

# 光大保德信尊泰三年定期开放债券型证券投资基金

## 2022 年中期报告

### 2022 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：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十一日

## 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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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 2022 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.....	6
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> .....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
<b>4 管理人报告</b> .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
<b>5 托管人报告</b> .....	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
<b>6 中期财务会计报告（未经审计）</b> .....	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	19
<b>7 投资组合报告</b> .....	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	44
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.....	44
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.....	44
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.....	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	45
7.12 本报告期投资基金情况.....	45
7.13 投资组合报告附注.....	45
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	50

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	50
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 .....	50
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>50</b>
<b>10 重大事件揭示</b> .....	<b>51</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	51
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 .....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	51
10.4 基金投资策略的改变 .....	51
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	51
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	51
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 .....	51
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	51
10.9 其他重大事件 .....	53
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>53</b>
<b>12 备查文件目录</b> .....	<b>54</b>
12.1 备查文件目录 .....	54
12.2 存放地点 .....	54
12.3 查阅方式 .....	54

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	光大保德信尊泰三年定期开放债券型证券投资基金
基金简称	光大保德信尊泰三年债券
基金主代码	006565
交易代码	006565
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2019 年 12 月 5 日
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,099,997,491.20 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金封闭期内采取买入持有到期投资策略，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，力求基金资产的稳健增值。
投资策略	<p>1、封闭期投资策略</p> <p>（1）封闭期配置策略</p> <p>本基金以封闭期为周期进行投资运作。为力争基金资产在开放前可完全变现，本基金在封闭期内采用买入并持有到期投资策略，所投金融资产以收取合同现金流量为目的并持有到期，所投资产到期日（或回售日）不得晚于封闭期到期日。本基金投资含回售权的债券时，应在投资该债券前，确定行使回售权或持有至到期的时间；债券到期日晚于封闭期到期日的，基金管理人应当行使回售权而不得持有至到期日。</p> <p>基金管理人可以基于持有人利益优先原则，在不违反《企业会计准则》的前提下，对尚未到期的固定收益类品种进行处置。</p> <p>（2）信用债投资策略</p> <p>本基金由于封闭期内采用买入持有到期投资策略，因此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。</p> <p>为控制本基金的信用风险，本基金将定期对所投债券的信用资质和发行人的偿付能力进行评估。对于存在信用风险隐患的发行人所发行的债券，及时制定风险处置预案。封闭期内，如本基金持有债券的信用风险显著增加时，为减少信用损失，本基金将对该债券进行处置。</p> <p>（3）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>(4) 证券公司短期公司债券投资策略 本基金将通过对证券行业分析、证券公司资产负债分析、公司现金流分析等调查研究，分析证券公司短期公司债券的违约风险及合理的利差水平，对证券公司短期公司债券进行独立、客观的价值评估。 基金投资证券公司短期公司债券，基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。</p> <p>(5) 杠杆投资策略 本基金将在封闭期内进行杠杆投资，杠杆放大部分仍投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，并采取买入持有到期投资策略。同时采取滚动回购的方式来维持杠杆，因此负债的资金成本存在一定的波动性。</p> <p>(6) 封闭期现金管理策略 在每个封闭期内完成组合的构建之前，本基金将根据届时的市场环境对组合的现金头寸进行管理，选择到期日（或回售日）在建仓期之内的债券、回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等进行投资，并采用买入持有到期投资策略。 由于在建仓期本基金的投资难以做到与封闭期剩余期限完美匹配，因此可能存在持有的部分投资品种在封闭期结束前到期兑付本息的情形。另一方面，本基金持有的部分投资品种的付息也将增加基金的现金头寸。对于现金头寸，本基金将根据届时的市场环境和封闭期剩余期限，选择到期日（或回售日）在封闭期结束之前的债券、回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等进行投资或进行基金现金分红。</p> <p>2、开放期投资策略 开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。 今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。</p>
业绩比较基准	在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日公布的三年期定期存款利率（税后）+1.5%。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期预期收益和风险高于货币市场基金，但低于股票型基金和混合型基金。

### 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	中国光大银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高顺平	石立平
	联系电话	(021) 80262888	010-63639180
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	shiliping@cebbank.com

客户服务电话	4008-202-888	95595
传真	(021) 80262468	010-63639132
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25号、甲25号中国光大中心
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	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码	200010	100033
法定代表人	刘翔	李晓鹏

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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、中国光大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 (2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	59,283,312.45
本期利润	59,283,312.45
加权平均基金份额本期利润	0.0145
本期加权平均净值利润率	1.40%
本期基金份额净值增长率	1.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	126,643,670.00
期末可供分配基金份额利润	0.0309
期末基金资产净值	4,226,641,161.20
期末基金份额净值	1.0309
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	7.60%

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

除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于本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。

