

光大保德信新机遇混合型证券投资基金

2021 年第 4 季度报告

2021 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年一月二十四日

§ 1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	光大保德信新机遇混合
基金主代码	010676
交易代码	010676
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 3 月 30 日
报告期末基金份额总额	399,055,017.82 份
投资目标	本基金将在控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将通过分析宏观经济基本面及证券市场双层面的数据进行研究，并通过定性定量分析、风险测算及组合优化，最终形成大类资产配置决策。具体包括以下几个方面：</p> <p>(1) 宏观经济运行的变化和国家的宏观调控政策将对证</p>

	<p>券市场产生深刻影响。本基金通过综合国内外宏观经济状况、国家财政政策、央行货币政策、物价水平变化趋势等因素，构建宏观经济分析平台；</p> <p>（2）运用历史数据并结合基金管理人内部的定性和定量分析模型，确定影响各类资产收益水平的先行指标，将上一步的宏观经济分析结果量化为对先行指标的影响，进而判断对各类资产收益的影响；</p> <p>（3）结合上述宏观经济对各类资产未来收益影响的分析结果和本基金投资组合的风险预算管理，确定各类资产的投资比重。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>“新机遇”是指根据宏观经济结构转型、产业结构变化、科技发展方向等，分析各行业所处发展阶段、产业竞争格局、发展趋势等因素，筛选未来有望受益程度较高或持续提升的行业，精选符合经济转型升级方向并具备良好发展潜力的公司，把握经济发展过程中所蕴涵的投资机遇。具体分为行业配置策略和个股选择策略：</p> <p>（1）行业配置策略</p> <p>本基金将通过自上而下的分析方式，寻找各行业在经济发展进程中的新机遇，具体包括以下几个方面：</p> <p>1) 定量分析</p> <p>利用行业的估值、业绩等多个方面指标进行分析，如行业相对估值水平（行业估值/市场估值）、行业相对利润增长率（行业利润增长率/市场利润增长率）、行业 PEG（行业估值/行业利润增长率）等。</p> <p>2) 定性分析</p> <p>从宏观经济运行特征、经济景气周期、行业周期轮动特征以及产业结构变化趋势等多个维度分析，同时结合行业自身的竞争格局、技术进步、政策条件等因素，把握不同行</p>
--	---

	<p>业的景气度变化情况和发展趋势，从而筛选未来有持续向好发展的行业。</p> <p>(2) 个股选择策略</p> <p>本基金将通过自下而上的研究方式，结合定性和定量分析，关注上市公司在不同行业周期和自身发展阶段下的新机遇，深入挖掘上市公司的投资价值，精选估值合理且成长性良好的上市公司进行投资。具体包括以下几个方面：</p> <p>1) 定量分析</p> <p>本基金结合与上市公司经营有关的重要定量指标，对上市公司的价值进行深入挖掘，为个股选择提供依据。具体的定量指标包括：</p> <p>盈利增长指标：公司是否具有较强的盈利能力，主要分析指标包括净资产收益率（ROE）、毛利率、净利率、盈利增长率（ΔE）等；</p> <p>成长指标：公司是否具有成长性，主要分析指标包括营业收入增长率、主营业务利润增长率、净利润增长率等；</p> <p>估值指标：公司估值水平是否合理，可供选择的估值方法包括市盈率法（P/E）、市净率法（P/B）、市盈率相对盈利增长比率（PEG）、自由现金流贴现模型（FCFF）或股利贴现模型（DDM）等；</p> <p>运营效率指标：公司是否具有较高的运营效率，主要分析指标包括总资产周转率、存货周转率、应收账款周转率等；</p> <p>财务结构指标：公司财务结构是否合理，主要分析指标包括资产负债率（D/A）、流动比率、速动比率等。</p> <p>2) 定性分析</p> <p>本基金认为股票价格的合理区间并非完全由其财务数据决定，还必须结合企业学习与创新能力、企业发展战略、技术专利优势、市场拓展能力、公司治理结构和管理水平、公司的行业地位、公司增长的可持续性 etc 定性因素，给予</p>
--	---

股票一定的折溢价水平，并最终决定股票合理的价格区间。根据上述定性定量分析的结果，本基金进一步从价值和成长两个纬度对备选股票进行评估。对于价值被低估且成长性良好的股票，本基金将重点关注；对于价值被高估但成长性良好，或价值被低估但成长性较差的股票，本基金将通过深入的调研和缜密的分析，有选择地进行投资；对于价值被高估且成长性较差的股票，本基金不予考虑投资。

（3）港股通标的股票投资策略

本基金关注互联互通机制下港股市场投资机会，将重点关注以下几个方面：

- 1) 基金管理人的研究团队重点覆盖的行业中，精选港股通中有代表性的行业龙头公司；
- 2) 具有行业稀缺性的香港本地和外资公司；
- 3) 与 A 股同类公司相比具有估值优势的公司。

