光大保德信优势配置混合型证券投资基金

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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商银行股份有限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 7
2.4 信息披露方式 7
2.5 其他相关资料 8
3 主要财务指标和基金净值表现 8
3.1 主要会计数据和财务指标 8
3.2 基金净值表现 9
4 管理人报告 11
4.1 基金管理人及基金经理情况 11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 15
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 15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 17
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 18
5 托管人报告 18
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 18
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 18
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 18
6 半年度财务会计报告（未经审计） 18
6.1 资产负债表 18
6.2 利润表 20
6.3 净资产（基金净值）变动表 21
6.4 报表附注 22
7 投资组合报告 45
7.1 期末基金资产组合情况 45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 46
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 47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 50
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 51
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 51
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 51
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 51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 52
7.12 投资组合报告附注 52
8 基金份额持有人信息 53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 53

8.2 盈利投资者数量占比 53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 53
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 54
9 开放式基金份额变动 54
10 重大事件揭示 54
10.1 基金份额持有人大会决议 54
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 54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 55
10.4 基金投资策略的改变 55
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 55
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 55
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 55
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 55
10.9 其他重大事件 58
11 影响投资者决策的其他重要信息 59
12 备查文件目录 60
12.1 备查文件目录 60
12.2 存放地点 60
12.3 查阅方式 60

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	光大保德信优势配置混合型证券投资基金	
基金简称	光大保德信优势配置混合	
基金主代码	360007	
交易代码	360007	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2007 年 8 月 24 日	
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,061,449,279.55 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	光大保德信优势配置混合 A	光大保德信优势配置混合 C
下属分级基金的交易代码	360007	018077
报告期末下属分级基金的份额总额	1,061,185,781.26 份	263,498.29 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金追求投资回报的实现，在严格管理风险的基础上，根据证券市场的变化进行行业配置，通过科学投资争取为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的回报。
投资策略	本基金为追求绝对收益的基金，强调在敏锐把握证券市场和中国经济变化方向的基础上，适当配置资产在各类证券和行业之间的比重，通过收益管理和稳健的投资操作为基金份额持有人谋取超过业绩比较基准的稳定回报。 1、资产配置策略 （1）宏观经济运行的变化和国家的宏观调控政策将对证券市场产生深刻影响。本基金通过综合国内外宏观经济状况、国家财政政策、央行货币政策、物价水平变化趋势等因素，构建宏观经济分析平台； （2）运用历史数据并结合光大保德信内部的定性和定量分析模型，确定影响各类资产收益水平的先行指标，将上一步的宏观经济分析结果量化为对先行指标的影响，进而判断对各类资产收益的影响； （3）结合上述宏观经济对各类资产未来收益影响的分析结果和本基金投资组合的风险预算管理，确定各类资产的投资比重。 2、股票类品种投资策略 （1）行业配置策略 在行业配置方面，本基金将主要投资于国家重点支柱型产业。由于国家重点支柱产业代表了未来中国经济的发展方向，为中国经济的增长提供了强劲的动力，因此，这些行业必将随着中国经济的高速发展而发展，处于这些产业中的上市公司具有业务增长快、盈利能力持续稳健上升的特点。

	在具体的行业选择上，本基金将从三个维度进行考虑：一是从全球产业分工和全球化背景下我国的比较优势角度；二是从国家的宏观经济调控和产业政策角度，即行业发展受国民经济发展的拉动作用的大小；三是从行业竞争状况、盈利状况、行业所处生命周期和行业平均市盈率、市净率、等角度进行敏感度分析。在以上综合分析的基础上，利用公司开发的树状集群评价体系选择出本基金投资的重点考虑行业。 树状集群行业分析体系是本基金行业分析及配置的主要工具，该体系利用定量和定性指标对不同行业进行重点因素分析。在定量方面主要利用行业投资回报（行业平均的资本回报率等）、行业盈利状况（行业平均的利润率等）、行业估值水平等指标；在定性方面则重点考虑利用行业周期阶段、行业竞争状况、产业政策、行业进入壁垒、买方议价能力等指标。 （2）个股选择策略 在个股选择上，本基金将主要投资于以上确定的目标行业内按总市值排名前三分之一的大盘绩优股。 A．根据上市公司的财务指标、公司管理的规范程度等相关信息对目标行业的上市公司进行筛选，从而形成一级股票池。所选择的财务指标主要为能够反映上市公司盈利能力、增长速度和财务安全性的指标，具体包括：市盈率、市净率、每股收益、净资产收益率、销售毛利率、存货周转率、应收账款周转率、总资产增长率、主营业务收入增长率、主营业务利润增长率、净利润增长率、资产负债率、流动比率、速动比率、已获利息覆盖率等。公司管理的规范程度主要参考最近几年有无重大违法违规事件发生、财务报告有无重大问题、公司管理层是否出现较大变动等方面。 B．在一级股票池基础上，本基金管理人将结合相关研究报告和实地调研结果，在光大保德信内部定量模型和定性分析体系的支持下，筛选出备选股票，作为二级股票池。 C．对二级股票池中的股票进行相关性分析，并结合其他的定量分析模型确定出投资组合，在有效分散风险的前提下，为基金份额持有人获取尽可能高的稳健回报。 D．通过光大保德信股票实时跟踪模型，对投资组合内的目标公司进行实时跟踪，当目标股票价格跌入估值水平以下时发出购买信号。 此外，考虑到一、二级市场的价差带来的套利机会，本基金将在分析新发行股票内在价值的基础上、在基金合同规定的额度内积极参与新股申购，为投资者获取稳定的套利回报。 （3）存托凭证的投资策略 本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。 3、固定收益类品种投资策略 固定收益类品种的投资追求在严格控制风险基础上获取稳健回报的原则。 （1）本基金采用利率预期调整方法作为本基金固定收益类证券投资的核心策略。通过宏观经济分析平台把握市场利率水平的运行态势,作为组合久期选择的主要依据； （2）根据各子类品种的收益水平和对利率的敏感性等指标确定各子类资产的配置比重； （3）在利率预期调整方法基础上,通过分析个券的剩余期限与收益率的配比状况、信用等级状况、流动性指标等因素,选择风险收益配比最合理的个券作为投资对象,并形成组合；

