

光大保德信阳光现金宝货币市场基金
2026 年中期报告
2026 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：中国证券登记结算有限责任公司

报告送出日期：二〇二六年八月三十一日

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。

基金托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 28 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 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	16
6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	19
7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 债券回购融资情况	43
7.3 基金投资组合平均剩余期限	43
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	45
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离	45
7.8 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	46
7.9 投资组合报告附注	46
8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
8.4 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	48

9 开放式基金份额变动	48
10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	48
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	49
10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	49
10.9 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	50
10.10 其他重大事件	50
11 影响投资者决策的其他重要信息	55
12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	光大保德信阳光现金宝货币市场基金
基金简称	光大保德信阳光现金宝货币
基金主代码	025515
交易代码	025515
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025 年 12 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	中国证券登记结算有限责任公司
报告期末基金份额总额	29,709,343,680.34 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资组合风险，保持流动性的前提下，力争为投资人提供稳定的收益。
投资策略	本基金将综合考虑各类投资品种的收益和风险特征，在保证基金资产安全性的基础上力争为投资人创造稳定的收益。同时，本基金将关注宏观经济走势、货币政策和财政政策的变化，结合对货币市场利率变动的预期，对投资组合进行管理。 1、久期策略 本基金将在对宏观经济环境深入研究的基础上，预期未来市场利率的变化趋势，确定本基金的久期。若预测未来利率将上升，则本基金将通过缩短组合平均剩余期限的办法规避利率风险；若预测未来利率下降，则本基金将延长组合平均剩余期限，获取利率下降带来的回报。 2、类属资产配置策略 类属配置指组合在各类短期金融工具如央行票据、国债、金融债、企业短期融资券以及现金等投资品种之间的配置比例。本基金将通过分析各类属的相对收益、利差变化、流动性风险、信用风险等因素来确定类属配置比例，寻找具有投资价值的投资品种，力争取得较高的回报。 3、银行存款投资策略 银行存款一般具有收益稳定、风险低等基本特征，特别是机构投资者在投资银行存款时，往往能获得比普通投资者更高的收益率。本基金在投资银行存款时将对不同银行的银行存款收益率做深入的分析，同时结合各银行的信用等级、存款期限等因素的研究，综合考量整体利率市场环境及其变动趋势，在严格控制风险的前提下决定各银行存款的投资比例。 4、个券选择策略 在个券选择层面，将首先考虑安全性因素，优先选择央票、短期国债等高信用等级的债券品种以规避违约风险。在具体的券种选择上，基金管理人将在正确拟合收益率曲线的基础上，找出收益率出现明显偏高的券种，并客观分析收益率出现偏离的原因。若出现因市场原因所导致的收益率高于公允水平，则该券种价格出现低估，本基金将对此类低估品种进行重点关

	注。此外，鉴于收益率曲线可以判断出定价偏高或偏低的期限段，从而指导相对价值投资，这也可以帮助基金管理人选择投资于定价低估的短期债券品种。 5、回购策略 基金管理人将密切关注短期资金需求激增的机会，通过逆回购的方式融出资金以分享短期资金利率陡升的投资机会。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为人民币活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金预期收益和风险低于债券型基金、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	中国证券登记结算有限责任公司
信息披露 负责人	姓名	高顺平	王静茹
	联系电话	(021) 80262888	010-50938589
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	zctg@chinaclear.com.cn
客户服务电话		4008-202-888	4008-058-058
传真		(021) 80262468	-
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17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	北京市西城区锦什坊街26号
邮政编码		200010	100033
法定代表人		高瑞东	于文强

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.epf.com.cn
基金中期报告置备地点	光大保德信基金管理有限公司、中国证券登记结算有限责任公司的办公场所。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区锦什坊街 26 号

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（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	112,964,513.88
本期利润	112,964,513.88
本期净值收益率	0.3652%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末基金资产净值	29,709,343,680.34
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
累计净值收益率	0.4295%

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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