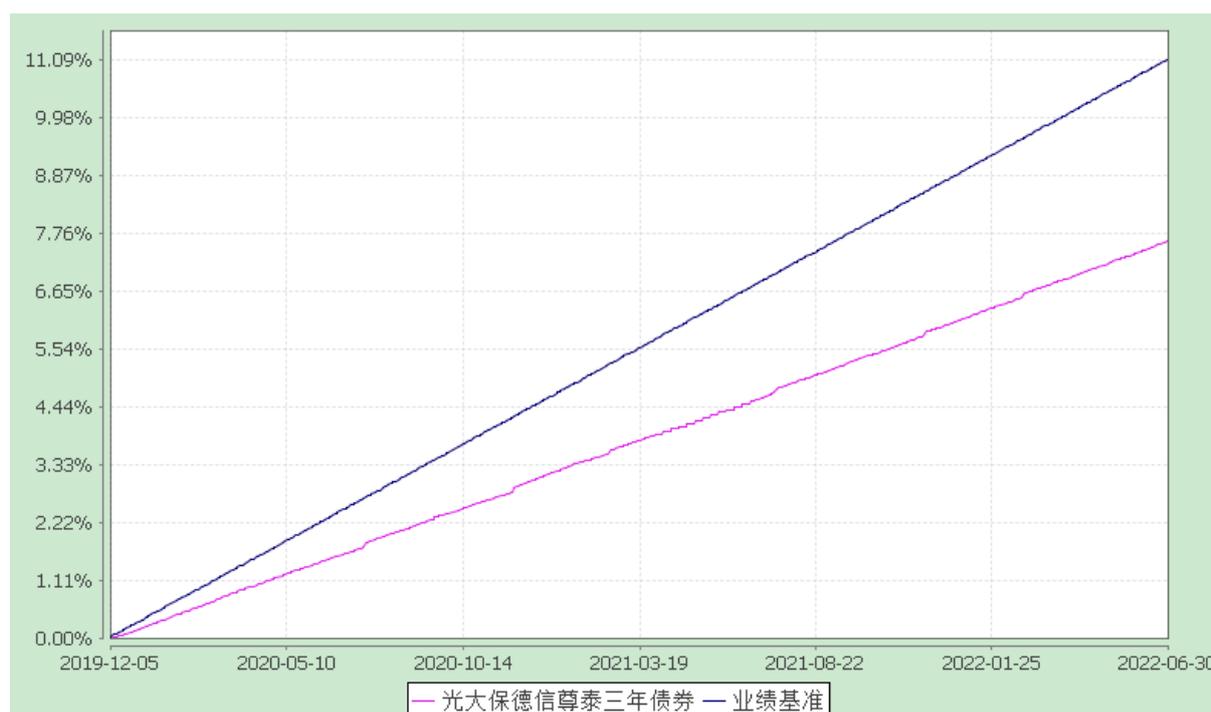
### 3.2 基金净值表现

#### 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

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	0.23%	0.01%	0.35%	0.01%	-0.12%	0.00%
过去三个月	0.68%	0.01%	1.07%	0.01%	-0.39%	0.00%
过去六个月	1.40%	0.01%	2.14%	0.01%	-0.74%	0.00%
过去一年	2.91%	0.01%	4.31%	0.01%	-1.40%	0.00%
自基金合同生效起至今	7.60%	0.01%	11.09%	0.01%	-3.49%	0.00%

#### 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

光大保德信尊泰三年定期开放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  
 （2019年12月5日至2022年6月30日）



## 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 2022 年 6 月 30 日，光大保德信旗下管理着 70 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、光大保德信睿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、光大保德信铭鑫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、光大保德信尊富 18 个月定期开放债券型证券投资基金、光大保德信多策略优选一年定期开放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、光大保德信裕鑫混合型证券投资基金、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、光大保德信中短期利率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。

#### 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		
邹强	固收管理总部 固收研究团队 联席团队长、 基金经理	2021-07-03	-	6 年	邹强先生，2011 年本科毕业于山东大学数学学院，2014 年获得复旦大学金融学的硕士学位。2014 年 6 月至 2015 年 12 月在国家开发银行工作；2016 年 1 月至 2018 年 7 月在平安养老保险股份有限公司担任宏观及债券策略助理研究员、研究经理；2018 年 7 月加入光大保德信基金管理有限公司，历任债券策略研究员，现任首席宏观债券策略分析师、固收管理总部固收研究团队联席团队长，2020 年 9 月至今担任光大保德信晟利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诚债券型证券投资基金的基金经理，2021 年 6 月至今担任光大保德信

					永利纯债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中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、光大保德信尊泰三年定期开放债券型证券投资基金的基金经理，2022 年 3 月至今担任光大保德中短期利率债债券型证券投资基金的基金经理，2022 年 6 月至今担任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

宏观方面，前期因为外部客观因素使全国多地供需两端都受到了一定影响，部分分项单月增速数据出现明显的下滑。但 5 月上海陆续推动复工复产，经济呈现明显疫后修复特征，生产端较需求端修复速率更快；需求端例如社零、地产销售等环比的明显增长也进一步修复市场对经济基本面的信心。6 月经济数据进而确认疫后继续修复趋势，生产端进一步发力的同时，需求端也在跟进，包括生产经营活动预期的持续改善也在传递积极信号，整个二季度中国经济小幅正增长；市场关注全年经济增速的数字，但结构上的积极变化更值得关注。在地产较弱、总量政策松绑幅度有限的背景下，本轮经济上行的驱动更多来自中游行业的驱动，中游行业工业增加值增速、制造业投资增速延续了普遍的改善趋势。

