

光大保德信消费主题股票型证券投资基金

2022 年第 1 季度报告

2022 年 3 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：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年四月二十二日

§ 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 4 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 2022 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	光大保德信消费股票
基金主代码	008234
交易代码	008234
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 4 月 23 日
报告期末基金份额总额	177,037,464.20 份
投资目标	本基金将在充分控制风险的前提下，通过把握消费主题股票的投资机会，力争实现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>

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；

（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；

（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。

2、股票投资策略

（1）消费主题的界定

本基金所界定的消费主题股票主要包括：

1）申万一级行业分类中的食品饮料、家用电器、纺织服装、商业贸易、农林牧渔、医药生物、轻工制造、休闲服务、传媒、汽车等行业的上市公司；

2）港交所一级行业分类中的消费品制造业、消费者服务业等行业的上市公司；

本基金将对消费主题相关行业及上市公司进行密切跟踪，随着经济增长及产业转型的进一步发展变化，消费行业的外延将可能会不断扩大，相关上市公司的范围也会相应改变。在履行适当必要的程序后，本基金将根据实际情况调整消费主题的界定标准。

（2）个股选择策略

本基金将通过自下而上研究入库的方式，对以上各个行业中涉及消费主题的上市公司进行深入研究，挖掘企业的投资价值，并将这些股票组成本基金的核心股票库。在核心股票库的基础上，本基金以定性和定量相结合的方式、从价值和成长等因素对个股进行选择，综合考虑上市公司的

	<p>增长潜力与市场估值水平，精选估值合理且成长性良好的上市公司进行投资。具体包括以下几个方面：</p> <p>1) 定量分析</p> <p>本基金结合盈利增长指标、现金流量指标、负债比率指标、估值指标、盈利质量指标等与上市公司经营有关的重要定量指标，对目标上市公司的价值进行深入挖掘，并对上市公司的盈利能力、财务质量和经营效率进行评析，为个股选择提供依据。</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。</p> <p>(3) 港股通标的股票投资策略</p> <p>本基金将通过上述自下而上研究入库的个股投资策略，着重考察并优选香港联合交易所上市的股票中消费主题相关的投资标的，力求对 A 股市场投资进行有效补充。本基金将仅通过港股通投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度进行境外投资。</p> <p>(4) 存托凭证的投资策略</p> <p>本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股</p>
--	---

<p>票投资策略执行。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>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。</p> <p>4、证券公司短期公司债券投资策略</p> <p>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。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产支持证券。</p> <p>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>
业绩比较基准	<p>中证内地消费主题指数收益率×80%+中证全债指数收益率×10%+中证港股通主要消费综合指数收益率×5%+中证港股通可选消费综合指数收益率×5%。</p>
风险收益特征	<p>本基金为股票型基金，其预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。</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	中国民生银行股份有限公司

§ 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
	(2022 年 1 月 1 日-2022 年 3 月 31 日)
1. 本期已实现收益	-2,378,413.11
2. 本期利润	-62,140,691.85
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.3451
4. 期末基金资产净值	226,192,165.04
5. 期末基金份额净值	1.2777