(2)本基金利润分配是按月结转份额。

3.2 基金净值表现

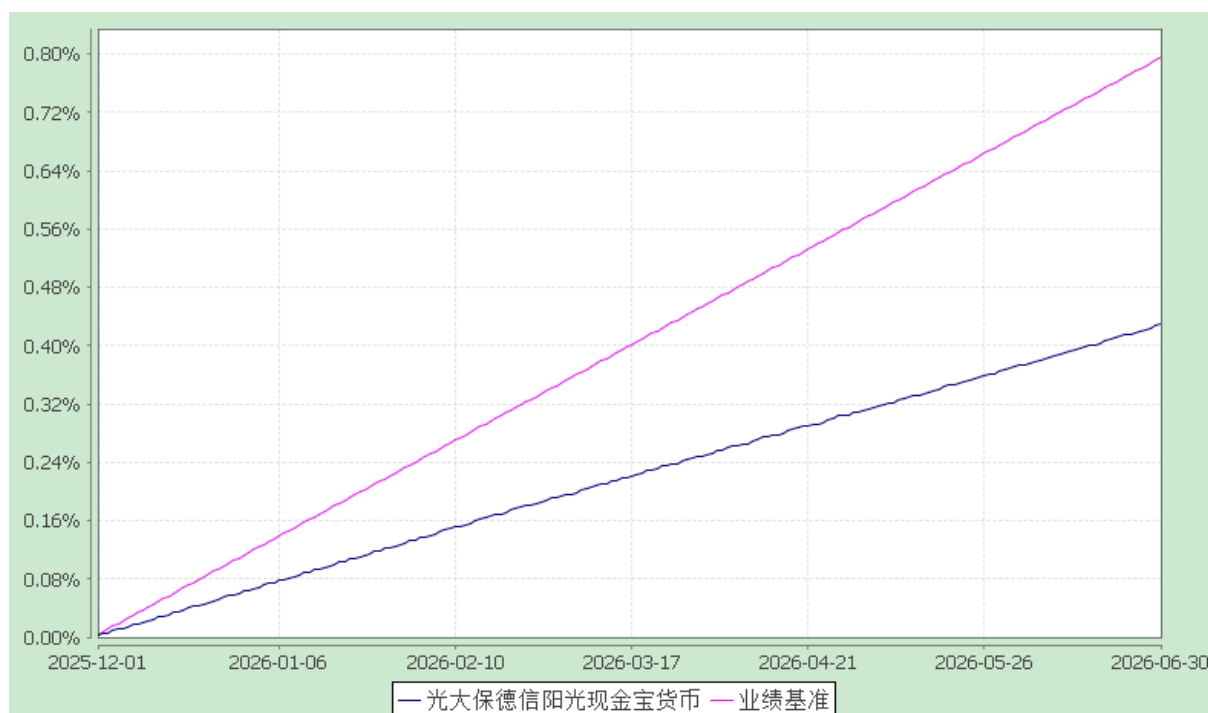
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.1802%	0.0009%	0.3413%	0.0000%	-0.1611%	0.0009%
过去六个月	0.3652%	0.0009%	0.6788%	0.0000%	-0.3136%	0.0009%
自基金合同生效起至今	0.4295%	0.0009%	0.7950%	0.0000%	-0.3655%	0.0009%

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

光大保德信阳光现金宝货币市场基金

自基金合同生效以来累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2025 年 12 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日)



注：本基金由光大阳光现金宝货币型集合资产管理计划于 2025 年 12 月 1 日转型而来。截至本报告期末，本基金成立不满一年。

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 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 2026 年 6 月 30 日，光大保德信旗下管理着 87 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

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,光大保德信永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,光大保德信产业新动力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,光大保德信添天盈五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,光大保德信恒鑫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,光大保德信数字经济主题混合型证券投资基金,光大保德信鼎利 90 天滚动持有债券型证券投资基金,光大保德信安选平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF),光大保德信红利量化选股混合型证券投资基金,光大保德信沪深 300 指数增强型证券投资基金,光大保德信阳光三个月持有期混合型基金中基金 (FOF),光大保德信中证 A500 指数型证券投资基金,光大保德信添利 30 天滚动持有债券型证券投资基金,光大保德信国证通用航空产业指数型发起式证券投资基金,光大保德信国证机器人产业

指数型发起式证券投资基金,光大保德信阳光香港精选混合型证券投资基金（QDII）,光大保德信阳光混合型证券投资基金,光大保德信阳光启明星创新驱动主题混合型证券投资基金,光大保德信阳光稳健增长混合型证券投资基金,光大保德信阳光价值 30 个月持有期混合型证券投资基金,光大保德信阳光优选一年持有期混合型证券投资基金,光大保德信阳光稳债中短债债券型证券投资基金,光大保德信阳光智造混合型证券投资基金,光大保德信阳光现金宝货币市场基金,光大保德信双鑫收益债券型证券投资基金,光大保德信北证 50 成份指数型证券投资基金。

