

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

2023 年第 2 季度报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：光大保德信基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年七月二十一日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 7 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	光大保德信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期
基金主代码	017104
交易代码	017104
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 12 月 1 日
报告期末基金份额总额	367,401,374.34 份
投资目标	本基金通过指数化投资，争取获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	1、指数化投资策略 (1) 抽样复制策略 本基金为被动管理基金，主要采用抽样复制策略，投资于标的指数中具有代表性的部分成份券，或选择非成份券作为替代，使得同业存单投资组合的总体特征（如久期、剩

	<p>余期限分布和到期收益率等)与标的指数相似。此外,本基金可通过参与风险低且可控的债券回购等投资,以弥补基金费用、增加基金收益。</p> <p>(2) 跟踪误差目标策略</p> <p>在正常市场情况下,本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年化跟踪误差控制在 2%以内。如因标的指数编制规则调整、利息税等其他原因,导致基金跟踪偏离度或跟踪误差超过了上述范围,基金管理人应采取合理措施,避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。</p> <p>(3) 替代性策略</p> <p>指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险,且指数编制机构暂未作出调整的,基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则,综合考虑成份券的退市或违约风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响,据此制定成份券替代策略,通过投资其他成份券、非成份券等方式对投资组合进行相应调整。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>为了在一定程度上弥补基金费用,基金管理人还可以在控制风险的前提下,使用债券投资策略。例如,基金管理人可以利用银行间市场与交易所市场,或债券一、二级市场间的套利机会进行跨市场套利;还可以使用事件驱动策略,即通过分析重大事件发生对投资标的定价的影响而进行套利;也可以使用公允价值策略,即通过对债券市场价格与模型价格偏离度的研究,采取相应的增/减仓操作;或运用杠杆原理进行回购交易等。</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</p>
--	---

	<p>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>未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定并履行适当程序后，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。</p>
业绩比较基准	中证同业存单 AAA 指数收益率*95%+银行人民币一年定期存款利率(税后)*5%。
风险收益特征	本基金风险与收益低于股票型基金、偏股混合型基金，高于货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期
	(2023 年 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
1. 本期已实现收益	1,106,260.60
2. 本期利润	1,284,200.60
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0054
4. 期末基金资产净值	371,965,266.06
5. 期末基金份额净值	1.0124

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，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。

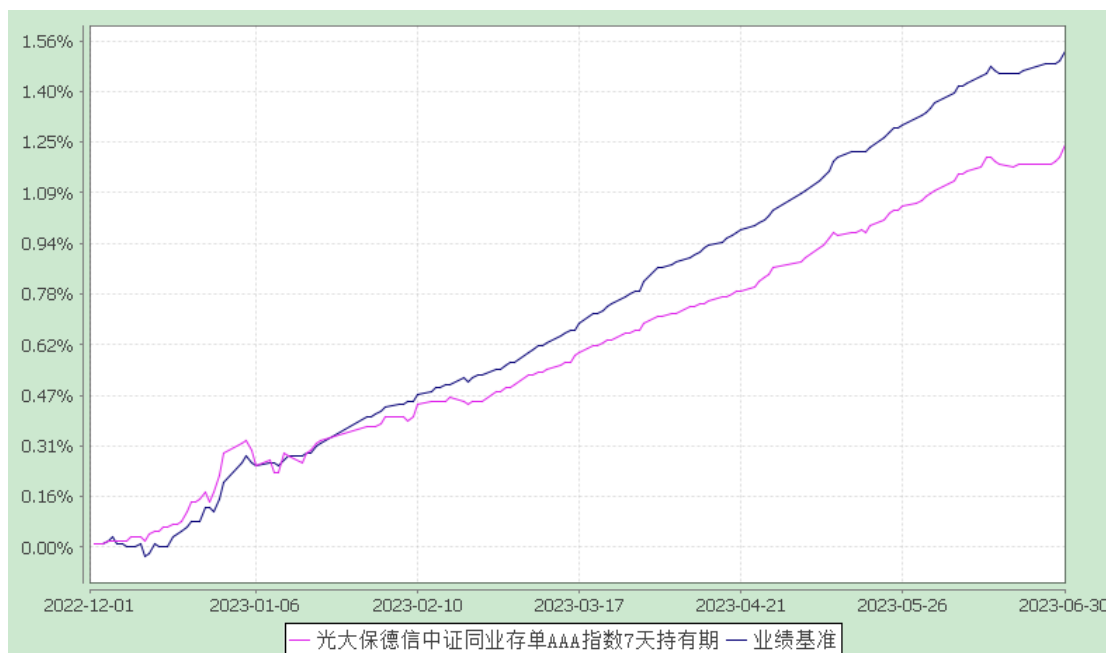
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.55%	0.01%	0.68%	0.01%	-0.13%	0.00%
自基金合同生效起至今	1.24%	0.02%	1.49%	0.01%	-0.25%	0.01%

