

# 光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金

## 2023 年中期报告

### 2023 年 6 月 30 日

基金管理人：光大保德信基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十一日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>4 管理人报告</b> .....	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
<b>5 托管人报告</b> .....	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
<b>6 中期财务会计报告（未经审计）</b> .....	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	21
<b>7 投资组合报告</b> .....	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	43
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	43
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	43
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12 投资组合报告附注.....	44
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45

8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	45
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	46
<b>9</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>46</b>
<b>10</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>46</b>
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	46
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	46
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	46
10.4	基金投资策略的改变 .....	46
10.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	46
10.6	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	46
10.7	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	47
10.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	47
10.9	其他重大事件 .....	49
<b>11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>49</b>
<b>12</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>49</b>
12.1	备查文件目录 .....	49
12.2	存放地点 .....	50
12.3	查阅方式 .....	50

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金		
基金简称	光大保德信岁末红利纯债债券		
基金主代码	000489		
交易代码	000489		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014 年 8 月 12 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		
报告期末基金份额总额	6,640,071.86 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	光大保德信岁末红利纯债债券 A	光大保德信岁末红利纯债债券 C	光大保德信岁末红利纯债债券 D
下属分级基金的交易代码	000489	000490	016095
报告期末下属分级基金的份额总额	3,970,637.23 份	2,669,434.63 份	-份

### 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、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</p>

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。

#### 4、信用债投资策略

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。

##### （1）市场整体信用利差曲线策略

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。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。

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。

##### （2）单个信用债信用分析策略

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。

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：

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。

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。

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。

#### 5、杠杆投资策略

在本基金的日常投资中，还将充分利用组合的回购杠杆操作，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杠杆投资策略。

#### 6、国债期货投资策略

	基金管理人可运用国债期货，以提高投资效率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。
业绩比较基准	中证全债指数。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		光大保德信基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高顺平	王小飞
	联系电话	(021) 80262888	021-60637103
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		4008-202-888	021-60637228
传真		(021) 80262468	021-60635778
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	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢（北区3号楼），6-7层、10层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200010	100033
法定代表人		刘翔	田国立

### 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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.epf.com.cn
基金中期报告备置地点	光大保德信基金管理有限公司、中国建设银行股份有限公司的办公场所。

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	光大保德信基金管理有限公司	上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢（北区 3 号楼），6-7 层、10 层

### 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）		
	光大保德信岁末红利纯债债券 A	光大保德信岁末红利纯债债券 C	光大保德信岁末红利纯债债券 D
本期已实现收益	32,338.66	22,210.59	-
本期利润	44,075.76	18,852.09	-
加权平均基金份额本期利润	0.0096	0.0017	-
本期加权平均净值利润率	0.91%	0.16%	-
本期基金份额净值增长率	1.02%	0.84%	-
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)		
	光大保德信岁末红利纯债债券 A	光大保德信岁末红利纯债债券 C	光大保德信岁末红利纯债债券 D
期末可供分配利润	41,150.57	20,416.00	-
期末可供分配基金份额利润	0.0104	0.0076	-
期末基金资产净值	4,251,161.26	2,850,957.93	0.00
期末基金份额净值	1.0706	1.0680	1.0706
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)		
	光大保德信岁末红利纯债债券 A	光大保德信岁末红利纯债债券 C	光大保德信岁末红利纯债债券 D
基金份额累计净值增长率	33.45%	29.01%	-

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）2022 年 6 月 24 日新增 D 类份额，截至报告出具日该份额暂无申购

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

光大保德信岁末红利纯债债券 A

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----



	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去一个月	0.19%	0.04%	0.55%	0.06%	-0.36%	-0.02%
过去三个月	0.78%	0.03%	1.98%	0.05%	-1.20%	-0.02%
过去六个月	1.02%	0.04%	2.98%	0.05%	-1.96%	-0.01%
过去一年	2.16%	0.06%	4.58%	0.06%	-2.42%	0.00%
过去三年	4.80%	0.06%	13.17%	0.06%	-8.37%	0.00%
自基金合同生 效起至今	33.45%	0.08%	53.61%	0.08%	-20.16%	0.00%

光大保德信岁末红利纯债债券 C

阶段	份额净值增 长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.16%	0.04%	0.55%	0.06%	-0.39%	-0.02%
过去三个月	0.69%	0.03%	1.98%	0.05%	-1.29%	-0.02%
过去六个月	0.84%	0.04%	2.98%	0.05%	-2.14%	-0.01%
过去一年	1.86%	0.06%	4.58%	0.06%	-2.72%	0.00%
过去三年	3.81%	0.06%	13.17%	0.06%	-9.36%	0.00%
自基金合同生 效起至今	29.01%	0.08%	53.61%	0.08%	-24.60%	0.00%