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		
樊亚筠	基金经理	2026-02-28	-	12 年	樊亚筠女士，硕士。2014 年 6 月至 2016 年 12 月在富国资产管理有限公司任职产品经理、投资经理助理、投资经理；2016 年 12 月至 2018 年 10 月在富国基金管理有限公司任职固定收益部投资助理、投资经理；2018 年 10 月在上海光大证券资产管理有限公司,先后担任固定收益部投资经理助理、固定收益公募投资部投资经理、固定收益公募投资部副总经理；2025 年 12 月加入光大保德信基金管理有限公司，2026 年 2 月至今担任光大保德信阳光现金宝货币市场基金、光大保德信阳光稳债中短债债券型证券投资基金的基金经理。
沈荣	固收管理总部固收低风险投资团队联席团队长、基金经理	2025-12-01	-	15 年	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，现任公司固收管理总部固收低风险投资团队联席团队长，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 2021 年 5 月担任光大保德信中高等级债券型证券投资基金的基金经理，2018 年 5 月至 2022 年 9 月担任光大保德信尊富 18 个月定期开放债券型证券投资基金（已清盘）的基金经理，2018 年 6 月至 2022 年 7 月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 2021 年 5 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 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，2021 年 3 月至今担任光大保德信安和债券型证券投资基金的基金经理，2021 年 7 月至今担任光大保德信现金宝货币市场基金、光大保德信耀钱包货币市场基金的基金经理，2023 年 4 月至今担任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的基金经理，2025 年 12 月至今担任光大保德信阳光现金宝货币市场基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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；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。本基金与公司旗下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，债市整体呈现低波动、窄区间、与宏观脱敏的特征。与往年不同，上半年债市的核心定价逻辑并非来自基本面的单边驱动，而是来自于流动性充裕与机构行为的共振。一季度经济实现开门红，但利率仅在年初短暂冲高，随后波动下行。外部环境、PPI、出口等扰动因素不断，但影响幅度均有限。10 年期国债和 30 年期国债收益率分别在 1.7%~1.9%、2.2%~2.4% 区间波动，振幅不足 20BP，较去年有所收窄。中短端表现略强，信用利差小幅压缩，先杠杆、后久期策略是较好选择。一年期 AAA 同业存单从年初 1.62% 下行到 1.475%。回顾上半年，资金面对利率走势起决定作用，4-5 月 DR001 持续处于低位，非银资金同样充裕，理财和债基持续获得净申购，成为上半年债市走强的核心驱动力；优质资产稀缺，信用利差被压缩至历史低位，供需矛盾突出；机构行为对定价的影响显著增强，短端需求膨胀的主要驱动力来自同业定期存款自律管理的预期和理财规模持续扩张，而超长端的定价则越来越多地由机构行为驱动。

展望后市，国内经济预计在内需温和修复与外部不确定性交织中前行，实际 GDP 增速有望环比小幅回升。消费端，社零增速或较二季度边际改善，但以旧换新和消费补贴的拉动效应减弱，修复力度或相对有限；投资端，随着财政资金加快落地，基建和制造业投资有望企稳回升，房地产投资难有明显好转但影响斜率或放缓。出口方面，AI 相关需求和全球制造业景气回升将继续支撑出口保持较强韧性，但海外需求节奏存在变数。政策层面，财政与货币政策注重效能落实，结构性工具持续支持转型升级。物价方面，CPI 和 PPI 预计温和回升，PPI 同比有望转正，但低通胀格局较难发生根本改变。整体看，三季度经济将延续稳步修复态势，但内需恢复强度和外部环境演变仍需密切关注。

报告期内，本基金秉承追求稳健投资原则谨慎操作，根据市场情况灵活调整组合资产分布、杠杆比率，严控组合流动性风险、利率风险和信用风险，并根据货币市场收益率走势变化，五月份维持较短剩余期限，六月份择机关注了同业存单，并适当结合存款逆回购等资产提升账户稳定性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内本基金份额净值增长率为 0.3652%，同期业绩比较基准收益率为 0.6788%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内方面，上半年宏观经济顶住压力，延续了总体平稳、向新向优的发展态势。上半年经济增速符合预期目标，工业生产保持稳步增长，新质生产力加速培育。服务业对经济增长的贡献进一步提升，但居民消费动能仍有待提升；外贸在复杂外部环境下保持强劲增长，贸易结构持续向高附加值方向优化，受益于人工智能产业的电子、集成电路行业出口加速增长。宏观政策整体靠前发力，货币政策保持适度宽松，为经济平稳运行提供了有力支撑。海外方面，美国经济、贸易、地缘政策给全球经济增长前景带来较大不确定性。美国经济虽受消费和 AI 相关投资短期支撑，但第二季度增长低于市场预期。美联储上半年保持观望立场，但内部仍有分歧，市场年内加息预期仍在。美元走势与美债收益率波动，反映出国际市场对货币信用和政策协调能力的持续修正。

展望下半年，中央政治局会议对政策指引清晰、部署明确。在此背景下，国内经济增长有望延续向好态势，全年增长目标实现具备较好实现基础。结构上，内需尤其是服务消费有望进一步扩容提质；外需方面，全球 AI 资本开支扩张与能源转型两大周期持续赋能，出口产业链仍具韧性，但需关注耐用品出口等带来的短期波动。价格依然是观测经济冷暖的重要指标，上半年物价有温和回升态势，随着供需格局改善，物价水平在合理区间运行的基础之上仍有抬升的可能性。

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。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及招募说明书（更新）等有关规定，本基金按日计算并按月支付收益，基金管理人于每个分红期截止日起两日内公告基金收益分配方案。

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 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，本托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了监督和复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：光大保德信阳光现金宝货币市场基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	2,898,150,502.22	2,023,639,716.22
结算备付金		-	10,476,206.64
存出保证金		-	1,105,217.98
交易性金融资产	6.4.7.2	25,023,766,254.15	21,638,331,774.73
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		25,023,766,254.15	21,638,331,774.73
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	1,810,050,487.85	5,285,956,313.51
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		29,731,967,244.22	28,959,509,229.08
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
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		-	-