	（4）根据基金申购、赎回等情况，对投资组合进行流动性管理，确保基金资产的变现能力。 基金经理将根据市场的实际情况及基金的申购赎回状况，将部分资产投资于央行票据、债券回购等短期金融工具或保留为现金。同时基金经理将适时的通过回购（逆回购）等资产调控工具，提高基金资产的使用效率。 4、权证投资策略 除了本基金被动持有股权分置改革而发行的权证外,也将根据基金管理人对权证价值的判断,以及各类其它金融衍生品种的投资特性，在进行充分风险控制和遵守中国证监会相关法律规定的基础上,适当投资,为基金持有人谋求收益,减少风险。 本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则,根据证券市场实际情况对上述投资策略及投资组合构建流程进行非实质性的调整,此类变更不需经过基金份额持有人大会通过。
业绩比较基准	75%×沪深 300 指数＋25%×中证全债指数。
风险收益特征	本基金为主动操作的混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。本基金力争在科学的风险管理的前提下，谋求实现基金财产的安全和增值。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	高顺平	张姗
	联系电话	（021）80262888	400-61-95555
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4008-202-888	400-61-95555
传真		（021）80262468	0755-83195201
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		200010	518040
法定代表人		高瑞东	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告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、招商银行股

	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（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）	
	光大保德信优势配置混合 A	光大保德信优势配置混合 C
本期已实现收益	104,173,365.70	18,088.08
本期利润	266,875,226.39	44,645.01
加权平均基金份额本期利润	0.2859	0.3063
本期加权平均净值利润率	35.77%	38.42%
本期基金份额净值增长率	38.66%	39.34%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2026 年 6 月 30 日)**	
	光大保德信优势配置混合 A	光大保德信优势配置混合 C
期末可供分配利润	-9,107,674.54	-2,705.71
期末可供分配基金份额利润	-0.0086	-0.0103
期末基金资产净值	1,052,078,106.72	260,792.58
期末基金份额净值	0.9914	0.9897
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2026 年 6 月 30 日)**	
	光大保德信优势配置混合 A	光大保德信优势配置混合 C
基金份额累计净值增长率	48.15%	30.55%

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（2）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（3）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

光大保德信优势配置混合 A

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
过去三个月	41.29%	1.92%	9.25%	0.94%	32.04%	0.98%
过去六个月	38.66%	1.80%	6.33%	0.85%	32.33%	0.95%
过去一年	57.02%	1.58%	20.06%	0.76%	36.96%	0.82%
过去三年	34.26%	1.39%	26.70%	0.83%	7.56%	0.56%
过去五年	-12.02%	1.45%	3.68%	0.83%	-15.70%	0.62%
过去七年	13.68%	1.40%	34.68%	0.87%	-21.00%	0.53%
过去十年	15.38%	1.42%	61.22%	0.86%	-45.84%	0.56%
自基金合同生效起至今	48.15%	1.53%	33.39%	1.16%	14.76%	0.37%

光大保德信优势配置混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	41.47%	1.92%	9.25%	0.94%	32.22%	0.98%
过去六个月	39.34%	1.81%	6.33%	0.85%	33.01%	0.96%
过去一年	57.85%	1.58%	20.06%	0.76%	37.79%	0.82%
过去三年	34.11%	1.39%	26.70%	0.83%	7.41%	0.56%
自基金合同生效起至今	30.55%	1.39%	23.50%	0.81%	7.05%	0.58%

注：为更好地反映债券市场整体运行情况和本基金管理人旗下相关基金投资组合的运作情况，经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，自 2014 年 1 月 1 日起，将本基金的业绩比较基准由原“75%×沪深 300 指数＋25%×天相国债全价指数”变更为“75%×沪深 300 指数＋25%×中证全债指数”。

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

光大保德信优势配置混合型证券投资基金

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

（2007 年 8 月 24 日至 2026 年 6 月 30 日）

光大保德信优势配置混合 A

光大保德信优势配置混合 C

注：本基金 C 类份额设立于 2023 年 3 月 13 日。

为更好地反映债券市场整体运行情况和本基金管理人旗下相关基金投资组合的运作情况，经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，自 2014 年 1 月 1 日起，将本基金的业绩比较基准由原“75%×沪深 300 指数＋25%×天相国债全价指数”变更为“75%×沪深 300 指数＋25%×中证全债指数”。

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,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		
房雷	权益管理总部权益投资团队团队长、基金经理	2026-02-14	-	17 年	房雷先生，2007 年毕业于哈尔滨工业大学获得信息与计算科学专业的学士学位，2009 年获得哈尔滨工业大学概率论与数理统计专业的硕士学位。2009 年 6 月至 2013 年 4 月在江海证券先后担任研究发展部宏观策略分析师、投资部高级研究员，2013 年 5 月至 2015 年