债券市场方面，整个上半年在流动性充裕的背景下，短端收益率下行幅度普遍较长端更为明显。具体而言，短端 1 年国债和 1 年国开二季度末为 1.93% 和 2.00%，分别下行 32bp 和 33bp。长端 10 年国债和 10 年国开一季度末为 2.83% 和 3.06%，分别下行 5bp 和 2bp。信用债方面，1Y 的 AAA 信用债一季度末收益率为 2.39%，下行 35bp；3Y 的 AAA 和 AA 的信用债二季度末为 2.88% 和 3.22%，分别下行 7bp 和 48bp。

本基金密切关注国际国内经济形势和货币、财政政策的动态。在基金操作中关注季末、年末、春节等传统资金面紧张的时点对资金面的冲击，在做好基金的流动性管理的前提下，同时适当提高组合收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内份额净值增长率为 1.40%，业绩比较基准收益率为 2.14%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望整个下半年，我们认为基建投资增速对经济基本面拉动较为确定，同时地产投资数据可能会继续恢复，不排除制造业投资有超预期积极情况发生。消费方面，包括地产、其他商品和服务消费都有进一步改善空间。出口方面，尽管我国出口品类具有大而全的优势，但海外需求的持续性以及美国经济硬着陆的风险需要密切跟踪。长期来看，我们认为我国经济体量大、回旋余地广，经济发展向好的基本面并没有改变。

#### 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；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**

本基金本报告期利润分配：92,249,942.09 元。

#### **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，中国光大银行股份有限公司在光大保德信尊泰三年定期开放债券型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

### 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，中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

报告期内，本基金实施利润分配:92,249,942.09 元。

### 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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《光大保德信尊泰三年定期开放债券型证券投资基金 2022 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

## 6 中期财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：光大保德信尊泰三年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,659,490.59	12,643,724.34
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	-	-
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
债权投资		5,242,585,663.28	5,623,950,097.43
其中：债券投资		5,242,585,663.28	5,623,950,097.43
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	6.4.7.6	-	43,190,413.18
资产总计		5,244,245,153.87	5,679,784,234.95
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 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		1,016,663,229.59	1,418,117,032.81
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		520,481.65	542,078.95
应付托管费		173,493.85	180,692.98
应付销售服务费		-	-

应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	246,787.58	1,187,481.35
负债合计		1,017,603,992.67	1,420,027,286.09
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.8	4,099,997,491.20	4,099,997,459.96
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.9	126,643,670.00	159,759,488.90
净资产合计		4,226,641,161.20	4,259,756,948.86
负债和净资产总计		5,244,245,153.87	5,679,784,234.95

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0309 元，基金份额总额 4,099,997,491.20 份。

## 6.2 利润表

会计主体：光大保德信尊泰三年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		74,888,790.85	78,864,914.99
1.利息收入		74,888,790.85	78,864,914.99
其中：存款利息收入	6.4.7.10	25,484.46	11,640.49
债券利息收入		74,837,567.38	78,853,274.50
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		25,739.01	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-	-
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-	-
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		15,605,478.40	22,288,583.56
1. 管理人报酬		3,152,831.75	3,107,572.88
2. 托管费		1,050,943.92	1,035,857.59
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		11,377,320.05	18,012,497.75
其中：卖出回购金融资产支出		11,377,320.05	18,012,497.75
6. 信用减值损失	6.4.7.2 0	-106,147.07	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.21	130,529.75	132,655.34
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>59,283,312.45</b>	<b>56,576,331.43</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>59,283,312.45</b>	<b>56,576,331.43</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>59,283,312.45</b>	<b>56,576,331.43</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：光大保德信尊泰三年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	4,099,997,459.96	-	159,759,488.90	4,259,756,948.86
加：会计政策变更	-	-	-149,189.95	-149,189.95
二、本期期初净资产（基金净值）	4,099,997,459.96	-	159,610,298.95	4,259,607,758.91
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	31.24	-	-32,966,628.95	-32,966,597.71
（一）、综合收益总额	-	-	59,283,312.45	59,283,312.45

(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)	31.24	-	0.69	31.93
其中: 1.基金申购款	31.24	-	0.69	31.93
2.基金赎回款	-	-	-	-
(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)	-	-	-92,249,942.09	-92,249,942.09
四、本期期末净资产(基金净值)	4,099,997,491.20	-	126,643,670.00	4,226,641,161.20
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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)	4,099,997,446.48	-	62,012,830.89	4,162,010,277.37
二、本期期初净资产(基金净值)	4,099,997,446.48	-	62,012,830.89	4,162,010,277.37
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	13.48	-	35,666,343.44	35,666,356.92
(一)、综合收益总额	-	-	56,576,331.43	56,576,331.43
(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)	13.48	-	0.16	13.64
其中: 1.基金申购款	13.48	-	0.16	13.64
2.基金赎回款	-	-	-	-
(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	-	-	-20,909,988.15	-20,909,988.15