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

光大保德信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2022 年 12 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日)



注：本基金建仓期为2022年12月1日至2023年5月30日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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	2023-04-22	-	11 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

				<p>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,</p>
--	--	--	--	---

					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。
杨逸君	固收管理总部 固收低风险投资团队 联席团队队长、 基金经理	2022-12-01	-	13 年	杨逸君女士，FRM，2007 年获上海财经大学统计学和工商管理学双学士学位，2010 年获厦门大学数量经济学硕士学位。2010 年 7 月至 2013 年 6 月，在海富通基金管理有限公司主要从事基金产品及证券市场研究分析工作；2013 年 6 月至 2014 年 5 月在建信基金管理有限公司主要从事基金产品及量化投资相关的研究分析工作；2014 年 5 月至 2021 年 8 月在兴业基金管理有限公司历任高级产品经理、基金经理助理、基金经理；2021 年 9 月加入光大保德信基金管理有限公司，现任固收管理总部固收投资（低风险）团队的联席团队队长，2021 年 12 月至 2023 年 5 月担任光大保德信超短债债券型证券投资基金、光大保德信耀钱包货币市场基金的基金经理，2022 年 1 月至 2023 年 7 月担任光大保德信恒利纯债债券型证券投资基金的基金经理，2022 年 12 月至 2023 年 7 月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、光大保德信荣利纯债债券型

					证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--------------

注：1、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；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。

2、杨逸君女士由于个人原因，于2023年7月8日离任，由沈荣先生继续担任本基金基金经理。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观方面，上半年宏观经济运行整体回升向好，市场需求逐步恢复，生产供给持续增加。但市场年初对于经济基本面过于乐观的预期在二季度有所修正，股债汇市场上半年走势较明显反映了这一宏观预期的调整。进入二季度，尽管生产需求恢复的强度有所分化，但物价基

本稳定，预计二季度经济增长同比将保持年内较好水平。进入六月，在六家国有大行集体下调存款利率后，央行公开市场操作利率下降 10bp，随后 MLF 利率下调，最后 LPR 利率跟随调整。我们看到货币政策保持了较为积极的态度，同时六月的数据显示生产端环比开始好转，工业生产的价格数据有所回升。展望下半年，在高质量发展这一重要主题下，预计货币政策仍将继续为经济护航，但信用需求端政策可能仍较难实现粗放式发力，精准的结构政策仍然是主要方向。我们对基本面的判断偏窄幅震荡，经济强势上行取决于政策支持等多方面因素，但随着年内价格和库存等指标的好转，需求端或有望更好的跟进生产端的复苏。

债券市场方面，二季度随着央行的降息，短端收益率下行幅度较长端更为明显，利率债表现好于信用。具体而言，短端 1 年国债和 1 年国开二季度末为 1.87% 和 2.09%，分别下行 36bp 和 29bp。长端 10 年国债和 10 年国开二季度末为 2.69% 和 2.84%，分别下行 16bp 和 18bp。信用债方面，1Y 的 AAA 信用债二季度末收益率为 2.48%，下行 29bp；3Y 的 AAA 和 AA 的信用债二季度末为 2.92% 和 3.46%，分别下行 16bp 和 18bp。

报告期内，本基金审慎把握建投资机会，通过对市场利率走势研判，密切跟踪指数标的成分券，合理分散组合个券集中度，同时通过市场流动性情况灵活运用杠杆策略，提升组合流动性和静态收益。下阶段，本基金将会密切关注国内外经济形势和货币、财政政策的动态，力争在保证资产流动性和安全性的前提下提高组合收益。

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 0.55%，业绩比较基准收益率为 0.70%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-