					6 月在平安证券担任综合研究所策略研究组组长兼平安银行私人银行投资决策委员会委员，2015 年 6 月加入光大保德信基金管理有限公司，历任策略分析师、研究总监助理，现任权益管理总部权益投资团队团队长兼首席策略分析师、基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 1 月担任光大保德信红利混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2019 年 8 月担任光大保德信永鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 1 月至 2019 年 7 月担任光大保德信安祺债券型证券投资基金的基金经理，2018 年 5 月至 2019 年 11 月担任光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2024 年 1 月担任光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金（已清盘）的基金经理，2019 年 12 月至今担任光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2020 年 5 月至 2023 年 3 月担任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（已清盘）的基金经理，2020 年 5 月至 2021 年 12 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，2020 年 10 月至今担任光大保德信景气先锋混合型证券投资基金的基金经理，2021 年 8 月至今担任光大保德信产业新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2022 年 8 月至今担任光大保德信新机遇混合型证券投资基金的基金经理，2026 年 2 月至今担任光大保德信高端装备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、光大保德信优势配置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的基金经理。
林晓凤	基金经理	2022-12-0	2026-02-14	23 年	林晓凤女士，复旦大学国际金融系

		3			硕士。2003 年至 2016 年在兴业证券股份有限公司担任证券投资部研究员、投资经理、总助、副总监、兴证投资子公司常务副总；2016 年 6 月加入光大保德信基金管理有限公司，历任专户投资部总监，2016 年 12 月至 2018 年 9 月担任光大保德信多策略价值收益 1 号资产管理计划的投资经理，2017 年 6 月至 2018 年 9 月担任光大保德信多策略价值收益 2 号资产管理计划的投资经理，2017 年 11 月至 2018 年 9 月担任光大保德信光耀量化对冲 1 号资产管理计划、光大保德信光耀量化对冲 2 号资产管理计划的投资经理，2018 年 3 月至 2018 年 9 月担任光大保德信多策略掘金价值 1 号资产管理计划的投资经理，现任职于权益管理总部，2018 年 10 月至 2022 年 10 月担任光大保德信一带一路战略主题混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 11 月至 2020 年 7 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 11 月至 2022 年 8 月担任光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2020 年 10 月至 2026 年 2 月担任光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金的基金经理，2022 年 12 月至 2026 年 2 月担任光大保德信优势配置混合型证券投资基金的基金经理，2023 年 12 月至 2026 年 2 月担任光大保德信高端装备混合型证券投资基金的基金经理，2024 年 9 月至 2026 年 2 月担任光大保德信睿盈混合型证券投资基金的基金经理。

注：对基金的非首任基金经理，其任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

4.1.3 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遵规守信情况的说明

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

上半年资本市场整体上呈现波动但结构上赚钱效应较强的特征，一季度市场受到外部环境影响波动较大，二季度市场主要是 AI 硬科技为核心的结构行情。上半年整体上通信和电子行业成为上半年上涨最多的行业，其中，CPO、PCB、半导体设备零部件等细分产业成为市场的核心关注点。与之相反，众多传统消费行业诸如食品饮料、互联网消费，以及传统周期性行业与房地产产业链，呈现非常明显的下行调整。市场巨大的“K”型分化引发了激烈的讨论，分化背后本质上是产业景气度的巨大差异。国内外 AI 产业在上半年继续快速发展，并且拉动了众多领域比如数据基础设施、半导体产业等需求的快速增长，映射到资本市场，全球主要市场均在投资交易 AI 硬件。

我们上半年对 AI 产业前景判断相对乐观，尤其是结构上我们更看好国内产业链。我们也关注其他的优秀成长行业，诸如创新药、其产业在全球的竞争力在大幅提升，而不仅仅是 BD 的高增长；以及机器人产业也可能逐步迎来放量阶段。上半年我们主要在国产 AI 包括算力、半导体等产业链，以及创新药和部分机器人领域做了一定的配置。

具体操作上，我们一季度主要关注一些 AI 应用的变化，二季度更加侧重于国产算力的配置，整体上看，报告期内，我们对产品持仓做出了一定的调整：1）主要积极关注国内半导体产业链尤其半导体设备相关资产。因为 AI 产业的发展最终将会带动半导体算力、存储、模拟等各领域需求的增长，而最大的瓶颈是产能问题，其扩产周期叠加国产化加速周期会带动半导体设备零部件的高景气。2）另外，我们也适当关注了机器人、云设施和创新药板块的配置价值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内本基金 A 份额净值增长率为 38.66%，业绩比较基准收益率为 6.33%，C 份额净值增长率为 39.34%，业绩比较基准收益率为 6.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为国内宏观经济保持稳定，内需的波动性逐步收敛，宏观政策已保持平稳；外部宏观波动性加大，过去数年的宽松政策逐步收敛，部分经济体可能转向货币偏紧的环境，这会对市场造成一定的流动性负面影响。对 A 股市场而言，上半年大涨的 AI 硬科技在 7 月份大幅调整，双创指数同步大幅回调，而上半年表现较弱部分低估值行业则呈现轮动的估值修复。站在当下，从估值性价比的角度看，市场来到一个新的均衡状态。我们认为下半年的市场依旧有较多的投资机会可以挖掘。

硬科技的大幅调整，反映了高位状态下投资者对于未来 AI 资本支出的潜在担忧，本质上是高景气预期与高拥挤结构的自我调整。AI 产业依旧在不断发展，有基本面支撑的细分领域在调整后可能提供较好的机会，但需要精挑细选，结构性可能更重要。相比较而言，国内 AI 模型迭代加快，资本支出高增长的确定性更高，因此，对于国内科技产业链，包括半导体算力以及部分 AI 应用端，我们认为当下的性价比更高。

站在中期的视角，我们对于国内的半导体和创新药两个方向都比较看好，这是真正受益于国内科学家红利的产业。前者是数学和物理学科在工程学上的突破，当前正处于产品国产替代提速与出海开始的阶段；后者反映了生物学和化学在应用上的进步，当前正出于研发管线出海爆发的阶段。