减少以“-”号填列)				
四、本期期末净资产(基金净值)	4,099,997,459.96	-	97,679,174.33	4,197,676,634.29

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

光大保德信尊泰三年定期开放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[2018]952 号《关于准予光大保德信尊泰一年定期开放债券型证券投资基金注册的批复》和证监许可[2019]2037 号《关于准予光大保德信尊泰一年定期开放债券型证券投资基金变更注册的批复》核准，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《光大保德信尊泰三年定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式，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 4,099,997,419.70 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(2019)第 0687 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《光大保德信尊泰三年定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2019 年 12 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,099,997,422.61 份，其中认购资金利息折合 2.91 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，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金以定期开放方式运作，封闭期为自基金合同生效日起(包括基金合同生效之日)至三年后的年度对日的前一日(包括该日)为止。本基金封闭期内采取封闭运作模式，不接受基金的申购、赎回，也不上市交易。每个开放期间时长为 1 至 20 个工作日。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《光大保德信尊泰三年定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、次级债券、政府机构债、地方政府债、证券公司短期公司债券)、资产支持债券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款等)、同业存单、货币市场工具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的相关规定。本基金不投资股票、可转换债券、可交换

债券。基金的投资组合比例为：债券资产比例不低于基金资产的 80%。但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期开始前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制。开放期内，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制。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。在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日公布的三年期定期存款利率(税后)+1.5%。

#### 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》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《光大保德信尊泰三年定期开放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

本基金 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、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。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

#### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、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公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金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。本基金现无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及以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即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。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、债权投资、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

#### 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

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以摊余成本计量的金融资产和金融负债，取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在债权投资的账面价值中。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项、债权投资和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 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；或者(3) 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。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终

止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。应收款项、持有至到期投资和其他金融负债，取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。

对于应收款项、持有至到期投资和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金于资产负债表日对金融资产的账面价值进行检查，如果有客观证据表明某项金融资产发生减值的，计提减值准备。

以摊余成本计量的金融资产发生减值时，按预计未来现金流量(不包括尚未发生的未来信用损失)现值低于账面价值的差额，计提减值准备。相应的资产减值损失在利润表中列示在其他费用科目下。如果有客观证据表明该金融资产价值已恢复，且客观上与确认该损失后发生的事项有关，原确认的减值损失予以转回，计入当期损益。但是，该转回后的账面价值不应当超过假定不计提减值准备情况下该金融资产在转回日的摊余成本。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 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；或者(3) 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。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额

的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 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在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金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 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以摊余成本计量的金融资产于处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管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。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红

利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 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并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

##### 预期信用损失的计量

对于以摊余成本计量的金融资产，其预期信用损失的计量中使用了模型和假设，这些模型和假设涉及未来的宏观经济情况对手方的信用行为。在预期信用损失的计量中所包含的重大判断和假设主要包括：选择恰当的预期信用损失模型并确定相关参数、减值阶段划分的判断标准以及用于计量预期信用损失的前瞻性信息及其权重的采用等。本基金管理人通过违约风险敞口和预期信用损失率计算预期信用损失，并基于违约概率和违约损失率确定预期信用损失率。在划分减值阶段及确定预期信用损失率时，本基金管理人使用可获取的外部评级、外部报告和外部统计数据等，并定期监控和复核与预期信用损失计算相关的重要宏观经济假设和参数。

#### 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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会

计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”), 财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》, 公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外, 中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》, 本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表, 对本基金财务报表的影响列示如下: 根据新金融工具准则的相关规定, 本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额, 2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日, 本基金均没有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。于 2022 年 1 月 1 日, 本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下: 原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、应收利息和其他资产-持有至到期投资, 金额分别为 12,643,724.34 元、43,190,413.18 元和 5,623,950,097.43 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、其他资产-应收利息和债权投资, 金额分别为 12,644,365.27 元、0.00 元和 5,667,139,869.68 元。原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和应付利息, 金额分别为 1,418,117,032.81 元、542,078.95 元、180,692.98 元、66,101.07 元和 891,380.28 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-应付利息, 金额分别为 1,419,008,413.09 元、542,078.95 元、180,692.98 元、66,101.07 元和 0.00 元。于 2021 年 12 月 31 日, 本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日, 本基金根据新金融工具准则下的计量类别, 将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示, 无期初留存收益影响。于 2022 年 1 月 1 日, 本基金根据新金融工具准则的要求, 对于下列以摊余成本计量的金融资产, 以预期信用损失为基础进行减值会计处理并确认损失准备。相关金融资产原账面价值调整为新金融工具准则下的账面价值的调节结果如下: 于 2021 年 12 月 31 日, 债权投资账面价值为 0.00 元, 加自其他资产(持有至到期投资)转入(原金融工具准则) 5,623,950,097.43 元, 加自应收利息转入(原金融工具准则) 43,189,772.25 元, 重新计量预期信用损失合计 149,189.95 元, 于 2022 年 1 月 1 日, 债权投资账面价值为 5,666,990,679.73 元。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

#### 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 2022年6月30日
活期存款	1,659,490.59
等于：本金	1,658,458.36
加：应计利息	1,032.23
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	1,659,490.59