2	固定收益投资	436,125,156.69	98.62
	其中：债券	436,125,156.69	98.62
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,621,968.61	0.37
7	其他各项资产	4,476,313.29	1.01
8	合计	442,223,438.59	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,563,030.54	8.22

	其中：政策性金融债	30,563,030.54	8.22
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	405,562,126.15	109.03
9	其他	-	-
10	合计	436,125,156.69	117.25

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	200207	20 国开 07	200,000	20,563,178.08	5.53
2	230304	23 进出 04	100,000	9,999,852.46	2.69
3	112322003	23 邮储银行 CD003	100,000	9,998,890.55	2.69
4	112209130	22 浦发银行 CD130	100,000	9,990,514.03	2.69
5	112210248	22 兴业银行 CD248	100,000	9,982,977.10	2.68

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货

5.11 投资组合报告附注

5.11.123 徽商银行 CD025 徽商银行股份有限公司于 2023 年 5 月 30 日收到中国人民银行出具的合银罚决字(2023)16 号，具体内容为：1. 未按规定开展持续的客户身份识别；2. 未按规定开展重新的客户身份识别；3. 未按规定开展客户风险等级划分工作；4. 未按规定对高风险客户采取强化尽职调查；5. 未按规定对异常交易进行人工分析、识别，排除理由不合理，或可疑交易报告理由不完整；6. 为身份不明的客户提供服务。处罚结果：处罚款人民币 431.33 万元。

22 浦发银行 CD130 上海浦东发展银行股份有限公司于 2022 年 9 月 2 日收到国家外汇管理局上海市分局出具的上海汇管罚字〔2022〕3111220601 号，具体内容

为：1、违规办理远期结汇业务；2、违规办理期权交易；3、违规办理内保外贷业务；4、违规办理房产佣金收、结汇业务；5、结售汇统计数据错报。处罚结果：责令改正，给予警告，处罚款 933 万元人民币，没收违法所得 334.69 万元人民币。

22 上海银行 CD143 上海银行股份有限公司于 2023 年 4 月 21 日收到国家外汇管理局上海市分局出具的上海汇管罚字〔2023〕3111221101 号，具体内容为：1、无结售汇业务资质的分支机构违规办理结售汇业务。2、已批准停止营业的分支机构违规办理结售汇业务。3、违规向境外个人销售外币理财产品。4、违规办理内保外贷业务。5、违规办理备用金结汇。6、未按规定报送结售汇统计数据。7、虚增银行间外汇市场交易量。8、使用未经授权的通讯工具开展银行间外汇市场交易以及未按规定保存银行间外汇市场交易记录。处罚结果：给予警告，处罚款 9834.5 万元人民币，没收违法所得 19.9 万元人民币，罚没款合计 9854.4 万元人民币。

22 兴业银行 CD248 兴业银行股份有限公司于 2022 年 10 月 28 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)50 号、于 2022 年 11 月 4 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)41 号、于 2023 年 5 月 8 日收到福建证监局出具的中国证券监督管理委员会福建监管局行政监管措施决定书〔2023〕18 号，主要内容为：

银保监罚决字(2022)41 号：债券承销业务严重违反审慎经营规则。处罚结果：罚款 150 万元。

银保监罚决字(2022)50 号：违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第 21 条，第 46 条。处罚结果：罚款 450 万元。

中国证券监督管理委员会福建监管局行政监管措施决定书〔2023〕18 号：基金销售业务在销售产品准入集中统一管理、基金销售业务数据统计质量等方面存在不足。

22 建设银行 CD149 中国建设银行股份有限公司于 2022 年 11 月 1 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)51 号，于 2022 年 11 月 4 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)44 号，于 2023 年 2 月 17 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(2023)10 号，

主要内容为：

银保监罚决字(2022)51 号：老产品规模在部分时点出现反弹。处罚结果：罚款 200 万元。

银保监罚决字(2022)44 号：一、个人经营贷款挪用至房地产市场二、个人经营贷款“三查”不到位三、总行对分支机构管控不力承担管理责任。处罚结果：罚款 260 万。