另外，一些低估值的领域，诸如大消费、红利等在下半年也会有一定的投资机会。整体上看下半年市场会相对更加均衡一些。

我们对中国资本市场的长期发展十分有信心。本基金将会在具备竞争优势和成长潜力的行业深度耕耘，努力为投资者创造更好的投资回报，力争分享中国新时代的红利。

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

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本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

托管人声明：招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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：光大保德信优势配置混合型证券投资基金

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	58,168,385.74	43,789,743.14
结算备付金		3,347,719.62	2,298,070.02
存出保证金		288,113.87	361,830.76

交易性金融资产	6.4.7.2	995,745,342.30	633,459,328.38
其中：股票投资		937,338,885.70	591,883,401.86
基金投资		-	-
债券投资		58,406,456.60	41,575,926.52
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	130,741.55
应收股利		-	-
应收申购款		75,936.83	4,235.41
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,057,625,498.36	680,043,949.26
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		1,414,494.66	6,610,441.94
应付赎回款		1,930,880.18	1,477,251.14
应付管理人报酬	6.4.10.2.1	932,885.55	669,154.84
应付托管费	6.4.10.2.2	155,480.92	111,525.81
应付销售服务费	6.4.10.2.3	58.71	13.35
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,138.65	788.01
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	850,660.39	872,277.23
负债合计		5,286,599.06	9,741,452.32
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,061,449,279.55	937,443,331.41
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-9,110,380.25	-267,140,834.47
净资产合计		1,052,338,899.30	670,302,496.94
负债和净资产总计		1,057,625,498.36	680,043,949.26

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9914 元，基金份额总额 1,061,449,279.55 份。其中 A 类基金份额净值 0.9914 元，份额总额 1,061,185,781.26 份；C 类基金份额净值 0.9897 元，份额总额 263,498.29 份。

6.2 利润表

会计主体：光大保德信优势配置混合型证券投资基金

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	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		272,196,468.42	5,920,246.83
1.利息收入		116,178.85	122,000.31
其中：存款利息收入	6.4.7.9	116,178.85	120,490.35
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		-	1,509.96
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		109,334,118.88	11,399,893.04
其中：股票投资收益	6.4.7.10	109,479,904.54	5,785,223.98
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-1,716,480.83	186,252.45
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,570,695.17	5,428,416.61
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	162,728,417.62	-5,608,843.86
4.汇兑收益（损失以“一”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	17,753.07	7,197.34
减：二、营业总支出		5,276,597.02	4,792,666.73
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	4,422,544.06	4,003,811.76
2．托管费	6.4.10.2.2	737,090.68	667,301.94
3．销售服务费	6.4.10.2.3	227.27	1,145.12
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7．税金及附加		807.20	5.87
8．其他费用	6.4.7.20	115,927.81	120,402.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**266,919,871.40**	**1,127,580.10**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**266,919,871.40**	**1,127,580.10**
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		266,919,871.40	1,127,580.10

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：光大保德信优势配置混合型证券投资基金

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	937,443,331.41	-	-267,140,834.47	670,302,496.94
二、本期期初净资产	937,443,331.41	-	-267,140,834.47	670,302,496.94
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	124,005,948.14	-	258,030,454.22	382,036,402.36
（一）、综合收益总额	-	-	266,919,871.40	266,919,871.40
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	124,005,948.14	-	-8,889,417.18	115,116,530.96
其中：1.基金申购款	243,005,992.74	-	-31,223,691.85	211,782,300.89
2.基金赎回款	-119,000,044.60	-	22,334,274.67	-96,665,769.93
（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）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,061,449,279.55	-	-9,110,380.25	1,052,338,899.30
项目		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	1,072,212,506.36	-	-395,800,028.70	676,412,477.66
二、本期期初净资产	1,072,212,506.36	-	-395,800,028.70	676,412,477.66

三、本期增减变动额（减少以“–”号填列）	-61,061,931.43	-	23,036,630.94	-38,025,300.49
（一）、综合收益总额	-	-	1,127,580.10	1,127,580.10
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-61,061,931.43	-	21,909,050.84	-39,152,880.59
其中：1.基金申购款	10,555,079.37	-	-3,695,718.87	6,859,360.50
2.基金赎回款	-71,617,010.80	-	25,604,769.71	-46,012,241.09
（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）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,011,150,574.93	-	-372,763,397.76	638,387,177.17

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

光大保德信优势配置混合型证券投资基金（原名光大保德信优势配置股票型证券投资基金）（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2007]223 号文《关于同意光大保德信优势配置股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人光大保德信基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2007 年 8 月 24 日正式生效，首次设立募集规模为 9,905,973,604.86 份基金份额。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及注册登记机构为光大保德信基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。根据基金管理人光大保德信基金管理有限公司于 2023 年 3 月 10 日发布的《关于光大保德信优势配置混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告》，自 2023 年 3 月 13 日起，本基金增加 C 类基金份额。

根据 2014 年 8 月 8 日实行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》，经与基金托管人招商银

行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，自 2015 年 7 月 17 日起将本基金变更为光大保德信优势配置混合型证券投资基金。

本基金为混合型基金，投资范围包括国内依法发行、上市的股票、存托凭证、债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

股票及存托凭证资产占基金资产不少于 60%，最高可达基金资产的 90%，现金或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证不超过基金资产净值的 3%。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。今后在有关法律法规许可时，本基金资产配置比例可作相应调整，股票及存托凭证资产投资比例可达到法律法规有关规定的限额。

本基金业绩比较基准为：75%×沪深 300 指数+25%×中债全债指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