**6.4.7.2 交易性金融资产**

不适用。

**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**

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

**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 债权投资****6.4.7.5.1 债权投资情况**

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 6 月 30 日				
		初始成本	利息调整	应计利息	减值准备	账面价值
债券	交易所市场	71,072,000.00	745.59	1,235,499.52	-	72,308,245.11
	银行间市场	5,050,000.00	7,332,729.54	112,987,731.51	43,042.88	5,170,277.418.17
	小计	5,121,072.00	7,333,475.13	114,223,231.03	43,042.88	5,242,585.663.28
资产支持证券		-	-	-	-	-
其他		-	-	-	-	-
合计		5,121,072.00	7,333,475.13	114,223,231.03	43,042.88	5,242,585.663.28

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

单位：人民币元

减值准备	第一阶段	第二阶段	第三阶段	合计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失(未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失(已发生信用减值)	
期初余额	149,189.95	-	-	149,189.95
本期从其他阶段转入	-	-	-	-
本期转出至其他阶段	-	-	-	-
本期新增	256.60	-	-	256.60
本期转回	106,403.67	-	-	106,403.67
其他变动	-	-	-	-
期末余额	43,042.88	-	-	43,042.88

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	-
持有至到期投资-债券投资	-
合计	-

#### 6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 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	27,691.64
其中：交易所市场	-
银行间市场	27,691.64
应付利息	-
预提审计费	159,588.57
预提信息披露费	59,507.37
合计	246,787.58

#### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,099,997,459.96	4,099,997,459.96
本期申购	31.24	31.24
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	4,099,997,491.20	4,099,997,491.20

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.9 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	159,759,488.90	-	159,759,488.90
本期期初	159,610,298.95	-	159,610,298.95
本期利润	59,283,312.45	-	59,283,312.45
本期基金份额交易产生的变动数	0.69	-	0.69
其中：基金申购款	0.69	-	0.69
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-92,249,942.09	-	-92,249,942.09
本期末	126,643,670.00	-	126,643,670.00

#### 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入

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	-
其他	-
合计	25,484.46

#### 6.4.7.11 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

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

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内未投资贵金属。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内未投资衍生工具。

#### 6.4.7.17 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

本基金本报告期内无公允价值变动收益。

#### 6.4.7.19 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

#### 6.4.7.20 信用减值损失

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30 日
银行存款	-
买入返售金融资产	-
债权投资	-106,147.07

其他债权投资	-
其他	-
合计	-106,147.07

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022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	2,833.81
账户维护费	18,000.00
其他费用	600.00
合计	130,529.75

#### 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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响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
光大证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
中国光大银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
光大保德信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

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

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行交易。

## 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 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,152,831.75	3,107,572.88
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下： $H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$  H 为每日应计提的基金管理费 E 为前一日的基金资产净值 基金管理费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,050,943.92	1,035,857.59

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。

托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$  H 为每日应计提的基金托管费 E 为前一日的基金资产净值 基金托管费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

E 为前一日的基金资产净值 基金托管费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

### 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

本基金无转融通业务。

#### 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未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	
	2022年1月1日至2022年6月30日		2021年1月1日至2021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
中国光大银行	1,659,490.59	25,484.46	713,921.45	9,603.36

#### 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

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	利润分配合 计	备注
		场 内	场 外					
1	2022-03-22	-	2022- 03-22	0.225	92,249,910.1 6	31.93	92,249,942.0 9	-
合计				0.225	92,249,910.1 6	31.93	92,249,942.0 9	-

#### 6.4.12 期末（2022 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**

本基金本报告期末未持有股票。

**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**

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金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人民币 1,016,663,229.59 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
170212	17 国开 12	2022-07-01	100.50	5,550,000.00	557,775,000.00
170212	17 国开 12	2022-07-06	100.50	3,100,000.00	311,550,000.00
190214	19 国开 14	2022-07-04	100.01	2,100,000.00	210,021,000.00
合计				10,750,000.00	1,079,346,000.00

**6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

本基金无转融通业务。

**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

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债券投资。

##### 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 2022年6月30日	上年末 2021年12月31日
AAA	1,074,170,528.82	1,485,923,259.84

AAA 以下	-	-
未评级	4,168,458,177.34	4,138,026,837.59
合计	5,242,628,706.16	5,623,950,097.43

注：未评级债券包括：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于约定开放日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于开放期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》且于基金开放期内按照《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公司的证券不得超过该证券的 10%。于开放期内，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

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。

于开放期内，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。

本基金主要投资于固定利率的交易所及银行间市场交易的固定收益品种，资产的账面价值不受市场利率变动的影 响。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款和其他资产-持有至到期投资。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	1,659,490.59	-	-	-	-	-	1,659,490.59
债权投资	462,388,439.01	205,736,427.11	4,574,460,797.16	-	-	-	5,242,585,663.28
资产总计	464,047,929.60	205,736,427.11	4,574,460,797.16	-	-	-	5,244,245,153.87
负债							
卖出回购金融资产款	1,016,663,229.59	-	-	-	-	-	1,016,663,229.59
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	520,481.65	520,481.65
应付托管费	-	-	-	-	-	173,493.85	173,493.85
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	246,787.58	246,787.58
负债总计	1,016,663,229.59	-	-	-	-	940,763.08	1,017,603,992.67
利率敏感度缺口	-552,615,299.99	205,736,427.11	4,574,460,797.16	0.00	0.00	-940,763.08	4,226,641,161.20
上年度末	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