应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		9,911,373.83	14,449,731.38
应付托管费		1,302,389.85	1,291,545.85
应付销售服务费		6,511,949.33	4,702,648.12
应付投资顾问费		-	-
应交税费		29,134.86	44,217.24
应付利润		4,317,336.19	4,984,952.26
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	551,379.82	186,370.30
负债合计		22,623,563.88	25,659,465.15
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	29,709,343,680.34	28,933,849,763.93
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	0.00	0.00
净资产合计		29,709,343,680.34	28,933,849,763.93
负债和净资产总计		29,731,967,244.22	28,959,509,229.08

注：（1）报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 29,709,343,680.34 份。

（2）本基金基金合同于 2025 年 12 月 1 日生效。

6.2 利润表

会计主体：光大保德信阳光现金宝货币市场基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		249,400,641.88
1.利息收入		60,998,467.11
其中：存款利息收入	6.4.7.9	43,981,883.67
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		17,016,583.44
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		188,249,733.13
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	188,249,733.13
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-

衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	152,441.64
减：二、营业总支出		136,436,128.00
1. 管理人报酬	6.4.10.2	87,332,386.02
2. 托管费	6.4.10.2	7,692,503.73
3. 销售服务费	6.4.10.2	38,462,518.83
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		2,773,664.65
其中：卖出回购金融资产支出		2,773,664.65
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-
7. 税金及附加		22,058.83
8. 其他费用	6.4.7.19	152,995.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		112,964,513.88
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		112,964,513.88
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		112,964,513.88

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：光大保德信阳光现金宝货币市场基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	28,933,849,763.93	-	-	28,933,849,763.93
二、本期期初净资产	28,933,849,763.93	-	-	28,933,849,763.93
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	775,493,916.41	-	0.00	775,493,916.41
（一）、综合收益总额	-	-	112,964,513.88	112,964,513.88
（二）、本期基金	775,493,916.41	-	-	775,493,916.41

份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）				1
其中：1.基金申购款	532,941,214,263.41	-	-	532,941,214,263.41
2.基金赎回款	-532,165,720,347.00	-	-	-532,165,720,347.00
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-112,964,513.88	-112,964,513.88
四、本期期末净资产	29,709,343,680.34	-	-	29,709,343,680.34

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：高瑞东，主管会计工作负责人：贺敬哲，会计机构负责人：李勇

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

光大保德信阳光现金宝货币市场基金由上海光大证券资产管理有限公司旗下的光大阳光现金宝货币型集合资产管理计划（以下简称“集合计划”）转型而来。集合计划的变更经中国证监会 2025 年 8 月 19 日证监许可[2025]1816 号文准予变更注册。集合计划以通讯方式召开了集合计划份额持有人大会，并于 2025 年 11 月 21 日表决通过了《关于光大阳光现金宝货币型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为光大保德信阳光现金宝货币市场基金有关事项的议案》。自《光大保德信基金管理有限公司关于光大阳光现金宝货币型集合资产管理计划变更注册为光大保德信阳光现金宝货币市场基金相关业务安排的公告》公告日起即 2025 年 12 月 1 日，集合计划的管理人由上海光大证券资产管理有限公司变更为光大保德信基金管理有限公司；集合计划变更为光大保德信阳光现金宝货币市场基金（以下简称“本基金”）。自 2025 年 12 月 1 日起，《光大保德信阳光现金宝货币市场基金基金合同》生效，《光大阳光现金宝货币型集合资产管理计划资产管理合同》同时失效。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为光大保德信基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国证券登记结算有限责任公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《光大保德信阳光现金宝货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括：现金；期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、

中央银行票据（或简称“央行票据”）、同业存单；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。如果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，可以将其纳入本基金的投资范围。

本基金的业绩比较基准为人民币活期存款利率(税后)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《公开募集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“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括债券投资和买入返售金融资产等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金

融资产分为不同类别：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其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于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，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 金融工具的后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金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；
- 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金采用影子定价和偏离度控制确定金融资产公允价值。

当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到 0.25% 时，基金管理人应当在 5 个交易日内将负偏离度绝对值调整到 0.25% 以内。当正偏离度绝对值达到 0.5% 时，基金管理人应当暂停接受申购并在 5 个交易日内将正偏离度绝对值调整到 0.5% 以内。当负

偏离度绝对值达到 0.5% 时，基金管理人应当使用风险准备金或者固有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在 0.5% 以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.5% 时，基金管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者采取暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算等措施。

计算影子价格时遵循如下原则：

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；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，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，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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，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，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 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。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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。