光大保德信岁末红利纯债债券 D

自 2022 年 6 月 24 日新增 D 类份额，截至本报告出具之日 D 类基金份额暂无申购

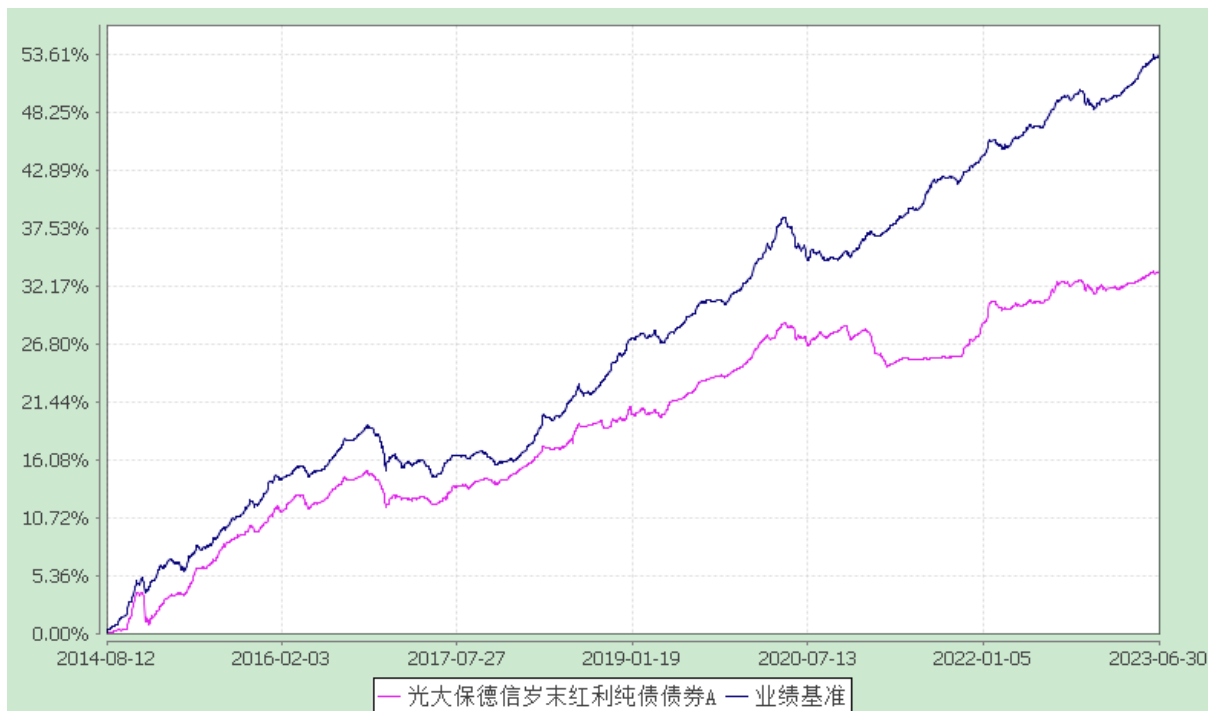
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金

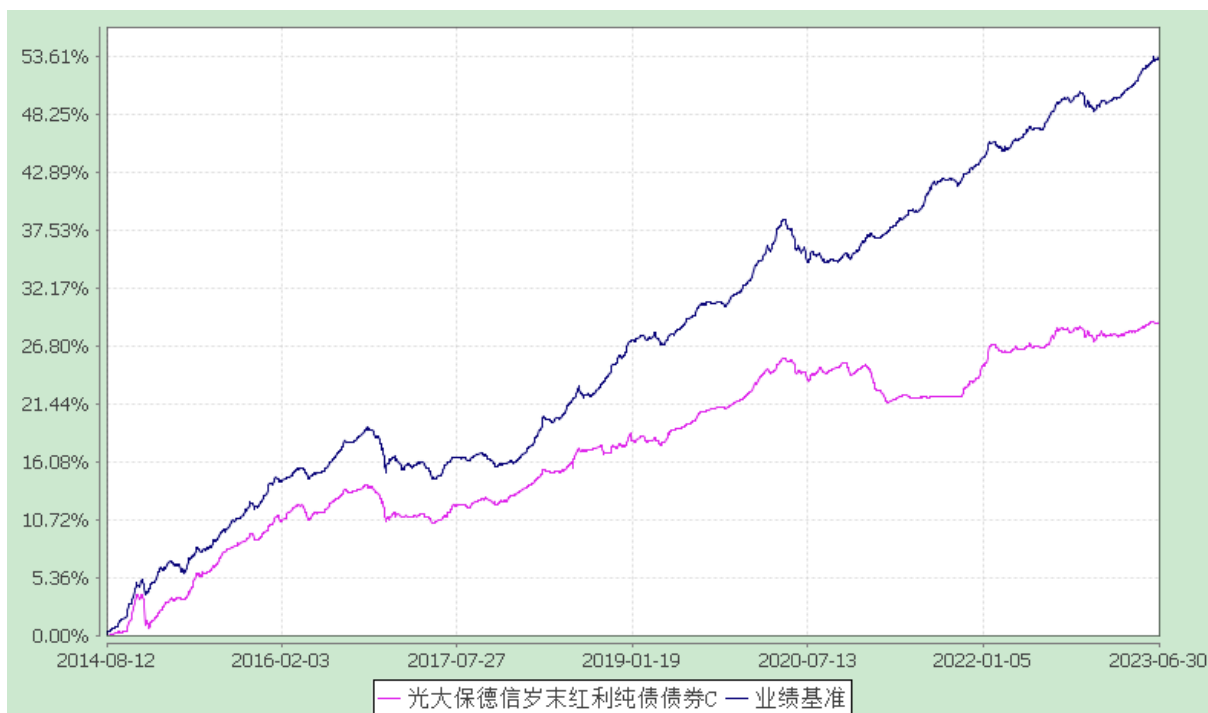
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014 年 8 月 12 日至 2023 年 6 月 30 日)