6.4.6.2 增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 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》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品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，公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税；本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为适用简易计税方法，按照 3%的征收率计算缴纳增值税；

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，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。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 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。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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	58,168,385.74
等于：本金	58,162,307.60
加：应计利息	6,078.14
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	58,168,385.74

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			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		728,896,983.30	-	937,338,885.70	208,441,902.40
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	57,831,914.00	565,996.60	58,406,456.60	8,546.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	57,831,914.00	565,996.60	58,406,456.60	8,546.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		786,728,897.30	565,996.60	995,745,342.30	208,450,448.40

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末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	1,694.68
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	625,746.16
其中：交易所市场	625,746.16
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	34,712.18
预提信息披露费	179,507.37
预提账户维护费	9,000.00
合计	850,660.39

6.4.7.7 实收基金

光大保德信优势配置混合 A

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	账面金额
上年度末	937,388,676.76	937,388,676.76
本期申购	242,457,706.20	242,457,706.20
本期赎回（以“-”号填列）	-118,660,601.70	-118,660,601.70
本期末	1,061,185,781.26	1,061,185,781.26

光大保德信优势配置混合 C

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	账面金额
上年度末	54,654.65	54,654.65
本期申购	548,286.54	548,286.54
本期赎回（以“-”号填列）	-339,442.90	-339,442.90
本期末	263,498.29	263,498.29

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

光大保德信优势配置混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	126,765,832.18	-393,890,831.37	-267,124,999.19
本期期初	126,765,832.18	-393,890,831.37	-267,124,999.19
本期利润	104,173,365.70	162,701,860.69	266,875,226.39
本期基金份额交易产生的变动数	29,688,842.28	-38,546,744.02	-8,857,901.74
其中：基金申购款	52,990,393.48	-84,108,761.53	-31,118,368.05
基金赎回款	-23,301,551.20	45,562,017.51	22,260,466.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	260,628,040.16	-269,735,714.70	-9,107,674.54

光大保德信优势配置混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,148.40	-22,983.68	-15,835.28
本期期初	7,148.40	-22,983.68	-15,835.28
本期利润	18,088.08	26,556.93	44,645.01
本期基金份额交易产生的变动数	39,168.55	-70,683.99	-31,515.44
其中：基金申购款	106,523.78	-211,847.58	-105,323.80
基金赎回款	-67,355.23	141,163.59	73,808.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	64,405.03	-67,110.74	-2,705.71

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	112,493.36
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	3,122.82
其他	562.67
合计	116,178.85

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,354,431,219.57
减：卖出股票成本总额	1,242,884,858.17
减：交易费用	2,066,456.86
买卖股票差价收入	109,479,904.54

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	305,014.51
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,021,495.34
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	-1,716,480.83

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	28,213,714.22
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	29,946,659.53
减：应计利息总额	287,891.06
减：交易费用	658.97
买卖债券差价收入	-2,021,495.34

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

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,570,695.17
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,570,695.17

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	162,728,417.62
——股票投资	162,737,740.62
——债券投资	-9,323.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	162,728,417.62

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	17,753.07
合计	17,753.07

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	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	3,108.26
账户维护费	18,000.00
其他费用	600.00
合计	115,927.81

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(简称“光大保德信”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司(简称“招商银行”)	基金托管人、基金代销机构
光大证券股份有限公司(简称“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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
光大证券	47,654,806.51	1.72%	299,983,670.83	6.81%

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
光大证券	20,771.50	1.72%	12,111.27	1.94%
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
光大证券	130,760.69	6.81%	45,131.76	4.49%

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以未包含印花税、经手费、证管费和过户费等费用的净额列示。

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,422,544.06	4,003,811.76
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,955,002.65	1,793,089.88
应支付基金管理人的净管理费	2,467,541.41	2,210,721.88

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×基金管理费年费率/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。

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	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	737,090.68	667,301.94

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×基金托管费年费率/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。

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		
	光大保德信优势配置混合 A	光大保德信优势配置混合 C	合计
光大保德信	-	21.52	21.52
合计	-	21.52	21.52
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	光大保德信优势配置混合A	光大保德信优势配置混合C	合计
光大保德信	-	17.19	17.19
合计	-	17.19	17.19

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金份额分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值的 0.40%年费率计提。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

H=E×C 类基金销售服务费年费率/当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。

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

本基金本报告期以及上年度可比期间未做银行间市场债券（含回购）的关联交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	光大保德信优势配置混合A	光大保德信优势配置混合C	光大保德信优势配置混合A	光大保德信优势配置混合C
期初持有的基金份额	-	13,639.80	-	13,639.80
期间申购/买入总份额	-	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	-	13,639.80	-	13,639.80
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	5.18%	-	1.27%

注：1.期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

2.基金管理人投资本基金的费率标准与其他同条件的投资者适用的费率标准相一致。

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均未投资本基金。

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		上年度可比期间 2025年1月1日至2025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
招商银行	58,168,385.74	112,493.36	37,479,765.67	114,338.79

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期和上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

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。

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

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301666	大普微	2026-04-08	6 个月	新股流通受限	46.08	463.33	1,011.00	46,586.88	468,426.63	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	963.00	18,951.84	136,254.87	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	4,859.00	49,173.08	134,740.07	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,717.00	16,259.99	120,430.38	-
688781	视涯科技	2026-03-18	6 个月	新股流通受限	22.68	47.61	1,300.00	29,484.00	61,893.00	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,500.00	26,280.00	53,880.00	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	116.00	10,692.88	53,725.40	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	234.00	6,149.52	40,269.06	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6 个月	新股流通	7.82	20.74	1,743.00	13,630.26	36,149.82	-