2021 年 12 月 31 日							
资产							
银行存款	12,643,724. 34	-	-	-	-	-	12,643,724. 34
债权资产	120,047,00 9.08	310,353,37 9.38	5,193,549,7 08.97	-	-	-	5,623,950,0 97.43
其他资产	-	-	-	-	-	43,190,413. 18	43,190,413. 18
资产总计	132,690,73 3.42	310,353,37 9.38	5,193,549,7 08.97	-	-	43,190,413. 18	5,679,784,2 34.95
负债							
卖出回购金融 资产款	1,418,117,0 32.81	-	-	-	-	-	1,418,117,0 32.81
应付管理人报 酬	-	-	-	-	-	542,078.95	542,078.95
应付托管费	-	-	-	-	-	180,692.98	180,692.98
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	1,187,481.3 5	1,187,481.3 5
负债总计	1,418,117,0 32.81	-	-	-	-	1,910,253.2 8	1,420,027,2 86.09
利率敏感度缺 口	-1,285,426, 299.39	310,353,37 9.38	5,193,549,7 08.97	-	-	41,280,159. 90	4,259,756,9 48.86

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

本基金本期末生息资产为银行存款及其他资产。其中，银行存款以活期存款利率或相对固定的利率计息，其他资产-持有至到期投资为固定利率持有至到期投资采用摊余成本法核算，利息收益在交易时已确定，不受利率变化影响，资产的账面价值不受市场利率变动的影响。本基金本期末生息负债仅为卖出回购金融资产款，卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响。因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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

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，且以摊余成本进行后续计量，因此无重大市场价格风险。

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金未持有交易性权益类投资、可转换债券及可交换债券(上年末：同)，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

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有持续的以公允价值计量的金融工具。

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

不适用

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 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。

##### 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、债权投资和其他金融负债等。

除债权投资以外，其他不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值差异很小。

债权投资按如下原则确定公允价值：(i) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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。(ii) 当金融工具不存在活跃市场，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。(iii) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》的有关规定，本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值；本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。于2022年6月30日，本基金持有的上述投资的公允价值均属于第二层次。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,242,585,663.28	99.97
	其中：债券	5,242,585,663.28	99.97
	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	1,659,490.59	0.03
8	其他各项资产	-	-
9	合计	5,244,245,153.87	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沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

## 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

本基金本报告期末未买入股票。

### 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

本基金本报告期末未卖出股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

## 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,242,585,663.28	124.04
	其中：政策性金融债	4,168,458,177.34	98.62
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	5,242,585,663.28	124.04

#### 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	190214	19 国开 14	21,200,000	2,163,173,742.79	51.18
2	170212	17 国开 12	10,200,000	1,054,137,749.10	24.94
3	190308	19 进出 08	8,600,000	878,838,440.34	20.79
4	1928034	19 交通银行 01	4,000,000	407,101,112.42	9.63
5	1928017	19 兴业绿色金融 01	3,900,000	400,756,635.61	9.48

#### 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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 本报告期投资基金情况

### 7.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

## 7.13 投资组合报告附注

7.13.119 浙商银行绿色金融浙商银行股份有限公司 2021 年 10 月 29 日收到中国人民银行的行政处罚（银罚字(2021)27 号）、2022 年 3 月 25 日收到中国银行保险监督管理委员会出具的银保监罚决字(2022)27 号，主要内容为：

银罚字(2021)27 号：违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定。罚款 65 万元。

银保监罚决字(2022)27 号：一、漏报逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据；二、漏报贸易融资业务 EAST 数据；三、漏报抵押物价值 EAST 数据；四、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据；五、债券投资业务 EAST 数据存在偏差；六、未报送权益类投资业务 EAST 数据；七、未报送私募基金投资业务 EAST 数据；八、漏报投资资产管理产品业务 EAST 数据；九、漏报贷款承诺业务 EAST 数据；十、EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；十一、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；十二、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；十三、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；十四、EAST 系统《个人活期存款分户账明细记录》表错报；十五、EAST

系统《表外授信业务》表错报。处罚结果：罚款 380 万元。

基金管理人按照内部研究工作规范对该发行主体进行分析后将其列入基金投资对象备选库并跟踪研究。该处罚事件发生后，基金管理人密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

19 兴业绿色金融 01 (1928017.IB) 的发行主体兴业银行股份有限公司于 2021 年 8 月 20 日收到中国人民银行行政处罚（银罚字〔2021〕26 号）、于 2022 年 3 月 25 日收到中国银行保险监督管理委员会出具银保监罚决字(2022)22 号，主要内容为：

银罚字(2021)26 号：违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定。处罚结果为：罚款 5 万元。

银保监罚决字(2022)22 号：兴业银行监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、漏报贸易融资业务 EAST 数据；二、漏报贷款核销业务 EAST 数据；三、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据；四、漏报权益类投资业务 EAST 数据；五、漏报投资资产管理产品业务 EAST 数据；六、未报送跟单信用证业务 EAST 数据；七、漏报贷款承诺业务 EAST 数据；八、未报送委托贷款业务 EAST 数据；九、EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；十、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；十一、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；十二、漏报分户账 EAST 数据；十三、EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报；十四、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报。处罚结果为：罚款 350 万元。