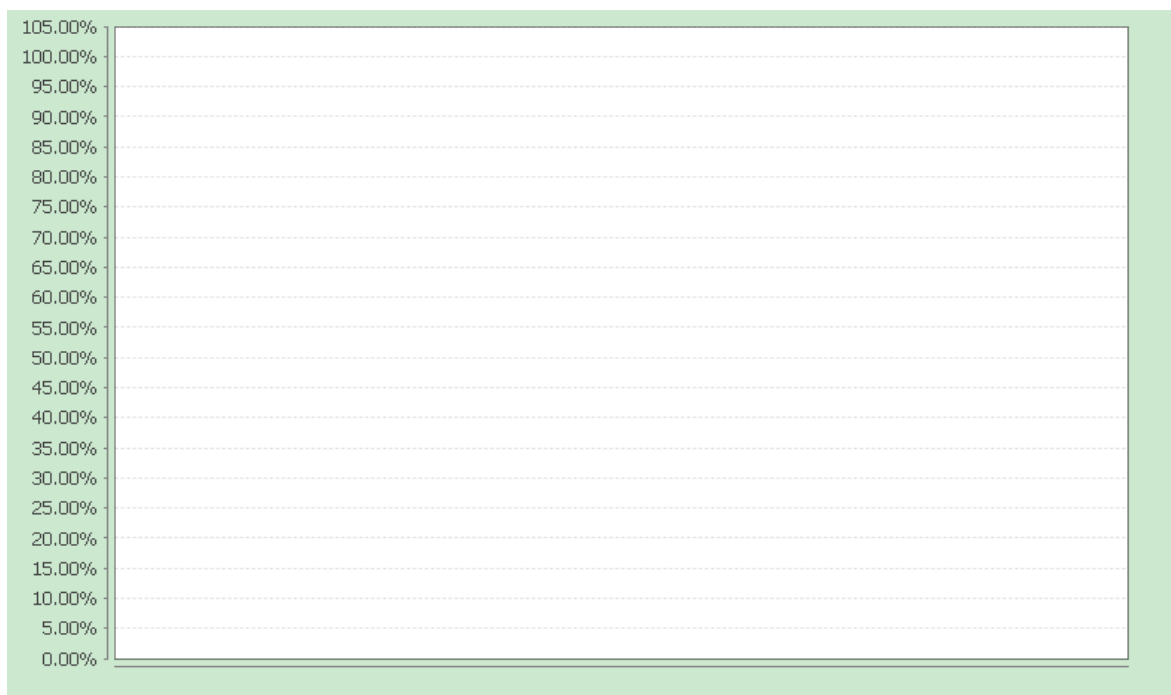
光大保德信岁末红利纯债债券 A



光大保德信岁末红利纯债债券 C



光大保德信岁末红利纯债债券 D



注：2022 年 6 月 24 日新增 D 类份额，截至报告出具日期该份额暂无申购

注：根据基金合同的规定，本基金建仓期为 2014 年 8 月 12 日至 2015 年 2 月 11 日。建仓期结束本基金各项资产配置比例应符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

光大保德信基金管理有限公司（以下简称“光大保德信”）成立于 2004 年 4 月，由中国光大集团控股的光大证券股份有限公司和美国保德信金融集团旗下的保德信投资管理有限公司共同创建，公司总部设在上海，注册资本为人民币 1.6 亿元人民币，两家股东分别持有 55% 和 45% 的股份。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务（涉及行政许可的凭许可证经营），今后，将在法律法规允许的范围内为各类投资者提供更多资产管理服务。