				受限						
001365	天海电子	2026-05-11	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	719.00	19,549.61	22,511.89	-
688811	有研复材	2026-04-01	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	834.00	5,345.94	20,124.42	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	216.00	5,330.88	18,748.80	-
301669	高特电子	2026-06-02	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	546.00	3,865.68	15,506.40	-
301687	新广益	2025-12-24	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	195.00	4,276.35	15,167.10	-
001393	维通利	2026-05-08	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	387.00	11,757.06	15,089.13	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	96.00	7,524.48	11,689.92	-
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	664.00	7,423.52	11,679.76	-
688816	易思维	2026-02-04	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	177.00	9,903.15	10,106.70	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6 个月	新股流通受限	26.66	50.96	138.00	3,679.08	7,032.48	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	104.00	1,639.04	4,857.84	-
603352	至信股份	2026-01-08	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	112.00	2,450.56	2,858.24	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	72.00	2,411.28	2,442.96	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	134.00	2,462.92	2,248.52	-
60328	林平	2026-0	6 个月	新股	37.88	34.87	46.00	1,742.	1,604.	-

4	发展	2-03		流通受限				48	02	

注：以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	879.53	2026-07-13	890.99	44,165.00	18,662,217.31	38,844,442.45	-

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。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、地方政府债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2025 年 12 月 31 日：0.00%)。

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可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在

基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

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%。

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。

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。本基金的生息资产主要为结算备付金、债券投资、存出保证金及货币资金等。本基金通过监控组合的久期来评估基金面临的利率风险。

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	58,168,385.74	-	-	-	-	-	58,168,385.74
结算备付金	3,347,719.62	-	-	-	-	-	3,347,719.62
存出保证金	288,113.87	-	-	-	-	-	288,113.87
交易性金融资产	-	-	58,406,456.60	-	-	937,338,885.70	995,745,342.30
应收申购款	-	-	-	-	-	75,936.83	75,936.83
资产总计	61,804,219.23	-	58,406,456.60	-	-	937,414,822.53	1,057,625,498.36
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	1,414,494.66	1,414,494.66
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,930,880.18	1,930,880.18

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	932,885.55	932,885.55
应付托管费	-	-	-	-	-	155,480.92	155,480.92
应付销售服务费	-	-	-	-	-	58.71	58.71
应交税费	-	-	-	-	-	2,138.65	2,138.65
其他负债	-	-	-	-	-	850,660.39	850,660.39
负债总计	-	-	-	-	-	5,286,599.06	5,286,599.06
利率敏感度缺口	61,804,219.23	-	58,406,456.60	-	-	932,128,223.47	1,052,338,899.30
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	43,789,743.14	-	-	-	-	-	43,789,743.14
结算备付金	2,298,070.02	-	-	-	-	-	2,298,070.02
存出保证金	361,830.76	-	-	-	-	-	361,830.76
交易性金融资产	-	-	41,575,926.52	-	-	591,883,401.86	633,459,328.38
应收清算款	-	-	-	-	-	130,741.55	130,741.55
应收申购款	-	-	-	-	-	4,235.41	4,235.41
资产总计	46,449,643.92	-	41,575,926.52	-	-	592,018,378.82	680,043,949.26
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	6,610,441.94	6,610,441.94
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,477,251.14	1,477,251.14
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	669,154.84	669,154.84
应付托管费	-	-	-	-	-	111,525.81	111,525.81
应付销售服务费	-	-	-	-	-	13.35	13.35
应交税费	-	-	-	-	-	788.01	788.01

其他负债	-	-	-	-	-	872,277.23	872,277.23
负债总计	-	-	-	-	-	9,741,452.32	9,741,452.32
利率敏感度缺口	46,449,643.92	-	41,575,926.52	-	-	582,276,926.50	670,302,496.94

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

本基金本期末及上年度末持有的交易性固定收益类投资比例较低，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

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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的基金管理人每日对投资组合的行业和个券的集中度进行监控，并定期分析其相对业绩比较基准的偏离度。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，通过压力测试来评估本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日

	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	937,338,885.70	89.07	591,883,401.86	88.30
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	937,338,885.70	89.07	591,883,401.86	88.30

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金未来业绩表现相对业绩基准的波动性与其过去一年的整体水平保持一致。		
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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 1%	增加约 17,266,903.13	增加约 10,976,578.02
	业绩比较基准下降 1%	减少约 17,266,903.13	减少约 10,976,578.02

注：上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

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	897,227,005.84
第二层次	97,250,899.05

第三层次	1,267,437.41
合计	995,745,342.30

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股票、债券等投资，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	权益投资	937,338,885.70	88.63
	其中：股票	937,338,885.70	88.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	58,406,456.60	5.52
	其中：债券	58,406,456.60	5.52
	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	61,516,105.36	5.82
8	其他各项资产	364,050.70	0.03
9	合计	1,057,625,498.36	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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	36,149.82	0.00
C	制造业	731,360,000.24	69.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	185,097,931.66	17.59
J	金融业	20,842,360.00	1.98
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,443.98	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	937,338,885.70	89.07

