

光大保德信一带一路战略主题混合型证券投资基金
2024 年第 1 季度报告
2024 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年四月二十二日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 4 月 19 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 2024 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 光大保德信一带一路混合 |
| 基金主代码 | 001463 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015 年 6 月 26 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 101,097,736.69 份 |
| 投资目标 | 本基金将精选受益于一带一路战略主题的相关证券，在有效控制风险前提下，力求超越业绩比较基准的投资回报，争取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。</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券市场产生深刻影响。本基金通过综合国内外宏观经济状</p> |

| | |
|--|--|
| | <p>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>本基金将通过自下而上研究入库的方式，对各个行业及区域中受益于一带一路战略主题的上市公司进行深入研究，挖掘企业的投资价值，分享一带一路战略进程中带来的投资机会，并将这些股票组成本基金的核心股票库。</p> <p>（1）一带一路战略主题的行业界定</p> <p>一带一路战略规划作为我国新时期的战略将助力我国走出去，为世界经济尤其是亚洲经济发展发挥更大作用。一带一路战略还有助于解决我国产能过剩、需求不足的矛盾，为我国经济增长寻找新的增长动力。一带一路将依托沿线基础设施的互通互联，对沿线贸易和生产要素进行优化配置，从而促进区域一体化发展。我国与沿线其他新兴市场国家和部分发达国家在技术上的优势互补和错位竞争，将刺激区域内基础设施投入与建设，包括边境口岸设施和中心城市市政基础建设、跨境铁路扩能改造、口岸高速公路等互通互联项目建设。本基金认为当前受益于一带一路战略的上市公司股票涉及多个行业，按照申万行业分类标准，本基金对一带一路战略主题所涉及的行业界定包括：交通运输、机械设备、钢铁、银行、非银金融、建筑材料、建筑装饰、电气设备等。</p> |
|--|--|

| | |
|--|--|
| | <p>未来若出现其他受益于一带一路战略主题的行业，本基金也应在深入研究的基础上，将其列入核心股票库。</p> <p>(2) 一带一路战略主题的区域界定</p> <p>一带一路战略的发展主要着眼于向西部开放以及未来我国建设海洋强国的战略目标，将同时平衡东西两道发展线路，推动中西部地区开放、推动东部地区升级。一带一路战略主题所覆盖的省份与节点城市范围极广，同时实际受益程度呈现出差异化，本基金将通过自下而上研究入库的方式，对我国各个区域中受益于一带一路战略发展的上市公司进行深入研究，并将其列入核心股票库。</p> <p>(3) 个股选择</p> <p>本基金将在核心股票库的基础上，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，综合考虑上市公司在一带一路战略中的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。同时，本基金关注一带一路相关政策、事件可能对上市公司的当前或未来价值产生的重大影响，本基金将在深入挖掘这类政策、事件的基础上，对行业进行优化配置和动态调整。</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>A. 价值和成长性</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、</p> |
|--|--|

| | |
|--|---|
| | <p>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>B. 事件性因素分析</p> <p>本基金所涉及的行业受政策扶持、产业升级、行业内重大事件以及一带一路沿线其他新兴市场国家的影响比较明显，往往会对整个行业内个股的估值水平有大范围的影响，具体包括重大行业政策变化、行业限制的放松或收紧等。</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票投资策略执行。</p> <p>3、固定收益类品种投资策略</p> <p>本基金投资于固定收益类品种的目的在于在保证基金资产流动性的基础上，使基金资产得到更加合理有效的利用，从而提高投资组合收益。为此，本基金固定收益类资产的投资将在限定的投资范围内，根据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、市场流动性情况来预测债券市场整体利率趋势，同时结合各具体品种的供需情况、流动性、信用状况和利率敏感度等因素进行综合分析，在严格控制风险的前提下，构建和调整债券投资组合。在确定固定收益投资组合的具体品种时，本基金将根据市场对于个券的市场成交情况，对各个目标投资对象进</p> |
|--|---|