银保监罚决字(2023)10 号：一、公司治理和内部控制制度与监管规定不符二、监管发现问题屡查屡犯或未充分整改三、向检查组提供企业出具的虚假证明材料四、未按规定及时报送案件信息五、违规发放房地产贷款六、贷款审查严重不尽职，违规办理虚假按揭贷款七、违规发放固定资产贷款八、违规为地方政府融资平台提供融资，后期以流动资金贷款承接前期融资九、信用卡资金违规流入证券公司十、违反产业政策为“两高一剩”企业提供融资十一、小微企业统计数据与事实不符，企业划型不准确，将大中型企业纳入小微企业统计十二、小微快贷业务违反审慎经营规则十三、违规收取民营企业、小微企业费用十四、违规借贷搭售理财产品十五、精准扶贫小额贷款资金违规归集使用十六、向关系人发放信用贷款十七、违规发放贷款掩盖风险十八、违规变相突破单一法人客户授信额度限制十九、搭桥贷款业务不合规二十、流动资金贷款管理违反审慎经营规则二十一、固定资产贷款管理违反审慎经营规则二十二、并购贷款管理违反审慎经营规则二十三、个人贷款管理严重违反审慎经营规则二十四、理财业务风险隔离不符合监管规定二十五、理财业务投资运作不合规二十六、违规通过理财业务实现不良资产虚假出表二十七、违规虚增资本二十八、面向一般个人客户销售的理财产品资金流向不符合定，违规投资权益类资产二十九、理财产品信息登记不及时，部分产品未登记底层资产三十、理财业务统计数据与事实不符三十一、理财资金投资非标准化债权资产的余额超过监管比例要求三十二、同业投资业务管理违反审慎经营规则三十三、债券投资业务未准确计量风险，个别债券风险加权资产计提比例低于监管要求三十四、串用银行承兑汇票保证金掩盖信用风险三十五、贴现资金违规回流出票人三十六、违规向委托贷款借款人收取手续费三十七、对信用卡业务异常交易行为监控不力导致频繁套现三十八、银行集团并表统一授信管理流于形式。处罚结果：没收违法所得并处罚款合计 19891.5626 万元。其中，总行

7341.5626 万元，分支机构 12550 万元。

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

22 农业银行 CD080

中国农业银行股份有限公司于 2022 年 11 月 1 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)52 号，主要内容为：一，作为托管机构，存在未及时发现理财产品投资集中度超标情况；二，理财托管业务违反资产独立性原则要求，操作管理不到位。处罚结果：罚款 150 万元。

22 中国银行 CD036 中国银行股份有限公司于 2022 年 6 月 2 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)29 号、于 2023 年 2 月 16 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(2023)5 号，于 6 月 21 日收到中国银行保险监督管理委员会出具的沪银保监罚决字(2023)84 号，主要内容为：银保监罚决字(2022)29 号：中国银行理财业务存在以下违法违规行为，老产品规模在部分时点出现反弹，罚款 200 万元；

银保监罚决字(2023)5 号：一、小微企业贷款风险分类不准确；二、小微企业贷款资金被挪用于房地产领域；三、贷款资金被挪用于证券市场；四、小微企业贷款资金被挪用于购买本行理财；五、小微企业贷款统计数据不真实；六、向银行员工和公务员发放个人经营性贷款；七、违反监管规定向小微企业客户收取承诺费、咨询费，处罚结果：对总行罚款 1600 万元，对分支机构罚款 1680 万元，合计罚款 3280 万元。

沪银保监罚决字(2023)84 号：1. 2020 年 11 月至 2021 年 5 月，该单位违反规定从事未经批准的业务活动。2. 2020 年 4 月，该单位违规超授权交易。3. 2019 年 6 月至 2021 年 2 月，该单位同业业务超期限。责令改正，并处罚没款共计 696.9076 万元。

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

5.11.2 本基金未投资超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
----	----	-------

1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,476,313.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,476,313.29

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	249,838,298.63
报告期期间基金总申购份额	732,296,896.10
减：报告期期间基金总赎回份额	614,733,820.39
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	367,401,374.34

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期内基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在持有、申购、赎回或买卖本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期不存在单一投资者持有基金份额比例超过20%的情形。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准光大保德信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金设立的文件
- 2、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基金合同
- 3、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招募说明书
- 4、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托管协议
- 5、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中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢（北区 3 号楼），6-7 层、10 层。

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。投资者对本报告书如有疑问，可咨询本

基金管理人。客户服务中心电话:4008-202-888,021-80262888。公司网址:www.epf.com.cn。

光大保德信基金管理有限公司

二〇二三年七月二十一日