6.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

债券投资收益和资产支持证券投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

6.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

6.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金每份基金份额享有同等分配权；本基金收益分配方式为红利再投资；当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有本基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有本基金的收益分配权益；“每日计提，按月支付”。本基金采用 1.00 元固定基金份额净值交易方式，自基金合同生效日起，本基金根据每日收益情况，以每万份基金暂估净收益为基准，为投资人每日计算当日暂估收益，并在分红日根据实际净收益按月集中支付；当分红日实际每万份基金净收益和七日年化收益率与暂估值有差异时，基金管理人向投资者说明造成差异的具体原因；本基金根据每日暂估收益情况，将当日暂估收益计入投资人账户，若当日暂估净收益大于零时，为投资人记正收益；若当日暂估净收益小于零时，为投资人记负收益；若当日暂估净收益等于零时，当日投资人不记收益；收益月度结转时，每月度累计收益支付方式采用红利再投资方式；若每月度累计收益支付时，投资者累计未结转收益为正值，则为基金份额持有人增加相应的基金份额；如投资者累计未结转收益等于零时，基金份额持有人的基金份额保持不变。如投资者累计未结转收益为负值，则为基金份额持有人缩减相应的基金份额，遇投资者剩余基金份额不足以扣减的情形，基金管理人将根据内部应急机制保障基金平稳运行；投资者赎回基金份额时，按本金支付，赎回基金份额当期对应的收益，于当期月度分红时支付；投资者解约的情形下，按照当期收益分配期间收益率与解约日银行活期存款利率孰低的原则计付收益；在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金

份额持有人大会；如需召开基金份额持有人大会，为确保基金份额持有人的表决权体现其持有的权益，基金管理人将于召开基金份额持有人大会的权益登记日当日统一为基金份额持有人进行累计未结转收益的结转；法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

6.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证监会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《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》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号文《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》、财税[2025] 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖债券取得的收入，截至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对本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。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

d) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	1,596,475,335.33
等于：本金	1,595,199,202.15
加：应计利息	1,276,133.18
定期存款	1,301,675,166.89

等于：本金	1,300,000,000.00
加：应计利息	1,675,166.89
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	300,391,000.00
存款期限 3 个月以上	1,001,284,166.89
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	2,898,150,502.22

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		按实际利率计 算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度（%）
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	25,023,766,254.15	25,023,501,841.64	-264,412.51	-0.0009
	合计	25,023,766,254.15	25,023,501,841.64	-264,412.51	-0.0009
资产支持证券		-	-	-	-
合计		25,023,766,254.15	25,023,501,841.64	-264,412.51	-0.0009

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	1,810,050,487.85	-
合计	1,810,050,487.85	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 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	423,283.88
其中：交易所市场	-
银行间市场	423,283.88
应付利息	-
预提审计费	49,588.57
预提信息披露费	69,507.37
预提账户维护费	9,000.00
合计	551,379.82

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	28,933,849,763.93	28,933,849,763.93
本期申购	532,941,214,263.41	532,941,214,263.41
本期赎回（以“-”号填列）	-532,165,720,347.00	-532,165,720,347.00
本期末	29,709,343,680.34	29,709,343,680.34

注：申购含红利再投、转换入份额,赎回含转换出份额。

6.4.7.8 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	0.00	-	0.00
本期期初	-	-	-
本期利润	112,964,513.88	-	112,964,513.88
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	-112,964,513.88	-	-112,964,513.88
本期末	0.00	-	0.00

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	42,279,079.07
定期存款利息收入	1,675,166.89
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	26,804.91
其他	832.80
合计	43,981,883.67

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 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	172,504,595.60
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	15,745,137.53
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	188,249,733.13

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	53,564,065,564.68
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	53,520,248,470.27
减：应计利息总额	28,072,706.88
减：交易费用	-750.00

买卖债券差价收入	15,745,137.53
----------	---------------

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本报告期内无公允价值变动损益。

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	-
解约差额收益	152,441.64
合计	152,441.64

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	25,600.00
账户维护费	18,000.00

其他费用	300.00
合计	152,995.94

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,本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2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。

6.4.9关联方、关联关系

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”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国证券登记结算有限责任公司 (“中国登记结算”)	基金托管人、注册登记机构
光大证券股份有限公司 (“光大证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构

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。

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

6.4.10.1.1 股票交易

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股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

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权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

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债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

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

本基金本报告期及上年度可比期间无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 2026年1月1日至2026年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	87,332,386.02
其中：应支付销售机构的客户维护费	43,248,856.19
应支付基金管理人的净管理费	44,083,529.83

注：支付基金管理人光大保德信基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.90% 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 × 0.90% / 当年天数。

当以 0.90% 的管理费计算的七日年化暂估收益率小于或等于 2 倍活期存款利率，基金管理人将调整管理费为 0.25%，以降低每万份基金暂估净收益为负并引发销售机构交收透支的风险，直至该类风险消除，基金管理人方可恢复计提 0.90% 的管理费。调整后的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.25% 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 × 0.25% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	7,692,503.73

注：支付基金托管人中国证券登记结算有限责任公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.05% 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：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 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 2026年1月1日至2026年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
光大证券	38,462,518.83
合计	38,462,518.83

注：支付销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值 0.25% 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：

日销售服务费=前一日基金资产净值×0.25%/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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

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固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末未投资本基金。

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 2026年1月1日至2026年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中登结算机构	18,686,835.69	18,012.81

注：本基金的上述活期银行存款由基金托管人中国结算保管，存放在具有基金托管资格的银行，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

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

无。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分 配合计	备注
113,312,180.41	319,949.54	-667,616.07	112,964,513. 88	-

