

# 光大保德信事件驱动灵活配置混合型证券投资基金

## 2021 年第 2 季度报告

2021 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年七月二十一日

## § 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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 2021 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 光大保德信事件驱动混合   |
| 基金主代码      | 003704  |
| 交易代码       | 003704  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2017 年 1 月 18 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 397,391,050.57 份  |
| 投资目标       | 本基金积极发掘可能对上市公司当前或未来价值产生重大影响各类事件，把握各类事件创造出的投资机会，力争在有效控制风险的前提下为基金份额持有人谋求长期资本增值。 |
| 投资策略       | 本基金将在深入、细致进行数据挖掘和分析的基础上，把握事件性机会带来的超额收益，力争实现资产的稳健增值。                           |

|  |   |
|--|---|
|  | <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金采取积极的大类资产配置策略，通过宏观策略研究，综合考虑宏观经济、国家财政政策、货币政策、企业盈利、市场估值以及市场流动性等方面因素分析判断决定大类资产配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金在积极把握宏观经济变迁、证券市场变化以及证券市场参与各方行为逻辑的基础上，将影响行业和公司投资价值的事件性因素作为投资的主线，执行以事件驱动为核心的投资策略。</p> <p>（1）事件驱动的界定</p> <p>可能会对上市公司二级市场表现有影响的事件范围很广，包括但不限于股权激励、定向增发、重要股东增持、员工持股等，本基金将深入研究这四类事件，共同构成整体的事件驱动投资策略，未来还有更多策略可以不断扩展：</p> <p>1) 股权激励事件的界定</p> <p>股权激励是一种通过经营者获得公司股权形式给予企业经营者一定的经济权利，使他们能够以股东的身份参与企业决策、分享利润、承担风险，从而勤勉尽责地为公司的长期发展服务的一种激励方法。从公司管理实践来看，股权激励对于改善公司治理结构、降低代理成本、提升管理效率，增强公司凝聚力和市场竞争力起到非常积极的作用。</p> <p>2) 定向增发事件的界定</p> <p>定向增发是上市公司向符合条件的少数特定投资和非公开发行股份的行为，是一种再融资操作。上市公司通过定向增发方式融资，进行项目投资、收购资产、发展业务、补充资金等活动，有利于公司的发展。本基金将通过对定增定价、规模、类别、盈利能力等分析，构建投资组合。</p> |
|--|---|

|  |   |
|--|---|
|  | <p>本基金不参与定增，仅在定增预案公告后在二级市场买入。</p> <p>3) 重要股东增持事件的界定</p> <p>重要股东增持是指上市公司的股东、高级管理人员及其亲属，购买自己企业或公司股票的行为，通常理解为上市公司内部人士对本公司发展前景看好，体现了其对公司未来发展的信心，希望持股而获取收益。本基金将通过对增持金额、比例等筛选，构建投资组合。</p> <p>4) 员工持股事件的界定</p> <p>员工持股计划是指内部员工出资认购本公司的部分股权，委托专门机构管理，参与持股分红的一种新型企业内部股权形式。本基金将通过对有员工持股计划的公司进行分析，构建投资组合。</p> <p>5) 其他事件</p> <p>除了上述的事件类型外，本基金也会紧密跟踪诸如行业重大项目发布、国家战略导向、公司重大合同签订、公司管理层人员变动、公司新产品的研发或推出等各类事件，分析研究这些事件对公司价值和未来发展可能产生的影响，进一步选择有投资潜力的标的。</p> <p>(2) 个股选择</p> <p>本基金通过选取一年内发布过本基金合同约定事件的相关公告的上市公司，在其事件发生或相关公告出具后，根据事件驱动的界定方法，从中挑选部分公司构建股票池。本基金也可以在事前通过广泛收集市场公开信息，对公开信息进行定量研究，批量选择有可能发生本基金合同约定事件的公司进入股票池。本基金管理人通过优选股票池中的股票或者批量买入构建投资组合。</p> <p>(3) 存托凭证的投资策略</p> <p>本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股</p> |
|--|---|