| | |
|--|--|
| | <p>行利差分析，包括信用利差，流动性利差，期权调整利差（OAS），并利用利率模型对利率进行模拟预测，选出定价合理或被低估，到期期限符合组合构建要求的固定收益品种。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>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。</p> <p>5、中小企业私募债投资策略</p> <p>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。</p> <p>6、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>7、权证及其他品种投资策略</p> <p>本基金在权证投资中将权证标的证券的基本面进行研</p> |
|--|--|

| | | |
|-----------------|--|---------------|
| | <p>究，结合期权定价量化模型估算权证价值，主要考虑运用的策略有：价值挖掘策略、杠杆策略、双向权证策略、获利保护策略和套利策略等。</p> <p>同时，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 | 沪深 300 指数×70% + 中证全债指数×30%。 | |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金及债券型基金，但低于股票型基金。 | |
| 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 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 光大保德信一带一路混合 A | 光大保德信一带一路混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 001463 | 019181 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 101,086,478.11 份 | 11,258.58 份 |

§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 (2024 年 1 月 1 日-2024 年 3 月 31 日) | |
|----------------|---|---------------|
| | 光大保德信一带一路混合 A | 光大保德信一带一路混合 C |
| 1.本期已实现收益 | -10,977,241.62 | -1,219.92 |
| 2.本期利润 | -2,131,061.47 | -245.73 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0210 | -0.0218 |
| 4.期末基金资产净值 | 87,858,719.55 | 9,754.83 |

| | | |
|------------|-------|-------|
| 5.期末基金份额净值 | 0.869 | 0.866 |
|------------|-------|-------|

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

1、光大保德信一带一路混合 A：

| 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 | -2.36% | 1.24% | 2.94% | 0.72% | -5.30% | 0.52% |
| 过去六个月 | -11.24% | 1.11% | -1.70% | 0.64% | -9.54% | 0.47% |
| 过去一年 | -26.54% | 1.23% | -7.08% | 0.62% | -19.46% | 0.61% |
| 过去三年 | -36.34% | 1.33% | -17.64% | 0.74% | -18.70% | 0.59% |
| 过去五年 | 13.00% | 1.45% | 2.37% | 0.82% | 10.63% | 0.63% |
| 自基金合同 生效起至今 | -13.10% | 1.52% | -3.82% | 0.94% | -9.28% | 0.58% |

2、光大保德信一带一路混合 C：

| 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 | -2.48% | 1.25% | 2.94% | 0.72% | -5.42% | 0.53% |
| 过去六个月 | -11.54% | 1.12% | -1.70% | 0.64% | -9.84% | 0.48% |
| 自基金合同 生效起至今 | -11.45% | 1.15% | -3.11% | 0.62% | -8.34% | 0.53% |