6.4.12 期末（2026 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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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 2026 年 6 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 2026 年 6 月 30 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证券款余额。

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。本基金存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款不超过基金资产净值的 20%，存放在不具有基金托管资格而具有基金代销业务资格或合格境外机构投资者托管资格的同一商业银行的存款不超过基金资产净值的 5%，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金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；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。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于信用等级在 AA+ 以下的债券与非金融企业债务融资工具，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。本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%。且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末的净资产的 10%。

在现券的选择方面，本基金所投资的央行票据、国债、金融债等投资品种其发行主体分别为央行、财政部和政策性银行，因此不存在重大违约风险。而信用品种的投资，本基金主要对发行主体的资质、发行人长期评级、发行人授信额度等指标进行综合考量，以控制投资品种的违约风险。

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 2026年6月30日	上年末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	632,149,043.44	-
合计	632,149,043.44	-

注：未评级债券包括：超短期融资债券。

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	24,391,617,210.71	21,638,331,774.73
合计	24,391,617,210.71	21,638,331,774.73

注：本基金持有同业存单的主体评级均为 AA+及以上评级。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

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债券投资。

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。此外，本基金还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，除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

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》、《货币市场基金监督管理办法》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，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资流通受限资产比例，并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 60 天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。

本基金投资于同一机构发行的债券、非金融企业债务融资工具及其作为原始权益人的资产支持证券的比例，合计不得超过基金资产净值的 10%，国债、中央银行票据、政策性金融债券除外，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金合计持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；本

基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。

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。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

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。本基金所投资的债券品种的市场投资风险主要为由于市场整体利率水平的变动带来的市场价格风险。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026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							
货币资金	1,596,475,335.33	1,301,675,166.89	-	-	-	-	2,898,150,502.22
交易性金融资产	839,563,574.77	11,745,111,152.13	12,439,091,527.25	-	-	-	25,023,766,254.15
买入返售金融	1,810,050,48	-	-	-	-	-	-1,810,050,48

资产	7.85						7.85
资产总计	4,246,089,397.95	13,046,786,319.02	12,439,091,527.25	-	-	-	29,731,967,244.22
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-9,911,373.83	9,911,373.83
应付托管费	-	-	-	-	-	-1,302,389.85	1,302,389.85
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-6,511,949.33	6,511,949.33
应交税费	-	-	-	-	-	29,134.86	29,134.86
应付利润	-	-	-	-	-	-4,317,336.19	4,317,336.19
其他负债	-	-	-	-	-	551,379.82	551,379.82
负债总计	-	-	-	-	-	22,623,563.88	22,623,563.88
利率敏感度缺口	4,246,089,397.95	13,046,786,319.02	12,439,091,527.25	-	-	-22,623,563.88	29,709,343,680.34
上年度末 2025 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							
货币资金	2,023,639,716.22	-	-	-	-	-	2,023,639,716.22
结算备付金	10,476,206.64	-	-	-	-	-	10,476,206.64
存出保证金	1,105,217.98	-	-	-	-	-	1,105,217.98
交易性金融资产	99,872,412.41	6,481,305,082.01	15,057,154,280.31	-	-	-	21,638,331,774.73
买入返售金融资产	5,285,956,313.51	-	-	-	-	-	5,285,956,313.51
资产总计	7,421,049,866.76	6,481,305,082.01	15,057,154,280.31	-	-	-	28,959,509,229.08
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	14,449,731.38	14,449,731.38
应付托管费	-	-	-	-	-	-1,291,545.85	1,291,545.85
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-4,702,648.12	4,702,648.12
应交税费	-	-	-	-	-	44,217.24	44,217.24
应付利润	-	-	-	-	-	-4,984,952.26	4,984,952.26

							6
其他负债	-	-	-	-	-	186,370.30	186,370.30
负债总计	-	-	-	-	-	25,659,465.15	25,659,465.15
利率敏感度缺口	7,421,049,866.76	6,481,305,082.01	15,057,154,280.31	-	-	-25,659,465.15	28,933,849,763.93

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。

6.4.13.4.1.2 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；		
	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	
		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
	基准利率上升 0.25%	减少约 19,519,390.60	减少约 21,635,345.36
	基准利率下降 0.25%	增加约 19,562,429.20	增加约 21,689,139.07

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

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

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。

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 2026 年 6 月 30 日
第一层次	-
第二层次	25,023,766,254.15
第三层次	-
合计	25,023,766,254.15

6.4.14.2.2 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。对于公开市场交易的证券投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 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。

6.4.15.2 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 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	固定收益投资	25,023,766,254.15	84.16
	其中：债券	25,023,766,254.15	84.16
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,810,050,487.85	6.09
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	2,898,150,502.22	9.75
4	其他各项资产	-	-
5	合计	29,731,967,244.22	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	1.14	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：上表中，报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
----	----

报告期末投资组合平均剩余期限	100
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	108
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	48

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内未出现平均剩余期限超过 120 天的情况。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30 天以内	13.95	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	21.91	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	22.33	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	4.36	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	37.51	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		100.06	-