截至 2023 年 6 月 30 日，光大保德信旗下管理着 71 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、光大保德信诚鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信安祺债券型证券投资基金、光大保德信安和债券型证券投资基金、光大保德信事件驱动灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信永利纯债债券型证券投资基金、光大保德信安诚债券型证券投资基金、光大保德信多策略智选 18 个月定期开放混合型证券投资基金、光大保德信尊盈半年定期开放债券型发起式证券投资基金、光大保德信中高等级债券型证券投资基金、光大保德信先进服务业灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信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、光大保德信智能汽车主题股票型证券投资基金、光大保德信锦弘混合型证券投资基金、光大保德信新机遇混合型证券投资基金、光大保德信安阳一年持有期混合型证券投资基金、光大保德信品质生活混合型证券投资基金、光大保德信健康优加混合型证券投资基金、光大保德信睿盈混合型证券投资基金、光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金、光大保德信创新生活混合型证券投资基金、光大保德信纯债债券型证券投资基金、光大保德信恒鑫混合型证券投资基金、光大保德信核心资产混合型证券投资基金、光大保德信尊利纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、光大保德信汇佳混合型证券投资基金、光大保德信尊颐纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、光大保德信高端装备混合型证券投资基金、光大保德信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、光大保德信荣利纯债债券型证券投资基金、光大保德信专精特新混合型证券投资基金、光大保德信睿阳纯债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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李怀定	固收管理总部 固收研究团队 联席团队长、 基金经理	2021-09-25	-	16 年	李怀定先生, 复旦大学经济学博士学位。2007 年 7 月至 2007 年 11 月任职华泰证券股份有限公司固定收益部; 2007 年 11 月至 2009 年 7 月在光大证券股份有限公司担任债券分析师; 2009 年 7 月至 2012 年 5 月在国信证券股份有限公司担任经济研究所高级分析师; 2012 年 5 月至 2018 年 8 月在汇添富基金管理股份有限公司历任固定收益投资部高级分析师、债券基金经理助理、债券基金经理; 2018 年 8 月至 2021 年 5 月在长江养老保险股份有限公司担任养老保障投资部/个人养老金投资部固收投资经理; 2021 年 6 月加入光大保德信基金管理有限公司, 现任固收管理总部固收研究团队联席团队长, 2021 年 7 月至今担任光大保德信恒利纯债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、光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2021 年 7 月至 2023 年 4 月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, 2021 年 9 月至今担任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, 2021 年 11 月至今担任光大保德信纯债债券型证券投资基金的基金经理, 2021 年 12 月至 2023 年 3 月担任光大保德信裕鑫混合型证券投资基金(已清盘)的基金经理, 2022 年 9 月至今担任光大保德信尊颐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, 2023 年 6 月至今担任光大保德信睿阳

					纯债债券型证券投资基金的基金经理，2023 年 7 月至今担任光大保德信荣利纯债债券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。

#### 4.1.3 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

无

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年宏观经济运行整体回升向好，市场需求逐步恢复，生产供给持续增加。但市场年初对于经济基本面过于乐观的预期在二季度有所修正，股债汇市场上半年走势较明显反映了这一宏观预期的调整。二季度尽管生产需求恢复的强度有所分化，但物价基本稳定，因为低基数原因，二季度经济增长同比或将达到年内较高水平。上半年，六家国有大行在二季度末集体下调存款利率，期间央行也分别小幅下调了 OMO 利率和 MLF、LPR 利率。

债券市场方面，在信贷需求乏力、机构配置压力较大以及去年末债市调整后估值优势较明显等多重因素叠加下，上半年债券市场表现较好。分品种看，上半年信用债整体表现明显好于利率债，但随着 6 月央行降息，上半年后期利率债表现一度好于信用债。估值上，上半年利率债短端下行幅度普遍在 15-20bp，10 年长端普遍下行 30-35BP；信用债方面，普通信用债 3 年以内的普遍下行 60-80BP，但资质相对偏弱的下行幅度相对更大些。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内光大保德信岁末红利纯债债券 A 份额净值增长率为 1.02%，业绩比较基准收益率为 2.98%；光大保德信岁末红利纯债债券 C 份额净值增长率为 0.84%，业绩比较基准收益率为 2.98%；自 2022 年 6 月 24 日新增 D 类基金份额，截至本报告出具之日 D 类基金份额暂无申购