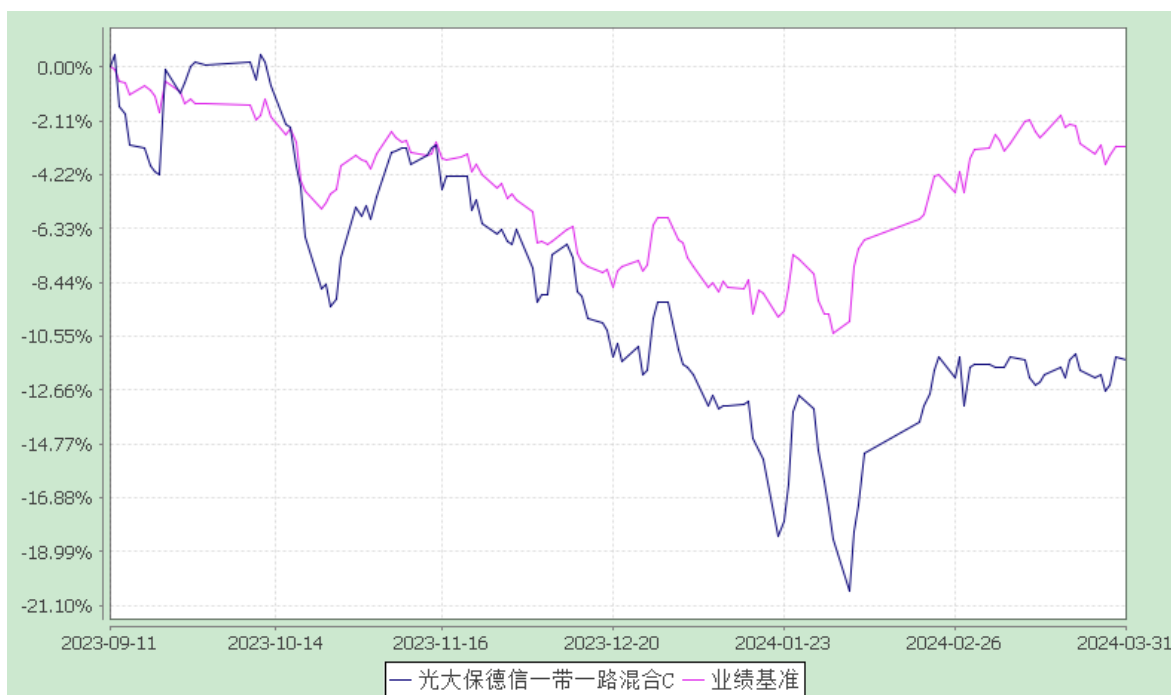
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

光大保德信一带一路战略主题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的历史走势对比图
 (2015年6月26日至2024年3月31日)

1. 光大保德信一带一路混合 A：



2. 光大保德信一带一路混合 C:



注：本基金 C 类份额设立于 2023 年 9 月 11 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 | | |
| 韩羽辰 | 基金经理 | 2023-12-30 | - | 7 年 | 韩羽辰先生, 纽约大学金融工程专业硕士。2017 年 8 月加入光大保德信基金管理有限公司, 历任研究助理、量化研究员, 2020 年 9 月至 2023 年 7 月历任权益管理总部专户权益投资团队投资经理, 现任权益管理总部量化投资团队基金经理, 2023 年 8 月至今担任光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信风格轮动混合型证券投资基金、光大保德信诚鑫灵活配置混合型证券投资基金、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、光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理, 2023 年 12 月至今担任光大保德信一带一路战略主题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《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规的规定和基金合同、招募说明书等有关法律文件的约定，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。本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，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 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

2024 年一季度，国内宏观经济继续企稳复苏，A 股市场整体呈现反转表现，高股息、科技、出海三个方向表现相对占优。

我们预计 2024 年二季度宏观经济有望持续向上修复，政府稳增长政策预计将持续发力，经济内生动力或有望逐渐企稳增强。同时持续积极推进新质生产力的发展，人工智能、高端装备、生物医药等科技新领域新赛道景气度或将不断提升。当前 A 股市场各主要宽基指数的估值仍处于合理偏低的区间，中长期配置价值值得期待。此外，资金面预计将逐步修复，美联储进入降息周期的时点有待验证，市场风格或将呈现阶段性轮动的状态，整体相对均衡。本基金将继续在一带一路主题内优选个股，力争战胜业绩基准，实现基金资产的保值增值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内光大保德信一带一路 A 份额净值增长率为-2.36%，业绩比较基准收益率为 2.94%；一带一路 C 份额净值增长率为-2.48%，业绩比较基准收益率为 2.94%。

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 | 79,105,347.98 | 89.45 |
| | 其中：股票 | 79,105,347.98 | 89.45 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 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 | 9,261,925.14 | 10.47 |
| 7 | 其他各项资产 | 64,323.63 | 0.07 |
| 8 | 合计 | 88,431,596.75 | 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 | 52,933.00 | 0.06 |
| B | 采矿业 | 9,544,329.00 | 10.86 |
| C | 制造业 | 28,426,500.98 | 32.35 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,881,519.00 | 2.14 |
| E | 建筑业 | 2,481,356.00 | 2.82 |
| F | 批发和零售业 | 2,337,229.00 | 2.66 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 9,148,098.00 | 10.41 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,444,272.00 | 1.64 |
| J | 金融业 | 17,923,625.00 | 20.40 |

| | | | |
|---|---------------|---------------|-------|
| K | 房地产业 | 2,019,246.00 | 2.30 |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,854,668.00 | 2.11 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 1,991,572.00 | 2.27 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 79,105,347.98 | 90.03 |