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资的股票。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	688256	寒武纪	48,617	77,570,854.35	7.37
2	300567	精测电子	241,500	76,700,400.00	7.29
3	688041	海光信息	177,657	65,786,387.10	6.25
4	688536	思瑞浦	150,459	54,780,617.31	5.21
5	002371	北方华创	61,575	54,466,782.00	5.18
6	300454	深信服	548,300	52,746,460.00	5.01
7	300604	长川科技	125,400	42,814,068.00	4.07
8	688072	拓荆科技	44,165	38,844,442.45	3.69
9	688235	百济神州	150,539	38,328,734.79	3.64
10	300750	宁德时代	96,400	37,886,164.00	3.60
11	605358	立昂微	432,600	33,569,760.00	3.19
12	603119	浙江荣泰	491,180	32,584,881.20	3.10
13	300308	中际旭创	24,200	30,734,000.00	2.92
14	688017	绿的谐波	72,485	30,288,582.10	2.88
15	603019	中科曙光	255,200	27,365,096.00	2.60
16	688409	富创精密	87,188	26,701,325.00	2.54
17	688147	微导纳米	161,675	26,171,949.00	2.49
18	002850	科达利	133,500	25,271,550.00	2.40
19	600183	生益科技	122,400	21,224,160.00	2.02
20	300502	新易盛	34,580	20,990,060.00	1.99
21	601628	中国人寿	589,600	20,842,360.00	1.98
22	688313	仕佳光子	109,305	20,183,168.25	1.92
23	600487	亨通光电	139,900	15,296,666.00	1.45
24	300757	罗博特科	24,600	15,227,400.00	1.45
25	600309	万华化学	190,700	13,045,787.00	1.24
26	300124	汇川技术	195,900	12,994,047.00	1.23
27	688630	芯碁微装	22,618	12,426,103.02	1.18
28	002046	国机精工	148,800	10,959,120.00	1.04
29	301666	大普微	1,011	468,426.63	0.04
30	301150	中一科技	2,234	140,987.74	0.01
31	688820	盛合晶微	963	136,254.87	0.01
32	001399	惠科股份	4,859	134,740.07	0.01
33	688809	强一股份	204	127,092.00	0.01
34	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
35	688781	视涯科技	1,300	61,893.00	0.01
36	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.01
37	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01
38	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00

39	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
40	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
41	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
42	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
43	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
44	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
45	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
46	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
47	601112	振石股份	664	11,679.76	0.00
48	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
49	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
50	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
51	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
52	001396	誉帆科技	69	2,443.98	0.00
53	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
54	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
55	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占**期初**基金资产净值比例（%）
1	300454	深信服	69,394,502.98	10.35
2	688041	海光信息	55,814,308.38	8.33
3	688256	寒武纪	45,510,342.30	6.79
4	603119	浙江荣泰	42,878,710.55	6.40
5	300567	精测电子	42,680,167.07	6.37
6	688235	百济神州	38,795,559.46	5.79
7	688147	微导纳米	36,190,463.01	5.40
8	300308	中际旭创	35,948,543.00	5.36
9	688536	思瑞浦	35,573,860.59	5.31
10	002230	科大讯飞	34,694,149.78	5.18
11	002371	北方华创	30,887,029.20	4.61
12	002850	科达利	29,249,637.00	4.36
13	605358	立昂微	29,239,784.00	4.36
14	688676	金盘科技	27,591,470.27	4.12
15	601628	中国人寿	27,362,183.00	4.08
16	300502	新易盛	27,332,045.96	4.08
17	002222	福晶科技	26,070,743.00	3.89
18	002558	巨人网络	25,984,851.00	3.88

19	688017	绿的谐波	25,960,089.80	3.87
20	300757	罗博特科	25,502,809.00	3.80
21	000962	东方钽业	24,837,883.90	3.71
22	301486	致尚科技	24,647,529.88	3.68
23	603019	中科曙光	22,959,718.79	3.43
24	688502	茂莱光学	22,817,148.07	3.40
25	300750	宁德时代	21,511,321.00	3.21
26	600489	中金黄金	20,813,647.00	3.11
27	300604	长川科技	20,268,538.00	3.02
28	002050	三花智控	20,243,785.18	3.02
29	688409	富创精密	20,001,136.00	2.98
30	603286	日盈电子	19,450,150.00	2.90
31	688331	荣昌生物	19,142,035.99	2.86
32	688313	仕佳光子	18,886,062.74	2.82
33	300124	汇川技术	18,772,086.00	2.80
34	301150	中一科技	18,370,625.80	2.74
35	688072	拓荆科技	18,346,930.36	2.74
36	000973	佛塑科技	17,209,393.00	2.57
37	600549	厦门钨业	17,164,604.00	2.56
38	600309	万华化学	15,903,379.75	2.37
39	600487	亨通光电	14,764,829.00	2.20
40	600711	盛屯矿业	14,277,568.00	2.13
41	002340	格林美	14,016,224.00	2.09
42	300662	科锐国际	13,996,458.00	2.09
43	002967	广电计量	13,979,822.00	2.09
44	300378	鼎捷数智	13,900,828.00	2.07

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600301	华锡有色	65,855,271.00	9.82
2	002222	福晶科技	41,725,067.19	6.22
3	600549	厦门钨业	38,968,321.00	5.81
4	600489	中金黄金	37,949,766.85	5.66
5	601126	四方股份	37,597,542.00	5.61
6	300750	宁德时代	36,569,051.00	5.46
7	688322	奥比中光	35,551,381.98	5.30
8	002050	三花智控	33,518,759.00	5.00
9	002230	科大讯飞	31,858,738.45	4.75
10	688981	中芯国际	31,271,610.67	4.67
11	000962	东方钽业	29,777,863.25	4.44