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，近期政治局会议政策增量表述超出预期，市场较为关注“适时调整优化房地产政策”、“活跃资本市场”等具体落地实施情况，但在高质量发展这一重要主题下，预计货币政策仍将继续为经济护航，信用需求端政策尽管近期陆续出台，但可能仍较难实现粗放式发力，精准的结构性的政策仍然会是主要方向。我们对基本面的判断偏窄幅震荡，经济强势上行取决于政策支持等多方面因素，但随着年内价格和库存等指标的好转，需求端或有望更好的跟进生产端的复苏。

就债券市场而言，目前宏观和货币环境对债市仍然偏利好，尽管经济刺激预期抬升，但经济增速情况的完全扭转仍需一定时间验证，当前利率债收益率较低，下半年债券收益率继续下行空间可能较为有限，或将维持窄幅震荡格局。

操作方面，受制于组合规模较小，操作方面以利率债为主，且以流动性管理为主，持仓结构随着组合申赎发生微调。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

报告期内，公司设立由负责运营的高管、运营部代表（包括基金会计）、投研部门代表、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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内出现了连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况，该情况自 2022 年 12 月 8 日起出现。本基金本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。本报告期内，本基金存在连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。针对该情形，本基金管理人已向中国证监会报告了解决方案。

## 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履



行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

托管人复核审查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。

## 6 中期财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,386,023.37	5,049,013.58
结算备付金		46,697.60	293,942.45
存出保证金		2,258.93	1,353.43
交易性金融资产	6.4.7.2	7,474,980.73	46,253,660.81
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		7,474,980.73	46,253,660.81
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		100.00	7,934,079.03
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		8,910,060.63	59,532,049.30
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		599,438.91	7,602,236.14
应付清算款		1,000,841.64	1,007,071.66
应付赎回款		142,691.12	3,508,165.97
应付管理人报酬	6.4.10.2	1,910.28	12,450.99
应付托管费	6.4.10.2	636.78	4,150.35
应付销售服务费		1,101.70	14,356.97
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1.01	850.85
应付利润		-	594,224.82
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	61,320.00	103,427.50
负债合计		1,807,941.44	12,846,935.25
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	6,640,071.86	44,075,835.03
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	462,047.33	2,609,279.02
净资产合计		7,102,119.19	46,685,114.05
负债和净资产总计		8,910,060.63	59,532,049.30

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 6,640,071.86 份，其中 A 类基金份额总额为 3,970,637.23 份，基金份额净值为 1.0706 元；C 类基金份额总额为 2,669,434.63 份，基金份额净值为 1.0680 元。

## 6.2 利润表

会计主体：光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		184,071.37	118,703.62
1.利息收入		3,081.21	6,126.78
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,109.16	5,816.37
债券利息收入		-	-

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		972.05	310.41
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
<b>2.投资收益（损失以“-”填列）</b>		<b>163,721.40</b>	<b>126,101.64</b>
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	163,721.40	126,101.64
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
<b>3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）</b>	<b>6.4.7.17</b>	<b>8,378.60</b>	<b>-25,825.73</b>
<b>4.汇兑收益（损失以“-”号填列）</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>5.其他收入（损失以“-”号填列）</b>	<b>6.4.7.18</b>	<b>8,890.16</b>	<b>12,300.93</b>
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>121,143.52</b>	<b>117,876.40</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2	25,021.90	22,438.99
2. 托管费	6.4.10.2	8,340.63	7,479.70
3. 销售服务费	6.4.10.2	23,678.28	16,743.58
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		35,463.22	31,301.27
其中：卖出回购金融资产支出		35,463.22	31,301.27
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		40.67	1.12
8. 其他费用	6.4.7.20	28,598.82	39,911.74
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>62,927.85</b>	<b>827.22</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>62,927.85</b>	<b>827.22</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>62,927.85</b>	<b>827.22</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合	未分配利润	净资产合计

		收益（若有）		
一、上期期末净资产（基金净值）	44,075,835.03	-	2,609,279.02	46,685,114.05
二、本期期初净资产（基金净值）	44,075,835.03	-	2,609,279.02	46,685,114.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-37,435,763.17	-	-2,147,231.69	-39,582,994.86
（一）、综合收益总额	-	-	62,927.85	62,927.85
（二）、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）	-37,435,763.17	-	-2,210,159.54	-39,645,922.71
其中：1.基金申购款	21,398,504.68	-	1,263,687.87	22,662,192.55
2.基金赎回款	-58,834,267.85	-	-3,473,847.41	-62,308,115.26
（三）、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）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	6,640,071.86	-	462,047.33	7,102,119.19
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	6,389,478.32	-	308,953.57	6,698,431.89
二、本期期初净资产（基金净值）	6,389,478.32	-	308,953.57	6,698,431.89
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,618,216.85	-	214,031.92	1,832,248.77
（一）、综合收益总额	-	-	827.22	827.22
（二）、本期基金	1,618,216.85	-	213,204.70	1,831,421.55