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内未出现平均剩余存续期超过 240 天的情况。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	632,149,043.44	2.13
6	中期票据	-	-
7	同业存单	24,391,617,210.71	82.10
8	其他	-	-
9	合计	25,023,766,254.15	84.23
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

注：本基金采用影子定价和偏离度控制确定金融资产的公允价值。上表所列示金额为按实际利率计算的账面价值。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	112502258	25 工商银行 CD258	8,000,000	797,530,030.60	2.68
2	112603094	26 农业银行 CD094	8,000,000	795,854,285.65	2.68
3	112603048	26 农业银行 CD048	6,000,000	598,050,093.18	2.01
4	112602079	26 工商银行 CD079	6,000,000	596,640,794.03	2.01
5	112602062	26 工商银行 CD062	5,000,000	497,432,352.81	1.67
6	112602096	26 工商银行 CD096	5,000,000	496,851,656.55	1.67
7	112603093	26 农业银行 CD093	4,000,000	399,353,154.04	1.34
8	112603111	26 农业银行 CD111	4,000,000	399,242,248.11	1.34
9	112505351	25 建设银行 CD351	4,000,000	399,038,756.03	1.34
10	112520241	25 广发银行 CD241	4,000,000	398,925,594.15	1.34

注：本基金采用影子定价和偏离度控制确定金融资产的公允价值。上表所列示金额为按实际利率计算的账面价值。

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0287%
报告期内偏离度的最低值	-0.0106%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0132%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内未发生负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内未发生正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

(1)、本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内摊销，每日计提损益。(2)、为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用市场利率或交易价格，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当基金资产净值与影子定价的偏离达到或超过基金资产净值的一定幅度时，或基金管理人认为发生了其他的重大偏离时，基金管理人可以与基金托管人商定后进行调整，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值，确保以摊余成本法计算的基金资产净值不会对基金持有人造成实质性的损害。(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)、如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。

7.9.225 工商银行 CD258(112502258 IB)、26 工商银行 CD079(112602079 IB)、26 工商银行 CD096(112602096 IB)、26 工商银行 CD062(112602062 IB)的发行主体中国工商银行股份有限公司于 2025 年 12 月 18 日收到国家外汇管理局北京市分局的公开处罚(京汇罚[2025]49 号)、于 2025 年 12 月 19 日收到中国人民银行的行政处罚(银罚决字(2025)110 号)、于 2026 年 6 月 5 日收到国家金融监督管理总局的行政处罚。

26 农业银行 CD094(112603094 IB)、26 农业银行 CD048(112603048 IB)、26 农业银行 CD093(112603093 IB)、26 农业银行 CD111(112603111 IB)的发行主体中国农业银行股份有限公司于 2025 年 10 月 31 日收到金融监管总局的公开处罚。

25 建设银行 CD351(112505351 IB)的发行主体中国建设银行股份有限公司于 2025 年 9 月 12 日收到金融监管总局出具的行政处罚、于 2026 年 2 月 12 日收到中国人民银行的行政处罚(银罚决字[2026]5 号)、于 2026 年 6 月 5 日收到国家金融监督管理总局的行政处罚。

25 广发银行 CD241(112520241 IB)的发行主体广发银行股份有限公司于 2025 年 7 月 21 日收到中国银行间市场交易商协会开展的自律调查、于 2025 年 9 月 12 日收到金融监管总局的行政处罚、于 2025 年 11 月 27 日收到外汇管理局的行政处罚。

基金管理人按照内部研究工作规范对以上证券进行分析后将其列入基金投资对象备选库并跟踪研究。以上处罚事件发生后，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。

7.9.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

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

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
282,566	105,141.25	561,104,033.37	1.89%	29,148,239,646.97	98.11%

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	个人	192,637,999.26	0.65%
2	其他机构	112,322,445.13	0.38%
3	个人	98,748,215.66	0.33%
4	其他机构	95,653,318.32	0.32%
5	个人	80,370,722.46	0.27%
6	个人	71,988,588.43	0.24%
7	个人	55,730,230.23	0.19%
8	个人	51,095,571.16	0.17%
9	个人	49,998,999.47	0.17%
10	个人	49,020,360.75	0.16%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

期末本公司的从业人员未持有本基金份额。

8.4 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

基金合同生效日（2025 年 12 月 1 日）基金份额总额	31,242,820,992.55
本报告期期初基金份额总额	28,933,849,763.93
本报告期基金总申购份额	532,941,214,263.41
减：本报告期基金总赎回份额	532,165,720,347.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	29,709,343,680.34

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

1、本报告期内，经光大保德信基金管理有限公司董事会会议审议通过，自 2026 年 3 月 26 日起，汪沛先生任董事长，王翠婷女士不再担任董事长。

2、本报告期内，经光大保德信基金管理有限公司董事会会议审议通过，自 2026 年 3 月 26 日起，黄波先生任副总经理兼首席投资总监，董文卓先生不再担任副总经理兼首席投资总监。