3、债券投资策略

本基金密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率变动走势，自上而下地确定投资组合久期，并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合，配置能够提供稳定收益的债券品种。

4、证券公司短期公司债券投资策略

本基金将通过证券行业分析、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。

5、资产支持证券投资策略

资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提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

	<p>的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析,采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略,投资于资产支持证券。</p> <p>6、衍生品投资策略</p> <p>为更好地实现投资目标,本基金在注重风险管理的前提下,以套期保值为目的,适度运用股指期货、股票期权等金融衍生品。本基金利用金融衍生品合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点,提高投资组合的运作效率。</p> <p>本基金在进行股指期货投资时,将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其理估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。</p> <p>本基金将按照风险管理的原则,以套期保值为主要目的,参与股票期权的投资。本基金将在有效控制风险的前提下,选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资。本基金将基于对证券市场的预判,并结合股票期权定价模型,选择估值合理的期权合约。基金管理人将根据审慎原则,建立股票期权交易决策部门或小组,按照有关要求做好人员培训工作,确保投资、风控等核心岗位人员具备股票期权业务知识和相应的专业能力,同时授权特定的管理人员负责股票期权的投资审批事项,以防范期权投资的风险。</p> <p>7、其他品种投资策略</p> <p>法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,本基金若认为有助于基金进行风险管理和组合优化的,可依据法律法规的规定履行适当程序后,运用金融衍生产品进行投资风险管理。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>70%×沪深 300 指数收益率+10%×恒生指数收益率+20%×</p>

	中证全债指数收益率
风险收益特征	<p>本基金为混合型基金，其预期收益和预期风险高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。</p> <p>本基金还可投资港股通标的股票。除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期
	(2021 年 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日)
1. 本期已实现收益	43,000,378.70
2. 本期利润	83,294,623.45
3. 加权平均基金份额本期利润	0.2018
4. 期末基金资产净值	565,057,241.45
5. 期末基金份额净值	1.4160

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

3.2 基金净值表现

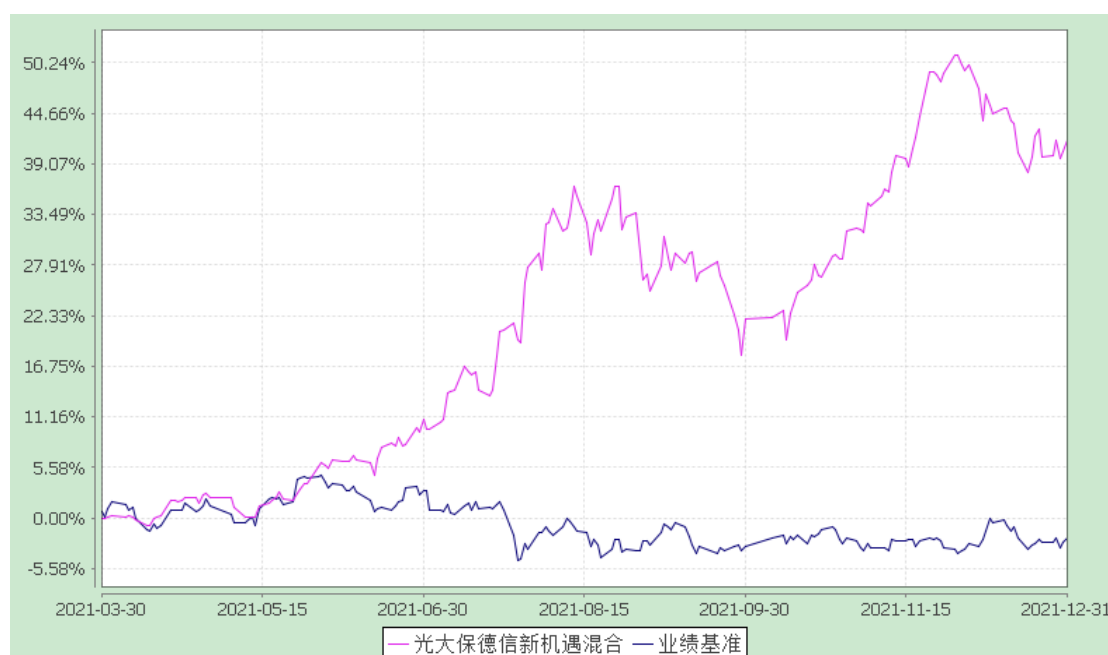
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长	净值增长	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	率①	率标准差 ②	基准收益 率③	基准收益 率标准差 ④		
过去三个月	16.12%	1.24%	0.89%	0.61%	15.23%	0.63%
过去六个月	27.64%	1.56%	-5.07%	0.80%	32.71%	0.76%
自基金合同 生效起至今	41.60%	1.33%	-2.25%	0.78%	43.85%	0.55%