基金管理人按照内部研究工作规范对该发行主体进行分析后将其列入基金投资对象备选库并跟踪研究。该处罚事件发生后，基金管理人密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

19 交通银行 01 交通银行股份有限公司于 2021 年 7 月 16 日收到中国银行保险监督管理委员会的行政处罚（银保监罚决字(2021)28 号）、于 2021 年 8 月 20 日收到中国人民银行的行政处罚（银罚字(2021)23 号）、2022 年 3 月 25 日收到中国银行保险监督管理委员会出具的银保监罚决字(2022)15 号，主要内容：

银保监罚决字(2021)28 号：一、理财业务和同业业务制度不健全；二、理财业务数据与事实不符；三、部分理财业务发展与监管导向不符；四、理财业务风险隔离不到位，利用本行表内自有资金为本行表外理财产品提供融资；五、理财资金违规投向土地储备项目；六、理财产品相互交易调节收益；七、面向机构投资者发行的理财产品投资不良资产支持证券；八、公募理财产品投资单只证

券超限额；九、理财资金违规投向交易所上市交易的股票；十、理财资金投资非标资产比照贷款管理不到位；十一、私募理财产品销售文件未约定冷静期；十二、开放式公募理财产品资产配置未达到流动性管理监管比例要求；十三、理财产品信息登记不及时；十四、理财产品信息披露不合规；十五、同业业务交易对手名单调整不及时；十六、将同业存款纳入一般性存款核算；十七、同业账户管理不规范；十八、违规增加政府性债务，且同业投资抵质押物风险管理有效性不足；十九、结构性存款产品衍生品交易无真实交易对手和交易行为；二十、未严格审查委托贷款资金来源；二十一、违规向委托贷款借款人收取手续费；二十二、利用理财资金与他行互投不良资产收益权，实现不良资产虚假出表；二十三、监管检查发现问题屡查屡犯。处罚结果：罚款 4,100 万元。

银罚字(2021)23 号：违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定。处罚结果：罚款 62 万元。

银保监罚决字(2022)15 号：一、漏报不良贷款余额 EAST 数据；二、贸易融资业务 EAST 数据存在偏差；三、漏报贷款核销业务 EAST 数据；四、漏报抵押物价值 EAST 数据；五、未报送权益类投资业务 EAST 数据；六、未报送其他担保类业务 EAST 数据；七、EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一；八、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；九、EAST 系统分户账与总账比对不一致；十、EAST 系统《表外授信业务》表错报；十一、EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报；十二、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；十三、EAST 系统《关联关系》表漏报；十四、理财产品登记不规范；十五、2018 年行政处罚问题依然存在。处罚结果：罚款 420 万元。

基金管理人按照内部研究工作规范对该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。

该处罚事件发生后，基金管理人密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

19 招商银行小微债 01(1928015.IB)的发行主体招商银行股份有限公司于 2022 年 3 月 25 日中国银行保险监督管理委员会出具的银保监罚决字(2022)21 号，主要内容为：

银保监罚决字(2022)21 号：一、不良贷款余额 EAST 数据存在偏差；二、漏报贷款核销业务 EAST 数据；三、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据；四、未报送权益类投资业务 EAST 数据；五、未报送投资资产管理产品业务 EAST 数据；六、漏报贷款承诺业务 EAST 数据；七、漏报委托贷款业务 EAST 数据；八、EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；九、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；十、EAST 系统分户账与总账比对不一致；十一、漏报分户账 EAST 数

据；十二、EAST 系统《个人活期存款分户账明细记录》表错报；十三、EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报。处罚结果：罚款 300 万。

基金管理人按照内部研究工作规范对该发行主体进行分析后将其列入基金投资对象备选库并跟踪研究。该处罚事件发生后，基金管理人密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

19 进出 08 中国进出口银行于 2021 年 7 月 16 日收到中国银行保险监督管理委员会出局的处罚（银保监罚决字(2021)31 号）、2022 年 3 月 25 日中国银行保险监督管理委员会出具的银保监罚决字(2022)9 号，主要内容为：

银保监罚决字(2021)31 号：一、违规投资企业股权；二、个别高管人员未经核准实际履职；三、监管数据漏报错报；四、违规向地方政府购买服务提供融资；五、违规变相发放土地储备贷款；六、向用地未获国务院批准的项目发放贷款；七、违规开展租金保理业务变相支持地方政府举债；八、租金保理业务基础交易不真实；九、向租赁公司发放用途不合规的流动资金贷款；十、违规向个别医疗机构新增融资；十一、个别并购贷款金额占比超出监管上限；十二、借并购贷款之名违规发放股权收购贷款；十三、违规向未取得“四证”的固定资产项目发放贷款；十四、违规发放流动资金贷款用于固定资产投资；十五、授信额度核定不审慎；十六、向无实际用款需求的企业发放贷款导致损失；十七、突破产能过剩行业限额要求授信；十八、项目贷款未按规定设定抵质押担保；十九、贷款风险分类不审慎；二十、信贷资产买断业务贷前调查不尽职；二十一、向借款人转嫁评估费用；二十二、同业业务交易对手名单制管理落实不到位；二十三、贸易背景审查不审慎；二十四、对以往监管通报问题整改不到位。处罚结果为：罚没 7345.6 万元。