|  |  |
|--|--|
|  | <p>票投资策略执行。</p> <p>3、固定收益类品种投资策略</p> <p>本基金投资于固定收益类品种的目的在于在保证基金资产流动性的基础上，使基金资产得到更加合理有效的利用，从而提高投资组合收益。为此，本基金固定收益类资产的投资将在限定的投资范围内，根据国家货币政策和财政政策实施情况、市场收益率曲线变动情况、市场流动性情况来预测债券市场整体利率趋势，同时结合各具体品种的供需情况、流动性、信用状况和利率敏感度等因素进行综合分析，在严格控制风险的前提下，构建和调整债券投资组合。在确定固定收益投资组合的具体品种时，本基金将根据市场对于个券的市场成交情况，对各个目标投资对象进行利差分析，包括信用利差，流动性利差，期权调整利差（OAS），并利用利率模型对利率进行模拟预测，选出定价合理或被低估，到期期限符合组合构建要求的固定收益品种。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>本基金将在风险可控的前提下，以套期保值为目的，根据对现货和期货市场的分析，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。</p> <p>5、中小企业私募债券投资策略</p> <p>与传统的信用债相比，中小企业私募债券采取非公开方式发行和交易，整体流动性相对较差，而且受到发债主体资产规模较小、经营波动性较高、信用基本面稳定性较差的影响，整体的信用风险相对较高。因此，对于中小企业私募债券的投资应采取更为谨慎的投资策略。本基金认为，投资该类债券的核心要点是对个券信用资质进行详尽的分析，并综合考虑发行人的企业性质、所处行业、资产负</p> |
|--|--|

|  |   |
|--|---|
|  | <p>债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素，确定最终的投资决策。</p> <p>6、资产支持证券投资策略</p> <p>资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产支持证券。</p> <p>7、证券公司短期公司债券投资策略</p> <p>本基金通过对证券公司短期公司债券发行人基本面的深入调研分析，结合发行人资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性以及债券流动性、信用利差、信用评级、违约风险等的综合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券进行投资。</p> <p>8、股票期权投资策略</p> <p>本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，参与股票期权的投资。本基金将在有效控制风险的前提下，选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资。本基金将基于对证券市场的预判，并结合股票期权定价模型，选择估值合理的期权合约。</p> <p>基金管理人将根据审慎原则，建立股票期权交易决策部门或小组，按照有关要求做好人员培训工作，确保投资、风控等核心岗位人员具备股票期权业务知识和相应的专业能力，同时授权特定的管理人员负责股票期权的投资审批事项，以防范期权投资的风险。</p> <p>9、权证及其他品种投资策略</p> <p>本基金在权证投资中将权证标的证券的基本面进行研</p> |
|--|---|

|        |  |
|--------|--|
|        | <p>究，结合期权定价量化模型估算权证价值，主要考虑运用的策略有：价值挖掘策略、杠杆策略、双向权证策略、获利保护策略和套利策略等。</p> <p>同时，法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，本基金若认为有助于基金进行风险管理和组合优化的，可依据法律法规的规定履行适当程序后，运用金融衍生产品进行投资风险管理。</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。  |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，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。  |
| 基金管理人  | 光大保德信基金管理有限公司  |
| 基金托管人  | 中国建设银行股份有限公司   |

### § 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                              |
|-----------------|----------------------------------|
|                 | (2021 年 4 月 1 日-2021 年 6 月 30 日) |
| 1. 本期已实现收益      | 8,170,644.56                     |
| 2. 本期利润         | 8,232,345.51                     |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0259                           |
| 4. 期末基金资产净值     | 497,041,190.92                   |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.2508                           |

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③     | ②-④    |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|---------|--------|
| 过去三个月      | 2.06%  | 0.33%     | 2.46%      | 0.49%         | -0.40%  | -0.16% |
| 过去六个月      | 1.61%  | 0.39%     | 1.53%      | 0.66%         | 0.08%   | -0.27% |
| 过去一年       | 13.77% | 0.47%     | 14.21%     | 0.66%         | -0.44%  | -0.19% |
| 过去三年       | 31.07% | 0.61%     | 33.38%     | 0.68%         | -2.31%  | -0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | 25.08% | 0.75%     | 40.19%     | 0.61%         | -15.11% | 0.14%  |

#### 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

光大保德信事件驱动灵活配置混合型证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2017 年 1 月 18 日至 2021 年 6 月 30 日)



注：根据基金合同的规定，本基金建仓期为2017年1月18日至2017年7月17日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。



## § 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 |        |   |
| 陈栋 | 基金经理 | 2020-02-25  | -    | 12 年   | 陈栋先生, 2006 年毕业于复旦大学预防医学专业, 2009 年获得复旦大学卫生经济管理学硕士学位。2009 年至 2010 年在国信证券经济研究所担任研究员; 2011 年在中信证券交易与衍生产品业务总部担任研究员; 2012 年 2 月加入光大保德信基金管理有限公司, 担任投资研究部研究员、高级研究员, 并于 2014 年 6 月起担任光大保德信银发商机主题混合型证券投资基金的基金经理助理, 2015 年 4 月至今担任光大保德信银发商机主题混合型证券投资基金的基金经理, 2019 年 6 月至 2020 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, 2019 年 12 月至今担任光大保德信欣鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2020 年 1 月至今担任光大保德信中小盘混合型证券投资基金的基金经理, 2020 年 2 月至今担任光大保德信事件驱动灵活配置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安和债券型证券投资基金的基金经理。 |