份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				
其中：1.基金申购款	40,944,310.50	-	2,572,046.04	43,516,356.54
2.基金赎回款	-39,326,093.65	-	-2,358,841.34	-41,684,934.99
（三）、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）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	8,007,695.17	-	522,985.49	8,530,680.66

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘翔，主管会计工作负责人：贺敬哲，会计机构负责人：王永万

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]1526号《关于核准光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金募集的批复》注册，由光大保德信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,368,912,481.50 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第 449 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2014 年 8 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,369,066,125.59 份，其中认购资金利息折合 153,644.09 份基金份额。本基金的基金管理人为光大保德信基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购费、申购费和销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。根据《关于光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金增设 D 类基金份额并修改基金合同的公告》以及更新的《光大保德信岁末红利

纯债债券型证券投资基金招募说明书》，自 2022 年 6 月 24 日起，本基金增设 D 类基金份额。在投资者认购/申购时收取前端认购费或申购费的，称为 A 类基金份额；不收取前后端认购费或申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额；在投资者申购时按每笔交易收取固定金额申购费的，称为 D 类基金份额。A 类、C 类和 D 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告三类基金份额净值和三类基金份额累计净值。投资者可自行选择认购或申购基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、中央银行票据、中期票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、债券回购、次级债、资产支持证券、可分离交易可转换公司债券的纯债部分、银行存款、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场的新股申购或增发新股，可转债仅投资可分离交易可转债的纯债部分。本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，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，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为中证全债指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月

1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	1,386,023.37
等于：本金	1,385,915.69
加：应计利息	107.68
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	1,386,023.37

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	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	4,917,590.00	58,147.62	4,975,017.62	-720.00
	银行间市场	2,494,542.50	3,463.11	2,499,963.11	1,957.50
	合计	7,412,132.50	61,610.73	7,474,980.73	1,237.50
	资产支持证券	-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		7,412,132.50	61,610.73	7,474,980.73	1,237.50

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30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	-
应付交易费用	3,117.30

其中：交易所市场	-
银行间市场	3,117.30
应付利息	-
预提审计费	54,246.70
预提账户维护费	3,956.00
合计	61,320.00

#### 6.4.7.7 实收基金

光大保德信岁末红利纯债债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	6,010,557.84	6,010,557.84
本期申购	581,208.36	581,208.36
本期赎回（以“-”号填列）	-2,621,128.97	-2,621,128.97
本期末	3,970,637.23	3,970,637.23

光大保德信岁末红利纯债债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	38,065,277.19	38,065,277.19
本期申购	20,817,296.32	20,817,296.32
本期赎回（以“-”号填列）	-56,213,138.88	-56,213,138.88
本期末	2,669,434.63	2,669,434.63

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

光大保德信岁末红利纯债债券 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	15,928.27	343,203.38	359,131.65
本期利润	32,338.66	11,737.10	44,075.76

本期基金份额交易产生的变动数	-7,116.36	-115,567.02	-122,683.38
其中：基金申购款	2,475.63	33,652.41	36,128.04
基金赎回款	-9,591.99	-149,219.43	-158,811.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	41,150.57	239,373.46	280,524.03

光大保德信岁末红利纯债债券 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	74,110.49	2,176,036.88	2,250,147.37
本期利润	22,210.59	-3,358.50	18,852.09
本期基金份额交易产生的变动数	-75,905.08	-2,011,571.08	-2,087,476.16
其中：基金申购款	40,559.08	1,187,000.75	1,227,559.83
基金赎回款	-116,464.16	-3,198,571.83	-3,315,035.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	20,416.00	161,107.30	181,523.30

光大保德信岁末红利纯债债券 D

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
本期利润	-	-	-
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-	-	-

注：2022 年 6 月 24 日新增 D 类份额，截至报告出具日该份额暂无申购

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,490.58
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	595.89
其他	22.69
合计	2,109.16

#### 6.4.7.10 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	269,470.60
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-105,749.20
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	163,721.40

##### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	61,073,906.27
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	60,339,216.10
减：应计利息总额	838,503.12
减：交易费用	1,936.25
买卖债券差价收入	-105,749.20

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	8,378.60
——股票投资	-
——债券投资	8,378.60
——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	8,378.60

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	8,888.92
转换费收入	1.24
合计	8,890.16

#### 6.4.7.19 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	14,246.70
信息披露费	0.00
证券出借违约金	-
银行汇划费	796.12
账户维护费	12,956.00
其他费用	600.00
合计	28,598.82

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
光大保德信基金管理有限公司(“光大保德信基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

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交易。

##### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期间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。