银保监罚决字(2022)9 号：一、漏报不良贷款余额 EAST 数据；二、漏报逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据；三、漏报贸易融资业务 EAST 数据；四、漏报贷款核销业务 EAST 数据；五、漏报抵押物价值 EAST 数据；六、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据；七、漏报债券投资业务 EAST 数据；八、漏报权益类投资业务 EAST 数据；九、漏报投资资产管理产品业务 EAST 数据；十、漏报跟单信用证业务 EAST 数据；十一、漏报贷款承诺业务 EAST 数据；十二、未报送委托贷款业务 EAST 数据；十三、EAST 系统分户账与总账比对不一致；十四、漏报分户账 EAST 数据；十五、EAST 系统《对公活期存款分户账明细记录》表错报；十六、EAST 系统《关联关系》表漏报；十七、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报。处罚结果：罚款 420 万元。

基金管理人按照内部研究工作规范对该发行主体进行分析后将其列入基金投资对象备选库并跟踪研究。该处罚事件发生后，基金管理人密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

19 国开 14、17 国开 12、国开 1901 国家开发银行有限公司于 2022 年 3 月 25 日收到中国银行保险监督管理委员会出具的银保监罚决字(2022)8 号,主要内容为:一、未报送逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据;二、漏报贸易融资业务 EAST 数据;三、漏报贷款核销业务 EAST 数据;四、信贷资产转让业务 EAST 数据存在偏差;五、未报送债券投资业务 EAST 数据;六、漏报权益类投资业务 EAST 数据;七、漏报跟单信用证业务 EAST 数据;八、漏报保函业务 EAST 数据;九、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差;十、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差;十一、漏报分户账 EAST 数据;十二、漏报授信信息 EAST 数据;十三、EAST 系统《表外授信业务》表错报;十四、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报;十五、EAST 系统《关联关系》表漏报;十六、EAST 系统《对公信贷分户账》表漏报;十七、理财产品登记不规范。处罚结果:罚款 440 万元。

基金管理人按照内部研究工作规范对该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。该处罚事件发生后，基金管理人密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

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

7.13.2 本基金未投资超出基金合同规定的备选股票库。

#### 7.13.3 期末其他各项资产构成

无

#### 7.13.4 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。

#### 7.13.5 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。

#### 7.13.6 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

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
297	13,804,705.36	4,099,993,000.00	100.00%	4,491.20	0.00%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	2,132.47	0.00%

### 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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：本基金的基金经理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（2019年12月5日）基金份额总额	4,099,997,422.61
本报告期期初基金份额总额	4,099,997,459.96
本报告期基金总申购份额	31.24
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,099,997,491.20

## 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

本报告期基金投资策略无改变。

### 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

本报告期内，本基金的基金管理人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。

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

### 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	
信达证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-

注：（1）报告期内新增或者退租租用证券公司交易单元的情况：新增信达证券（25896）、恒泰证券（37514）。

（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
信达证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-

## 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关于旗下基金执行新金融工具相关会计准则的公告	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	2022-01-01
2	光大保德信基金管理有限公司旗下基金 2021 年 12 月 31 日基金份额净值及累计净值公告	同上	2022-01-01
3	光大保德信尊泰三年定期开放债券型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	同上	2022-01-24
4	光大保德信尊泰三年定期开放债券型证券投资基金分红公告	同上	2022-03-18
5	光大保德信尊泰三年定期开放债券型证券投资基金 2021 年年度报告	同上	2022-03-31
6	光大保德信尊泰三年定期开放债券型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	同上	2022-04-22
7	光大保德信基金管理有限公司关于终止与北京植信基金销售有限公司销售合作关系的公告	同上	2022-06-11

## 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20220101-20220630	999,999,000.00	0.00	0.00	999,999,000.00	24.39%
	2	20220101-20220630	1,499,999,000.00	0.00	0.00	1,499,999,000.00	36.59%
	3	20220101-20220630	999,999,000.00	0.00	0.00	999,999,000.00	24.39%
产品特有风险							
本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过20%的情形，可能面临单一投资者集中赎回							

的情况，从而：

- （1）对基金的流动性造成冲击，存在对剩余投资者的赎回办理造成影响的风险。
- （2）基金管理人因基金赎回的流动性要求致使部分投资受到限制，或因赎回费归入基金资产等原因，而导致基金资产净值波动的风险，影响基金的投资运作和收益水平。
- （3）因基金资产规模过小，而导致部分投资不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略，或导致基金不能满足存续条件的风险。

本管理人将审慎评估大额申购对基金持有集中度的影响，在运作中保持合适的流动性水平，保护持有人利益。

## 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尊泰三年定期开放债券型证券投资基金设立的文件
- 2、光大保德信尊泰三年定期开放债券型证券投资基金基金合同
- 3、光大保德信尊泰三年定期开放债券型证券投资基金招募说明书
- 4、光大保德信尊泰三年定期开放债券型证券投资基金托管协议
- 5、光大保德信尊泰三年定期开放债券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尊泰三年定期开放债券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

### 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

二〇二二年八月三十一日