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。

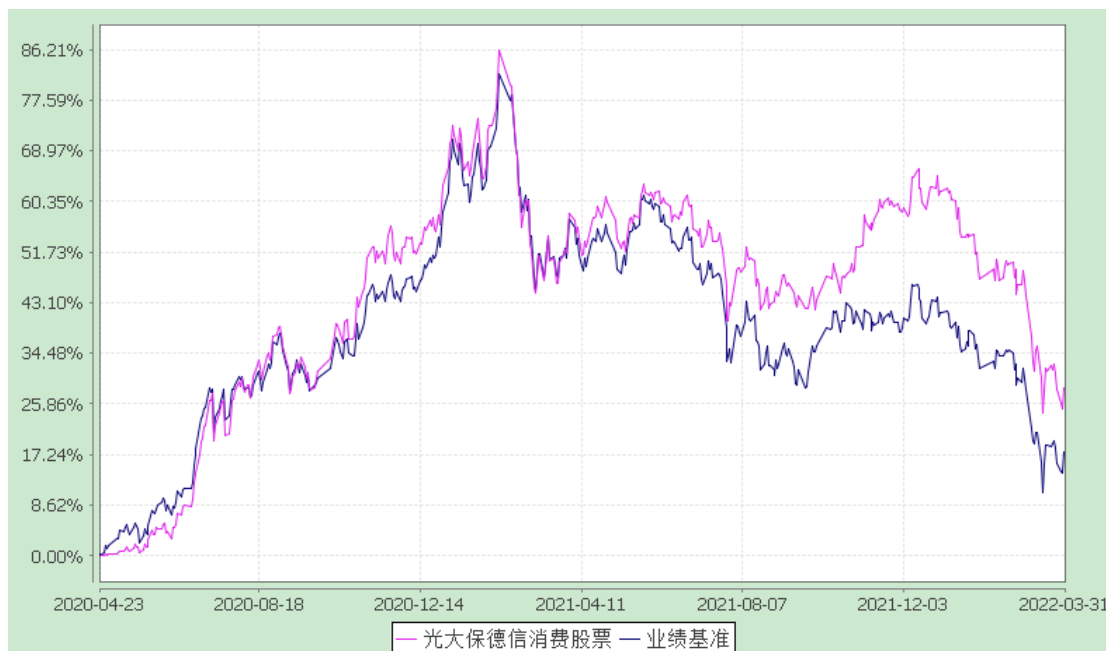
3.2 基金净值表现

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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-21.19%	1.65%	-17.44%	1.64%	-3.75%	0.01%
过去六个月	-10.94%	1.41%	-14.05%	1.38%	3.11%	0.03%
过去一年	-15.77%	1.33%	-22.59%	1.38%	6.82%	-0.05%
自基金合同生效起至今	27.77%	1.46%	16.71%	1.42%	11.06%	0.04%

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

光大保德信消费主题股票型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020 年 4 月 23 日至 2022 年 3 月 31 日)



§ 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		
马鹏飞	基金经理	2020-04-24	-	10 年	马鹏飞先生，浙江大学食品科学专业硕士。曾任浙江康恩贝健康产品有限公司研发工程师和项目经理，浙江核新同花顺网络信息股份有限公司项目经理；2012 年 1 月至 2013 年 11 月在浙江同花顺投资咨询有限公司担任行业研究员；2013 年 12 月至 2017 年 5 月在财通证券股份有限公司担任行业研究员；2017 年 5 月加入光大保德信基金管理有限公司，担任高级研究员。2020 年 4 月至今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 6 月至 2021 年 8 月担任光大保德信瑞和混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 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

2022 年 1-2 月，受春节旺季及疫情回落因素影响，国内消费恢复情况较好，但 3 月以来，多地再次出现较严重的奥密克戎疫情，消费复苏承压。2022 年 1-2 月，我国社零总额为 74426 亿元，同比增长 6.7%。分渠道看：线上方面，受“网上年货节”等促销活动带动，

1-2 月实物商品网上零售额 16371 亿元 (YOY+12.3%)；线下方面，实体店铺经营亦有改善，超市、便利店、百货店、专业店和专卖店零售额同比分别增长 3.0%/12.8%/2.1%/10.3%/5.3%。分品类看：必选品类整体保持稳健增长；可选品类中，金银珠宝同比 19.5%，春节旺季行业终端销售呈现较高景气；服务消费方面，1-2 月餐饮收入为 7718 亿元 (8.9%)，恢复良好。整体看，在春节和冬奥等因素推动下，1-2 月社会消费呈现出一定韧性。但考虑到 3 月疫情，社零增速可能短期明显回落，后续需要“稳字当头”的相关措施进一步发挥稳经济、保主体、保就业作用。

回顾一季度，中证内地消费指数下跌 19.35%，按照申万行业各细分消费赛道的表现看，呈现出了不同程度下跌，其中跌幅相对小的行业是农林牧渔行业，-0.66%；社会服务行业，-8.19%；商贸零售行业-10.16%；跌幅相对较大的行业是汽车-20.65%；家用电器-19.79%；食品饮料-19.27%。

一季度消费板块在多方面的因素影响下出现了大幅下跌，包括外资的变动、俄乌冲突、稳增长节奏、国内疫情的变化等因素。消费板块的大幅下跌超出了我的预期，市场更愿意用周期股的维度或者成长股的思维模式交易消费板块，品牌价值等消费品核心因素在短期市场定价中没有体现，这是超我预期的地方。

一季度仓位也没有大调整，整体持仓没有做大的调整。止盈了生猪养殖板块，增配了经济复苏相关的次高端白酒。止盈生猪养殖板块的原因在于估值性价比以及周期来临时间的匹配度不佳，结果是短期在通胀预期下板块的相对受益非常明显。增配了次高端白酒，主要还是对消费的信心以及经济复苏比较有信念，估值性价比尚可。

市场既然已经有所调整，前期没有预期的因素已经有所发生和交易，我认为现在需要更加乐观，除非负面的因素导致企业竞争力和品牌价值锐减。换个维度思考，也可以认为顺周期的品种具备估值性价比、竞争力强的企业具备未来业绩确定性。

二季度，消费主题基金会观察持仓公司的竞争力变化，等待预期的扭转，结构方面会对行业业绩预期、估值以及品牌影响力进行均衡配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内净值增长率为-21.19%，业绩比较基准收益率为-17.44%，

