务公告                              |    |            |
| 12 | 光大保德信基金管理有限公司旗下基金 2020 年 6 月 30 日基金份额净值及累计净值公告 | 同上 | 2020-07-01 |
| 13 | 光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金 2020 年第 2 季度报告      | 同上 | 2020-07-21 |
| 14 | 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 | 2020-07-24 |
| 15 | 光大保德信基金管理有限公司高级管理人员变更公告                        | 同上 | 2020-08-01 |
| 16 | 光大保德信基金管理有限公司关于调整公司高级管理人员在子公司兼职情况的公告           | 同上 | 2020-08-04 |
| 17 | 光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理变更公告             | 同上 | 2020-08-14 |
| 18 | 光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书(更新)            | 同上 | 2020-08-18 |
| 19 | 光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书摘要(更新)          | 同上 | 2020-08-18 |
| 20 | 光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金分红公告                 | 同上 | 2020-08-25 |
| 21 | 光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金 2020 年中期报告          | 同上 | 2020-08-31 |
| 22 | 光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金产品资料概要               | 同上 | 2020-08-31 |
| 23 | 光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告          | 同上 | 2020-09-02 |
| 24 | 光大保德信基金管理有限公司关于调整网上直销优惠费率的公告                   | 同上 | 2020-09-16 |
| 25 | 光大保德信基金管理有限公司关于网上直销系统暂停银联支付渠道认申购与定投业务的通知       | 同上 | 2020-09-28 |
| 26 | 光大保德信基金管理有限公司关于网上直销平台关闭农行网银直连支付的公告             | 同上 | 2020-10-22 |
| 27 | 光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金 2020 年第 3 季度报告      | 同上 | 2020-10-28 |
| 28 | 光大保德信基金管理有限公司关于终止大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告   | 同上 | 2020-10-30 |
| 29 | 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 | 2020-11-07 |
| 30 | 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 | 2020-11-14 |
| 31 | 关于养老金账户通过直销柜台申购(含转换转入)旗下所有基金产品费率优惠的公告          | 同上 | 2020-11-18 |
| 32 | 光大保德信基金管理有限公司关于网络系统                            | 同上 | 2020-11-20 |

|    |                                      |            |            |
|----|--------------------------------------|------------|------------|
|    | 改造升级的公告                              |            |            |
| 33 | 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         | 2020-11-24 |
| 34 | 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         | 2020-12-01 |
| 35 | 光大保德信尊享纯债定期开放债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告 | 同上         | 2020-12-09 |
| 36 | 中国光大银行“投资与托管业务部”名称变更为“资产托管部”         | 中国证监会规定的媒介 | 2020-04-15 |

## 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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              | 20200101-20201231      | 998,900,209.77 | 1,946,849,995.13 | 2,000,000,000.00 | 945,750,204.90 | 98.95% |
| 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> |                |                        |                |                  |                  |                |        |

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立光大保德信尊享纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的文件
- 2、光大保德信尊享纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同
- 3、光大保德信尊享纯债定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书
- 4、光大保德信尊享纯债定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议

- 5、光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金法律意见书
- 6、光大保德信基金管理有限公司的业务资格批件、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尊享丰纯债定期开放债券型发起式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

### 13.2 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。

### 13.3 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

二〇二一年三月三十一日