本报告期内，本托管人的专门基金托管部门负责人由朱立元变更为孟凡阔。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.7.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人及相关高级管理人员未受到任何调查或处罚。

10.7.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人相关从业人员未受到任何调查或处罚。

10.7.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内无涉及本基金托管业务的诉讼。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受稽查或处罚。

本报告期内，本托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.8.1 基金租用或者通过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	
光大证券股份 有限公司	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；

近两年未发生就交易席位方面的违约、侵权等各种纠纷或出现重大舆情事件；

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；

(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，并报公司管理层（销售分管领导除外）批准。

经公司管理层（销售分管领导除外）批准后，由本管理人交易部门、运营部门配合完成专用交易单元的具体租用事宜。

10.8.2 基金租用或者通过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
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

10.9 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

报告期内偏离度绝对值没有超过 0.5%(含)以上。

10.10 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 2025 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	2026-01-01
2	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费	同上	2026-01-03

	调整及恢复的公告		
3	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-01-04
4	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-01-07
5	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-01-10
6	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-01-11
7	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-01-12
8	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-01-14
9	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-01-17
10	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-01-18
11	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-01-19
12	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-01-21
13	光大保德信阳光现金宝货币市场基金 2025 年第 4 季度报告	同上	2026-01-22
14	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-01-24
15	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-01-25
16	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-01-26
17	光大保德信阳光现金宝货币市场基金收益支付公告	同上	2026-01-27
18	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-01-28
19	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-01-31
20	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-02-01
21	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-02-02
22	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-02-04
23	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-02-07
24	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费	同上	2026-02-08

	调整及恢复的公告		
25	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-02-09
26	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-02-11
27	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-02-14
28	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-02-15
29	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-02-16
30	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-02-18
31	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-02-21
32	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-02-22
33	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-02-23
34	光大保德信阳光现金宝货币市场基金收益支付公告	同上	2026-02-26
35	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-02-28
36	光大保德信阳光现金宝货币市场基金基金经理变更公告	同上	2026-02-28
37	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-03-01
38	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-03-02
39	光大保德信阳光现金宝货币市场基金(光大保德信阳光现金宝货币)基金产品资料概要更新	同上	2026-03-04
40	光大保德信阳光现金宝货币市场基金招募说明书（更新）	同上	2026-03-04
41	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-03-08
42	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-03-09
43	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-03-11
44	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-03-16
45	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-03-18
46	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费	同上	2026-03-23

	调整及恢复的公告		
47	光大保德信阳光现金宝货币市场基金收益支付公告	同上	2026-03-25
48	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	2026-03-28
49	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-03-30
50	关于网站、微信服务号在线客服暂停使用的公告	同上	2026-04-03
51	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-04-06
52	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-04-07
53	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-04-11
54	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-04-12
55	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-04-13
56	光大保德信基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所公告	同上	2026-04-14
57	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-04-18
58	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-04-19
59	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-04-20
60	光大保德信阳光现金宝货币市场基金 2026 年第 1 季度报告	同上	2026-04-22
61	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-04-25
62	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-04-26
63	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-04-27
64	光大保德信阳光现金宝货币市场基金收益支付公告	同上	2026-04-27
65	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-05-03
66	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-05-04
67	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-05-05
68	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费	同上	2026-05-06

	调整及恢复的公告		
69	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-05-10
70	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-05-11
71	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-05-15
72	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-05-17
73	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-05-18
74	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-05-20
75	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-05-22
76	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-05-23
77	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-05-24
78	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-05-27
79	光大保德信阳光现金宝货币市场基金收益支付公告	同上	2026-05-27
80	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-05-30
81	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-05-31
82	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-06-01
83	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-06-02
84	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-06-03
85	光大保德信基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	同上	2026-06-06
86	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-06-06
87	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-06-07
88	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-06-08
89	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-06-09

90	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-06-10
91	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-06-12
92	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-06-13
93	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-06-14
94	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-06-15
95	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-06-16
96	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-06-17
97	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-06-19
98	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-06-20
99	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-06-21
100	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-06-22
101	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-06-23
102	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-06-24
103	光大保德信阳光现金宝货币市场基金收益支付公告	同上	2026-06-25
104	光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费调整及恢复的公告	同上	2026-06-26
105	关于调整光大保德信阳光现金宝货币市场基金管理费适用费率的公告	同上	2026-06-28
106	光大保德信阳光现金宝货币市场基金(光大保德信阳光现金宝货币)基金产品资料概要更新	同上	2026-06-30
107	光大保德信阳光现金宝货币市场基金招募说明书（更新）	同上	2026-06-30

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、中国证监会准予光大阳光现金宝货币型集合资产管理计划变更注册的文件
- 2、光大保德信阳光现金宝货币市场基金基金合同
- 3、光大保德信阳光现金宝货币市场基金招募说明书
- 4、光大保德信阳光现金宝货币市场基金托管协议
- 5、光大保德信阳光现金宝货币市场基金法律意见书
- 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阳光现金宝货币市场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

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。

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：4008-202-888，021-80262888。公司网址：www.epf.com.cn。

光大保德信基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日