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期间及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期间及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期间及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内未有应支付关联方的佣金。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	25,021.90	22,438.99
其中：支付销售机构的客户维护费	10,272.40	9,177.32

注：支付基金管理人光大保德信基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.3% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.3% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	8,340.63	7,479.70

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.1% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服 务费的各关 联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	光大保德信岁末红利 纯债债券 A	光大保德信岁末红 利纯债债券 C	光大保德信岁末红利 纯债债券 D	合计
光大保德信	-	28.96	-	28.96
中国建设银行	-	946.92	-	946.92
光大证券	-	100.15	-	100.15
合计	-	1,076.03	-	1,076.03
获得销售服	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			

务费的各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	光大保德信岁末红利纯债债券 A	光大保德信岁末红利纯债债券 C	光大保德信岁末红利纯债债券 D	合计
光大保德信	-	46.24	-	46.24
中国建设银行	-	1,160.97	-	1,160.97
光大证券	-	80.71	-	80.71
合计	-	1,287.92	-	1,287.92

注：支付基金销售机构的 C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.4% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给光大保德信基金公司，再由光大保德信基金公司计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额基金资产净值} \times 0.4\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间管理人未投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	1,386,023.37	1,490.58	313,032.73	3,359.61

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。



#### 6.4.10.7 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无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

##### 6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限的股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 599,438.91 元，于 2023 年 7 月 7 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

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

风险管理工作委员会是公司经营层面负责风险管理的最高权力机构，根据公司董事会和风险管理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。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	2,499,963.11	1,006,856.16
合计	2,499,963.11	1,006,856.16

注：未评级债券包括：国债、政策性金融债。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年末 2022年12月31日
AAA	-	11,113,996.76
AAA 以下	-	-
未评级	4,975,017.62	34,132,807.89
合计	4,975,017.62	45,246,804.65

注：未评级债券包括：国债、政策性金融债。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于本报告期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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。于本报告期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期末流动性情况良好。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金持有的利率敏感性资产主要为结算备付金、债券投资、存出保证金、银行存款。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,386,023.37	-	-	-	-	-	1,386,023.37
结算备付金	46,697.60	-	-	-	-	-	46,697.60

存出保证金	2,258.93	-	-	-	-	-	2,258.93
交易性金融资产	-	-	3,520,107.77	3,348,089.67	606,783.29	-	7,474,980.73
应收申购款	-	-	-	-	-	100.00	100.00
资产总计	1,434,979.90	-	3,520,107.77	3,348,089.67	606,783.29	100.00	8,910,060.63
负债							
卖出回购金融资产款	599,438.91	-	-	-	-	-	599,438.91
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,000,841.64	1,000,841.64
应付赎回款	-	-	-	-	-	142,691.12	142,691.12
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,910.28	1,910.28
应付托管费	-	-	-	-	-	636.78	636.78
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,101.70	1,101.70
应交税费	-	-	-	-	-	1.01	1.01
其他负债	-	-	-	-	-	61,320.00	61,320.00
负债总计	599,438.91	-	-	-	-	1,208,502.53	1,807,941.44
利率敏感度缺口	835,540.99	-	3,520,107.77	3,348,089.67	606,783.29	-1,208,402.53	7,102,119.19
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	5,049,013.58	-	-	-	-	-	5,049,013.58
结算备付金	293,942.45	-	-	-	-	-	293,942.45
存出保证金	1,353.43	-	-	-	-	-	1,353.43
交易性金融资产	-	-	3,527,730.82	42,725,929.99	-	-	46,253,660.81
应收申购款	-	-	-	-	-	7,934,079.03	7,934,079.03
资产总计	5,344,309.44	-	3,527,730.82	42,725,929.99	-	7,934,079.03	59,532,049.29

	6		2	99		3	30
负债							
卖出回购金融资产款	7,602,236.14	-	-	-	-	-	7,602,236.14
应付清算款	-	-	-	-	-	1,007,071.66	1,007,071.66
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,508,165.97	3,508,165.97
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	12,450.99	12,450.99
应付托管费	-	-	-	-	-	4,150.35	4,150.35
应付销售服务费	-	-	-	-	-	14,356.97	14,356.97
应交税费	-	-	-	-	-	850.85	850.85
应付利润	-	-	-	-	-	594,224.82	594,224.82
其他负债	-	-	-	-	-	103,427.50	103,427.50
负债总计	7,602,236.14	-	-	-	-	5,244,699.11	12,846,935.25
利率敏感度缺口	-2,257,926.68	-	3,527,730.82	42,725,929.99	-	2,689,379.92	46,685,114.05

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	基准利率上升 1%	减少约 148,684.12	减少约 989,100.73
	基准利率下降 1%	增加约 152,687.35	增加约 1,023,408.72