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

和解聘日期。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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 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

2021 年二季度美债长端利率逐月回落，对新兴市场权益资产估值的压制有所减小，同时美元指数也整体走弱，人民币阶段性压力缓解；同期国内政策环境相对温和，微观流动性较为充裕，通胀预期也随着大宗商品价格的回落而有所缓解。A 股市场在前期的快速下跌之后迎来反弹，但结构上分化明显，以创业板为代表的成长风格表现亮眼。

整体来看，二季度沪深 300 指数上涨 3.5%，创业板指数则大幅上涨 26.1%。行业板块方面，电力设备及新能源、电子、汽车、化工等板块涨幅领先，农业、地产、家电、休闲服务等行业表现落后。光大事件驱动在 21 年二季度操作中，股票仓位相比一季度略有降低，行

业配置上提升了医药、计算机、非银等行业的比例，降低了银行、食品饮料、地产板块的权重。

#### 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 2.06%，业绩比较基准收益率为 2.46%。

#### 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              | 135,785,088.84 | 27.29        |
|    | 其中：股票             | 135,785,088.84 | 27.29        |
| 2  | 固定收益投资            | 301,735,934.50 | 60.63        |
|    | 其中：债券             | 301,735,934.50 | 60.63        |
|    | 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          | 50,000,000.00  | 10.05        |
|    | 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      | 4,325,668.11   | 0.87         |
| 7  | 其他各项资产            | 5,805,064.11   | 1.17         |
| 8  | 合计                | 497,651,755.56 | 100.00       |

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 11,290.28      | 0.00         |
| B  | 采矿业              | -              | -            |
| C  | 制造业              | 52,967,850.89  | 10.66        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 13,020.39      | 0.00         |
| E  | 建筑业              | -              | -            |
| F  | 批发和零售业           | 600,893.82     | 0.12         |
| 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  | 10,169,707.89  | 2.05         |
| J  | 金融业              | 49,899,312.10  | 10.04        |
| K  | 房地产业             | 13,902,728.00  | 2.80         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 2,100,700.00   | 0.42         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 483,080.50     | 0.10         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 22,269.23      | 0.00         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |
| P  | 教育               | -              | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 5,614,235.74   | 1.13         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -              | -            |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 135,785,088.84 | 27.32        |

### 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通过沪港通投资股票。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)     | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 000858 | 五粮液  | 43,000.00 | 12,809,270.00 | 2.58         |

|    |        |      |              |               |      |
|----|--------|------|--------------|---------------|------|
| 2  | 600036 | 招商银行 | 220,000.00   | 11,921,800.00 | 2.40 |
| 3  | 600519 | 贵州茅台 | 5,500.00     | 11,311,850.00 | 2.28 |
| 4  | 601166 | 兴业银行 | 479,000.00   | 9,843,450.00  | 1.98 |
| 5  | 601398 | 工商银行 | 1,815,700.00 | 9,387,169.00  | 1.89 |
| 6  | 000001 | 平安银行 | 318,400.00   | 7,202,208.00  | 1.45 |
| 7  | 000002 | 万科A  | 300,000.00   | 7,143,000.00  | 1.44 |
| 8  | 601688 | 华泰证券 | 340,000.00   | 5,372,000.00  | 1.08 |
| 9  | 000333 | 美的集团 | 70,000.00    | 4,995,900.00  | 1.01 |
| 10 | 002142 | 宁波银行 | 110,000.00   | 4,286,700.00  | 0.86 |

#### 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      | 21,432,934.50  | 4.31         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 280,303,000.00 | 56.39        |
|    | 其中：政策性金融债 | 280,303,000.00 | 56.39        |
| 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        | 301,735,934.50 | 60.71        |

#### 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  | 200202 | 20 国开 02 | 900,000 | 88,551,000.00 | 17.82        |
| 2  | 200313 | 20 进出 13 | 800,000 | 80,728,000.00 | 16.24        |
| 3  | 180211 | 18 国开 11 | 400,000 | 40,704,000.00 | 8.19         |
| 4  | 210212 | 21 国开 12 | 400,000 | 40,140,000.00 | 8.08         |

|   |        |          |         |               |      |
|---|--------|----------|---------|---------------|------|
| 5 | 190207 | 19 国开 07 | 300,000 | 30,180,000.00 | 6.07 |
|---|--------|----------|---------|---------------|------|