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	207,319,811.38	90.86
	其中：股票	207,319,811.38	90.86
2	固定收益投资	12,635,625.13	5.54
	其中：债券	12,635,625.13	5.54
	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	7,988,884.32	3.50
7	其他各项资产	230,108.75	0.10
8	合计	228,174,429.58	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为人民币8183496.41元，占期末净值比例3.62%。

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	12,618,318.00	5.58
B	采矿业	-	-
C	制造业	173,992,441.36	76.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	7,110.12	0.00
F	批发和零售业	40,440.63	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	173,881.22	0.08
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	12,116,654.34	5.36
M	科学研究和技术服务业	167,298.01	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	11,447.05	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	8,724.24	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	199,136,314.97	88.04

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
日常消费品	8,183,496.41	3.62
合计	8,183,496.41	3.62

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	600600	青岛啤酒	183,800.00	14,522,038.00	6.42
2	000858	五粮液	92,300.00	14,312,038.00	6.33
3	002304	洋河股份	105,500.00	14,308,965.00	6.33
4	603317	天味食品	734,621.00	13,171,754.53	5.82
5	000998	隆平高科	651,100.00	12,618,318.00	5.58
6	300662	科锐国际	260,700.00	12,109,515.00	5.35

7	000333	美的集团	207,600.00	11,833,200.00	5.23
8	600702	舍得酒业	72,000.00	11,440,800.00	5.06
9	603187	海容冷链	344,341.00	10,426,645.48	4.61
10	600690	海尔智家	403,400.00	9,318,540.00	4.12

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	2,433,994.99	1.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,201,630.14	4.51
	其中：政策性金融债	10,201,630.14	4.51
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	12,635,625.13	5.59

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	200302	20 进出 02	100,000	10,201,630.14	4.51
2	019641	20 国债 11	23,900	2,433,994.99	1.08

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

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

5.10 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

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

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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 20 进出 02(200302)中国进出口银行于 2021 年 7 月 16 日收到中国银行保险监督管理委员会出具的处罚（银保监罚决字(2021)31 号）、2022 年 3 月 25 日中国银行保险监督管理委员会出具的银保监罚决字(2022)9 号，主要内容为：银保监罚决字(2021)31 号：一、违规投资企业股权；二、个别高管人员未经核准实际履职；三、监管数据漏报错报；四、违规向地方政府购买服务提供融资；五、违规变相发放土地储备贷款；六、向用地未获国务院批准的项目发放贷款；

七、违规开展租金保理业务变相支持地方政府举债；八、租金保理业务基础交易不真实；九、向租赁公司发放用途不合规的流动资金贷款；十、违规向个别医疗机构新增融资；十一、个别并购贷款金额占比超出监管上限；十二、借并购贷款之名违规发放股权收购贷款；十三、违规向未取得“四证”的固定资产项目发放贷款；十四、违规发放流动资金贷款用于固定资产投资；十五、授信额度核定不审慎；十六、向无实际用款需求的企业发放贷款导致损失；十七、突破产能过剩行业限额要求授信；十八、项目贷款未按规定设定抵质押担保；十九、贷款风险分类不审慎；二十、信贷资产买断业务贷前调查不尽职；二十一、向借款人转嫁评估费用；二十二、同业业务交易对手名单制管理落实不到位；二十三、贸易背景审查不审慎；二十四、对以往监管通报问题整改不到位。处罚结果为：罚没 7345.6 万元。

银保监罚决字(2022)9 号：一、漏报不良贷款余额 EAST 数据；二、漏报逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据；三、漏报贸易融资业务 EAST 数据；四、漏报贷款核销业务 EAST 数据；五、漏报抵押物价值 EAST 数据；六、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据；七、漏报债券投资业务 EAST 数据；八、漏报权益类投资业务 EAST 数据；九、漏报投资资产管理产品业务 EAST 数据；十、漏报跟单信用证业务 EAST 数据；十一、漏报贷款承诺业务 EAST 数据；十二、未报送委托贷款业务 EAST 数据；十三、EAST 系统分户账与总账比对不一致；十四、漏报分户账 EAST 数据；十五、EAST 系统《对公活期存款分户账明细记录》表错报；十六、EAST 系统《关联关系》表漏报；十七、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报。处罚结果：罚款 420 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。该处罚事件发生后，基金管理人密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

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

5.11.2 本基金未投资超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)

1	存出保证金	224,499.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,609.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	230,108.75

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

本报告期期初基金份额总额	170,837,202.46
报告期期间基金总申购份额	14,870,619.02
减：报告期期间基金总赎回份额	8,670,357.28
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	177,037,464.20

§ 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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,004,850.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,004,850.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	5.65

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消费主题股票型证券投资基金注册的文件
- 2、光大保德信消费主题股票型证券投资基金基金合同
- 3、光大保德信消费主题股票型证券投资基金招募说明书
- 4、光大保德信消费主题股票型证券投资基金托管协议
- 5、光大保德信消费主题股票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消费主题股票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

二〇二二年四月二十二日