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

光大保德信新机遇混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021 年 3 月 30 日至 2021 年 12 月 31 日)



注：根据基金合同的规定，本基金建仓期为2021年3月30日至2021年9月29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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
魏晓雪	权益管理总部股票研究团队队长、基金经理	2021-03-30	-	14 年	魏晓雪女士毕业于浙江大学金融学专业,2015 年获得复旦大学金融学的硕士学位。2006 年至 2009 年在鹏远(北京)管理咨询有限公司上海分公司(原凯基管理咨询)担任研究员;2009 年 10 月加入光大保德信基金管理有限公司,担任高级研究员,现任总经理助理、权益管理总部权益投资团队基金经理、股票研究团队团队长,2012 年 11 月至 2014 年 2 月担任光大保德信行业轮动混合型证券投资基金的基金经理,2013 年 2 月至今担任光大保德信新增长混合型证券投资基金的基金经理,2015 年 5 月至 2017 年 1 月担任光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金的基金经理,2020 年 3 月至今担任光大保德信研究精选混合型证券投资基金的基金经理,2020 年 4 月至 2021 年 7 月担任光大保德信消费主题股票型证券投资基金的基金经理,2020 年 5 月至今担任光大保德信中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2021 年 2 月至今担任光大保德信智能汽车主题股票型证券投资基金的基金经理,2021 年 3 月至今担任光大保德信新机遇混合型证券投资基金的基金经理,2021 年 9 月至今担任光大保德信睿盈混合型证券投资基金的基金经理。

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

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年第四季度，全球第五波疫情于 12 月全面回升，月度确诊创历史新高。Omicron 变种病毒在全球范围内广泛传播，引发各国防疫形势动荡。按照 WIND 数据显示，12 月全球周度日均新增病例分别录得 61.3 万、65.1 万、79.3 万、134.6 万例，最后一周数据较 11 月末回升 136%。2022 年 1 月 7 日，美国单日的确诊病例超过了 70 万例，创疫情爆发以来的历史新高。中国国内疫情总体平稳，区域确诊病例和疫情也在缓慢发生。

2021 年四季度，受到能源因素的约束、芯片紧缺、疫情反复及其他各种因素影响，经

济景气度继续下滑。PMI 全年整体震荡下行，工业企业利润增速前高后低，11 月工业企业利润单月同比增长 9%，是单月增速自 2020 年 6 月份以来首次降至个位数；以两年复合增速消除基数影响后，12.2%的增速也是今年 4 月份以来的最低点。地产销售继续低迷，虽然 12 月略微有好转，但地产产业链下行且对产业链整体预期继续传递。消费持续疲弱，汽车销售中新能源汽车的需求持续提升，传统车市场表现乏善可陈。固定资产投资累计两年平均增速略有回落，其中制造业有所加快，基建、地产放缓。由于需求走弱，PPI 见顶回落逐步确定，受猪价趋弱影响，CPI 继续低位运行。

展望 2022 年，我们认为经济或将会是逐步复苏的走势，PPI 于 2021 年四季度见顶，2022 年将持续回落，企业利润将从上游逐步向中下游转移。国家已明确强调“积极扩大有效投资”，“促进消费持续修复”，等“稳增长”相关的表述，也就意味着无论从政策面、财政面还是货币面，国家对于 2022 年的经济发展都是很重视的，对于资本市场的影响更是相对偏正面。综上所述，从基金管理者角度，我们认为，2022 年依然是权益投资布局的重要年份，A 股整体的性价比依然还在，我们再次建议基金持有人重视权益资产的配置。

2021 年四季度市场整体录得弱反弹，以中小综指和创业板综指为代表的成长股相对表现更好。期间中小板综指指数上涨了 8.65%，创业板指数上涨了 6.47%，以上证 50 为代表的大市值权重指数表现也不错，四季度略反弹了 2.42%。沪深 300、上证综指及科创 50 指数分别实现了 1.52%、2.%及 2.15%的收益率。

从行业分布来看，四季度表现最好的行业为传媒、军工及通信。其中，传媒行业更是实现了超过 22%以上的单季度涨幅。表现较弱的为以煤炭、石油石化及钢铁为代表的上游行业，这些行业均是三季度表现最好的板块之一，其中煤炭行业的季度跌幅在 12%以上。行业间的二级市场表现极致分化，且轮动非常剧烈是 2021 年资本市场的典型特征之一。

新机遇基金于 2021 年 3 月发行，当时正处于市场情绪的底点，募集结束后进行了快速建仓策略。封闭期的三个月中，侧重对个股的选择，挖掘了较多市场偏冷门的优秀公司，所以业绩表现较为优异。封闭期结束后，基金仓位迅速提升，经过四季度的努力，整体在 2021 年实现了超过 41%的收益率，但却没有重赌任何“热门赛道”，是基金经理及投研团队自下而上选股的优秀体现。