## 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

本基金将在风险可控的前提下，以套期保值为目的，根据对现货和期货市场的分析，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.120 国开 02(200202. IB)、18 国开 11(180211. IB)、21 国开 12(210212. IB)、19 国开 07 (190207. IB) 的发行主体国家开发银行于 2020 年 12 月 25 日收到中

国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表(银保监罚决字(2020)67号),主要内容为:一、为违规的政府购买服务项目提供融资。二、项目资本金管理不到位,棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况。三、违规变相发放土地储备贷款。四、设置不合理存款考核要求,以贷转存,虚增存款。五、贷款风险分类不准确。六、向资产管理公司以外的主体批量转让不良信贷资产。七、违规进行信贷资产拆分转让,隐匿信贷资产质量。八、向棚改业务代理结算行强制搭售低收益理财产品。九、扶贫贷款存贷挂钩。十、易地扶贫搬迁贷款“三查”不尽职,部分贷款资金未真正用于扶贫搬迁。十一、未落实同业业务交易对手名单制监管要求。十二、以贷款方式向金融租赁公司提供同业融资,未纳入同业借款业务管理。十三、以协定存款方式吸收同业存款,未纳入同业存款业务管理。十四、风险隔离不到位,违规开展资金池理财业务。十五、未按规定向投资者充分披露理财产品投资非标准化债权资产情况。十六、逾期未整改,屡查屡犯,违规新增业务。十七、利用集团内部交易进行子公司间不良资产非洁净出表。十八、违规收取小微企业贷款承诺费。十九、收取财务顾问费质价不符。二十、利用银团贷款承诺费浮利分费。二十一、向检查组提供虚假整改说明材料。二十二、未如实提供信贷资产转让台账。二十三、案件信息迟报、瞒报。二十四、对以往监管检查中发现的国别风险管理问题整改不到位。中国银行保险监督管理委员会作出行政处罚决定为罚款 4880 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。该行政处罚事件发生后,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。

兴业银行(601166.SH)的发行主体兴业银行股份有限公司于2020年9月4日收到福银罚字(2020)35号,主要内容为:兴业银行股份有限公司1.为无证机构提供转接清算服务,且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定;2.为支付机构超范围(超业务、超地域)经营提供支付服务,且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性;3.违规连通上、下游支付机构,提供转接清算服务,且未落实交易信息真实性、完整性、

可追溯性及支付全流程中的一致性；4. 违反银行卡收单外包管理规定；5. 未按规定履行客户身份识别义务。中国人民银行福州中心支行给予警告，没收违法所得 10,875,088.15 元，并处 13,824,431.23 元罚款。

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。该行政处罚事件发生后，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   | 64,263.33    |
| 2  | 应收证券清算款 | 972,694.67   |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 4,761,798.03 |
| 5  | 应收申购款   | 6,308.08     |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 5,805,064.11 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。



## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                |                |
|----------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额   | 253,479,452.91 |
| 报告期期间基金总申购份额   | 145,480,452.12 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 1,568,854.46   |
| 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   | 397,391,050.57 |

## § 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

| 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              | 20210401-20210630      | 92,304,271.21 | 0.00          | 0.00 | 92,304,271.21 | 23.23% |
|       | 2              | 20210622-20210630      | 0.00          | 80,275,457.41 | 0.00 | 80,275,457.41 | 20.20% |
|       | 3              | 20210401-20210617      | 68,836,124.97 | 0.00          | 0.00 | 68,836,124.97 | 17.32% |
|       | 4              | 20210420-20210531      | 0.00          | 65,103,352.86 | 0.00 | 65,103,352.86 | 16.38% |

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。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据 2021 年 5 月 21 日《光大保德信基金管理有限公司关于调低光大保德信事件驱动灵活配置混合型证券投资基金管理费率的公告》，基金管理人决定自 2021 年 5 月 21 日起调低光大保德信事件驱动灵活配置混合型证券投资基金的管理费率并对《光大保德信事件驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及《光大保德信事件驱动灵活配置混合型证券投资基金托管协议》作相应修改。详情请见公告。

## §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事件驱动灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- 2、光大保德信事件驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 3、光大保德信事件驱动灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- 4、光大保德信事件驱动灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 5、光大保德信事件驱动灵活配置混合型证券投资基金法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 8、报告期内光大保德信事件驱动灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

### 9.2 存放地点

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

### 9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。客户服务中心电话：4008-202-888, 021-80262888。公司网址：[www.epf.com.cn](http://www.epf.com.cn)。

光大保德信基金管理有限公司

二〇二一年七月二十一日