5.2.2 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持有沪港通股票。

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 | 600350 | 山东高速 | 191,300.00 | 1,637,528.00 | 1.86 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 50,400.00 | 1,622,880.00 | 1.85 |
| 3 | 600919 | 江苏银行 | 204,000.00 | 1,611,600.00 | 1.83 |
| 4 | 600282 | 南钢股份 | 339,500.00 | 1,599,045.00 | 1.82 |
| 5 | 601328 | 交通银行 | 251,900.00 | 1,597,046.00 | 1.82 |
| 6 | 001872 | 招商港口 | 88,000.00 | 1,594,560.00 | 1.81 |
| 7 | 000778 | 新兴铸管 | 404,300.00 | 1,592,942.00 | 1.81 |
| 8 | 601288 | 农业银行 | 376,300.00 | 1,591,749.00 | 1.81 |
| 9 | 601229 | 上海银行 | 236,000.00 | 1,585,920.00 | 1.80 |
| 10 | 601988 | 中国银行 | 360,000.00 | 1,584,000.00 | 1.80 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末投资股指期货。

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

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

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 江苏银行股份有限公司于 2023 年 8 月 18 日收到国家金融监督管理总局江苏监管局出具的行政处罚决定书（苏金罚决字(2023)2 号）。

上海银行股份有限公司于 2023 年 4 月 21 日收到国家外汇管理局上海市分局出具的行政处罚（上海汇管罚字（2023）3111221101 号）、于 2023 年 11 月 17 日收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局出具的行政处罚（沪金罚决字(2023)51 号、沪金罚决字(2023)52 号）、于 2023 年 12 月 29 日收到国家金融监督管理总局上海监管局出具的行政处罚（沪金罚决字(2023)81 号）。

招商银行股份有限公司于 2023 年 11 月 27 日收到国家外汇管理局深圳市分局出具的行政处罚（深外管检[2023]42 号）、于 2023 年 12 月 15 日收到国家金融监督管理总局深圳监管局出具的行政处罚（深金罚决字[2023]81 号）。

中国农业银行股份有限公司于 2023 年 8 月 18 日收到国家金融监督管理总局出具的行政处罚（金罚决字[2023]8 号）、于 2023 年 11 月 16 日收到国家金融监督管理总局的行政处罚（金罚决字（2023）21 号）、于 2023 年 11 月 17 日收到国家外汇管理局北京市分局出具的行政处罚（京汇罚（2023）32 号）。

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 本基金投资的前十名股票未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 | 51,315.34 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 13,008.29 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 64,323.63 |

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

| 项目 | 光大保德信一带一路混合A | 光大保德信一带一路混合C |
|----------------|----------------|--------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 102,416,036.99 | 11,258.58 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,669,803.77 | 11.68 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 2,999,362.65 | 11.68 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 101,086,478.11 | 11,258.58 |

§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

| 项目 | 光大保德信一带一路混合A | 光大保德信一带一路混合C |
|--------------------------|--------------|--------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | - | 10,236.09 |
| 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 | - | 10,236.09 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | - | 90.92 |

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、中国证监会批准光大保德信一带一路战略主题混合型证券投资基金设立的文件
- 2、光大保德信一带一路战略主题混合型证券投资基金基金合同
- 3、光大保德信一带一路战略主题混合型证券投资基金招募说明书
- 4、光大保德信一带一路战略主题混合型证券投资基金托管协议
- 5、光大保德信一带一路战略主题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一带一路战略主题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

二〇二四年四月二十二日