注：上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

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

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.0%(上年末：0.0%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年末：同)。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日
第一层次	-
第二层次	7,474,980.73
第三层次	-
合计	7,474,980.73



#### 6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间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。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 06 月 30 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日:同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,474,980.73	83.89
	其中:债券	7,474,980.73	83.89
	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	1,432,720.97	16.08
8	其他各项资产	2,358.93	0.03
9	合计	8,910,060.63	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未通过沪港通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

本基金本报告期内未持有股票。

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

本基金本报告期内未持有股票。

### 7.4.3 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。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	4,975,017.62	70.05
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,499,963.11	35.20
	其中：政策性金融债	2,499,963.11	35.20
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	7,474,980.73	105.25

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	230304	23 进出 04	25,000	2,499,963.11	35.20
2	019691	22 国债 26	15,000	1,521,776.30	21.43
3	019696	23 国债 03	13,000	1,319,065.84	18.57
4	019663	21 国债 15	10,000	1,020,144.66	14.36
5	019690	22 国债 25	6,000	606,783.29	8.54

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

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。

##### 7.11.2 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。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.123 进出 04（230304 IB）中国进出口银行于 2023 年 5 月 9 日收到中国银行间市场交易商协会开展的自律调查，主要内容为：中国进出口银行金融债券发行涉嫌违规行为。

除此以外，本基金投资的前十名证券的发行主体，本期未出现被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 本基金未投资超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,258.93
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	100.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,358.93

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
光大保德信岁末红利纯债债券 A	506	7,847.11	95.95	0.00%	3,970,541.28	100.00%
光大保德信岁末红利纯债债券 C	866	3,082.49	0.00	0.00%	2,669,434.63	100.00%
光大保德信岁末红利纯债债券 D	-	-	-	-	-	-
合计	1,372	4,839.70	95.95	0.00%	6,639,975.91	100.00%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	光大保德信岁末红利纯债债券 A	1,902.17	0.05%
	光大保德信岁末红利纯债债券 C	607.68	0.02%
	光大保德信岁末红利纯债债券 D	-	0.02%
	合计	2,509.85	0.04%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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 开放式基金份额变动

单位：份

项目	光大保德信岁末红利纯 债债券 A	光大保德信岁末红利 纯债债券 C	光大保德信岁末红利纯 债债券 D
基金合同生效日（2014 年 8 月 12 日）基金份 额总额	1,098,538,427.85	270,527,697.74	-
本报告期期初基金份 额总额	6,010,557.84	38,065,277.19	-
本报告期基金总申购 份额	581,208.36	20,817,296.32	-
减：本报告期基金总赎 回份额	2,621,128.97	56,213,138.88	-
本报告期基金拆分变 动份额	-	-	-
本报告期期末基金份 额总额	3,970,637.23	2,669,434.63	-

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金在本报告期内的投资策略未发生改变。

### 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金报告期内未持有基金。

### 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所情况。

## 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 10.7.2 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，本基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

## 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华创证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
开源证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：（1）报告期内租用证券公司交易单元变更情况

本基金本报告期无新增或退租的交易单元。

（2）选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

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

基本选择标准如下：

实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币；

财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

经营行为规范，近两年未发生重大违规行为而受到证监会处罚；

内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求，并能为本基金提供全面的信息服务；

研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务；

对于某一领域的研究实力超群，或是能够提供全方面，高质量的服务。

(3) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

投资研究团队按照（1）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。

**10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
开源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	25,109,218.49	89.29%	53,450,000.00	99.07%	-	-
中国国际金融股份有限公司	3,011,930.00	10.71%	500,000.00	0.93%	-	-



## 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	光大保德信基金管理有限公司旗下基金 2022 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	2023-01-03
2	光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	同上	2023-01-20
3	光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金（光大保德信岁末红利纯债债券 A）基金产品资料概要更新	同上	2023-03-10
4	光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金（光大保德信岁末红利纯债债券 C）基金产品资料概要更新	同上	2023-03-10
5	光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金（光大保德信岁末红利纯债债券 D）基金产品资料概要更新	同上	2023-03-10
6	光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金招募说明书（更新）	同上	2023-03-10
7	光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金 2022 年年度报告	同上	2023-03-31
8	光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	同上	2023-04-21

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、 中国证监会批准光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金设立的文件
- 2、 光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金基金合同
- 3、 光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金招募说明书

- 4、光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金托管协议
- 5、光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金法律意见书
- 6、报告期内光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告
- 7、基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
- 8、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 9、中国证监会要求的其他文件

## 12.2 存放地点

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

## 12.3 查阅方式

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

光大保德信基金管理有限公司

二〇二三年八月三十一日