12	002340	格林美	28,917,738.00	4.31
13	301486	致尚科技	28,783,675.82	4.29
14	000807	云铝股份	27,349,197.56	4.08
15	688676	金盘科技	27,310,663.88	4.07
16	601100	恒立液压	27,080,574.00	4.04
17	600418	江淮汽车	24,747,954.00	3.69
18	688147	微导纳米	23,715,793.65	3.54
19	301150	中一科技	23,597,218.97	3.52
20	688502	茂莱光学	21,825,936.81	3.26
21	300308	中际旭创	21,379,571.00	3.19
22	601899	紫金矿业	21,186,445.00	3.16
23	300476	胜宏科技	20,701,649.99	3.09
24	000973	佛塑科技	19,208,016.64	2.87
25	688818	电科蓝天	17,896,391.83	2.67
26	688331	荣昌生物	17,538,226.43	2.62
27	002558	巨人网络	17,469,095.78	2.61
28	603308	应流股份	17,281,263.20	2.58
29	603286	日盈电子	16,133,778.00	2.41
30	600498	烽火通信	15,642,495.00	2.33
31	002126	银轮股份	15,595,783.00	2.33
32	300502	新易盛	15,514,092.00	2.31
33	000831	中国稀土	15,310,704.60	2.28
34	600760	中航沈飞	14,462,761.00	2.16
35	300662	科锐国际	14,307,536.00	2.13
36	300620	光库科技	14,194,645.10	2.12
37	603031	安孚科技	13,712,344.05	2.05

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,425,602,601.39
卖出股票的收入（成交）总额	1,354,431,219.57

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项 “买入股票成本”、 “卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	58,406,456.60	5.55

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	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	58,406,456.60	5.55

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	019792	25 国债 19	578,000	58,406,456.60	5.55

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	288,113.87
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	75,936.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	364,050.70

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明

1	688072	拓荆科技	38,844,442.45	3.69	重大事项停牌

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
光大保德信优势配置混合 A	63,274	16,771.28	232,607,601.53	21.92%	828,578,179.73	78.08%
光大保德信优势配置混合 C	53	4,971.67	13,639.80	5.18%	249,858.49	94.82%
合计	63,327	16,761.40	232,621,241.33	21.92%	828,828,038.22	78.08%

注：1、机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年(2025 年 7 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日)
盈利投资者数量占比	99.53%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	光大保德信优势配置混合 A	47,679.49	0.00%
	光大保德信优势配置混	0.00	0.00%

	合 C		
	合计	47,679.49	0.00%

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

项目	份额级别	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	光大保德信优势配置混合 A	0~10
	光大保德信优势配置混合 C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	光大保德信优势配置混合 A	-
	光大保德信优势配置混合 C	-
	合计	-

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

项目	光大保德信优势配置混合 A	光大保德信优势配置混合 C
基金合同生效日（2007 年 8 月 24 日）基金份额总额	9,905,973,604.86	-
本报告期期初基金份额总额	937,388,676.76	54,654.65
本报告期基金总申购份额	242,457,706.20	548,286.54
减：本报告期基金总赎回份额	118,660,601.70	339,442.90
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,061,185,781.26	263,498.29

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，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金在本报告期内的投资策略未发生改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金报告期内未持有基金。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所情况。

10.7 管理人、托管人及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其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，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

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，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

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	
天风证券股份有限公司	2	589,741,395.49	21.23%	257,067.20	21.23%	-
申万宏源证券有限公司	1	512,253,051.16	18.44%	223,290.93	18.44%	-
国金证券股份有限公司	2	404,856,611.90	14.57%	176,473.30	14.57%	-
兴业证券股份有限公司	1	300,836,597.46	10.83%	131,135.39	10.83%	-
国泰海通证券股份有限公司	2	245,477,765.49	8.84%	107,004.77	8.84%	-

浙商证券股份有限公司	2	230,801,323.29	8.31%	100,605.30	8.31%	-
中信证券股份有限公司	1	229,318,857.15	8.25%	99,958.80	8.25%	-
国信证券股份有限公司	1	205,382,098.07	7.39%	89,526.24	7.39%	-
光大证券股份有限公司	1	47,654,806.51	1.72%	20,771.50	1.72%	-
华福证券股份有限公司	2	12,105,096.33	0.44%	5,276.76	0.44%	-
国投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
金融街证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

注：（1）报告期内租用证券公司交易单元变更情况

本报告期内本基金未新增租用证券交易单元，

本报告期内本基金未撤销租用证券交易单元。

（2）选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

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

基本选择标准如下：

实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币；

财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

经营行为规范，近两年未发生重大违规行为而受到证监会处罚；

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
天风证券股份有限公司	2,560,410.82	4.77%	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	36,434,554.22	67.83%	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	10,702,496.25	19.92%	-	-	-	-

国泰海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	641,503.77	1.19%	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	3,376,899.15	6.29%	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华福证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
金融街证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	光大保德信基金管理有限公司旗下基金 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	2026-01-01

		息披露报纸	
2	光大保德信优势配置混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	同上	2026-01-22
3	光大保德信优势配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	同上	2026-02-14
4	光大保德信优势配置混合型证券投资基金(光大保德信优势配置混合 A)基金产品资料概要更新	同上	2026-02-26
5	光大保德信优势配置混合型证券投资基金(光大保德信优势配置混合 C)基金产品资料概要更新	同上	2026-02-26
6	光大保德信优势配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	同上	2026-02-26
7	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
8	光大保德信优势配置混合型证券投资基金 2025 年年度报告	同上	2026-03-31
9	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
10	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
11	光大保德信优势配置混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	同上	2026-04-22
12	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

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	20260522-20260630	0.00	228,257,247.20	0.00	228,257,247.20	21.50%
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优势配置混合型证券投资基金设立的文件

2、 光大保德信优势配置混合型证券投资基金基金合同

3、 光大保德信优势配置混合型证券投资基金招募说明书

4、 光大保德信优势配置混合型证券投资基金托管协议

5、 光大保德信优势配置混合型证券投资基金法律意见书

6、 光大保德信优势配置混合型证券投资基金财务报表及报表附注

7、 基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程

8、 基金托管人业务资格批件和营业执照

9、 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

光大保德信基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日