本基金四季度的操作中，虽然看到了市场风格的极致变化及切换，但基金经理的操作并没有受市场影响，各个产品依然维持了较为稳定的投资风格。新机遇基金的投资风格更为偏重自下而上选股，对持仓的均衡度较新增长基金较弱，重仓的集中度较新增长基金有所提升，因此，新机遇基金的投资表现在弹性上更为出众。四季度新机遇基金仓位上没有太多变化。

现持仓结构以消费为底仓，成长为主线，成长配置偏向于三大方向：以电动车为代表的未来汽车电动化&智能化趋势，以及涉及到出行应用的各个方面；伴随 5G、云计算、软件等科技的发展，对于工业端的应用和改造；以及已上升至国家战略的自主可控发展方向，以及中国制造向中国品牌的升级。在综合考虑了成长和估值间的匹配程度后，21 年四季度，我们的持仓上对价值股略有加仓。展望 2022 年，复杂的成本因素有望缓解，疫情也在逐步减轻中，优秀的企业会继续保持强竞争力，利润弹性有望恢复，整体我们重申对 2022 年的资本市场展望并不悲观。本基金在个股选择上始终坚持综合评估企业的盈利能力、成长性和估值水平。

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 16.12%，业绩比较基准收益率为 0.89%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	531,547,852.84	93.61
	其中：股票	531,547,852.84	93.61
2	固定收益投资	29,014,700.00	5.11
	其中：债券	29,014,700.00	5.11
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

6	银行存款和结算备付金合计	3,833,757.20	0.68
7	其他各项资产	3,422,037.77	0.60
8	合计	567,818,347.81	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	371,996,320.75	65.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,519.99	0.00
F	批发和零售业	77,533.82	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	29,651,600.00	5.25
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,083,818.75	2.32
J	金融业	75,678,000.00	13.39
K	房地产业	23,289,000.00	4.12
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	17,678,676.20	3.13
N	水利、环境和公共设施管理业	50,198.91	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	8,414.64	0.00
S	综合	-	-
	合计	531,547,852.84	94.07

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明

细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	603713	密尔克卫	220,000.00	29,651,600.00	5.25
2	000776	广发证券	1,200,000.00	29,508,000.00	5.22
3	002791	坚朗五金	160,000.00	29,054,400.00	5.14
4	002724	海洋王	1,700,000.00	27,795,000.00	4.92
5	603198	迎驾贡酒	400,000.00	27,780,000.00	4.92
6	300790	宇瞳光学	600,000.00	27,108,000.00	4.80
7	300054	鼎龙股份	1,100,000.00	26,774,000.00	4.74
8	600030	中信证券	1,000,000.00	26,410,000.00	4.67
9	688155	先惠技术	220,000.00	25,080,000.00	4.44
10	603960	克来机电	660,000.00	24,010,800.00	4.25

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	19,005,700.00	3.36
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,009,000.00	1.77
	其中：政策性金融债	10,009,000.00	1.77
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	29,014,700.00	5.13

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019654	21 国债 06	190,000	19,005,700.00	3.36
2	210301	21 进出 01	100,000	10,009,000.00	1.77

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

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

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

行。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金所投资的中信证券（600030）的发行主体中信证券股份有限公司于 2021 年 02 月 10 日收到深圳证监局的行政监管措施、于 2021 年 11 月 19 日收到深圳交易所出局的监管函，主要内容为：

行政监管措施：一、私募基金托管业务内部控制不够完善，个别项目履职不谨慎；二、个别首次公开发行保荐项目执业质量不高；三、公司个别资管产品未根据合同约定的时间和方式向客户提供对账单。处罚结果：采取责令改正的监督管理措施。

监管函：履行保荐职责不到位，内部控制存在一定的薄弱环节。处罚结果：采取书面警示的监管措施。

基金管理人按照内部研究工作规范对该股票进行分析后将其列入基金投资对象备选库并跟踪研究。该监管函发生后，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，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情况。

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

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	138,705.74

2	应收证券清算款	2,236,804.25
3	应收股利	-
4	应收利息	523,888.93
5	应收申购款	522,638.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,422,037.77

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期初基金份额总额	446,352,323.56
报告期期间基金总申购份额	150,538,280.59
减：报告期期间基金总赎回份额	197,835,586.33
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	399,055,017.82

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期内基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在持有、申购、赎回或买卖本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期不存在单一投资者持有基金份额比例超过20%的情形。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

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

9.2 存放地点

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

9.3 查阅方式

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

光大保德信基金管理有限公司

二〇二二年一月二十四日