

# 光大保德信新机遇混合型证券投资基金

## 2022 年第 4 季度报告

2022 年 12 月 31 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：二〇二三年一月二十日

## § 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 2023 年 1 月 19 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 2022 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 光大保德信新机遇混合   |
| 基金主代码      | 010676   |
| 交易代码       | 010676   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2021 年 3 月 30 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 284,849,790.77 份   |
| 投资目标       | 本基金将在控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值。   |
| 投资策略       | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将通过分析宏观经济基本面及证券市场双层面的数据进行研究，并通过定性定量分析、风险测算及组合优化，最终形成大类资产配置决策。具体包括以下几个方面：</p> <p>(1) 宏观经济运行的变化和国家的宏观调控政策将对证</p> |

|  |   |
|--|---|
|  | <p>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；</p> <p>（2）运用历史数据并结合基金管理人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；</p> <p>（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。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>“新机遇”是指根据宏观经济结构转型、产业结构变化、科技发展方向等，分析各行业所处发展阶段、产业竞争格局、发展趋势等因素，筛选未来有望受益程度较高或持续提升的行业，精选符合经济转型升级方向并具备良好发展潜力的公司，把握经济发展过程中所蕴涵的投资机遇。具体分为行业配置策略和个股选择策略：</p> <p>（1）行业配置策略</p> <p>本基金将通过自上而下的分析方式，寻找各行业在经济发展进程中的新机遇，具体包括以下几个方面：</p> <p>1) 定量分析</p> <p>利用行业的估值、业绩等多个方面指标进行分析，如行业相对估值水平（行业估值/市场估值）、行业相对利润增长率（行业利润增长率/市场利润增长率）、行业 PEG（行业估值/行业利润增长率）等。</p> <p>2) 定性分析</p> <p>从宏观经济运行特征、经济景气周期、行业周期轮动特征以及产业结构变化趋势等多个维度分析，同时结合行业自身的竞争格局、技术进步、政策条件等因素，把握不同行</p> |
|--|---|

|  |   |
|--|---|
|  | <p>业的景气度变化情况和发展趋势，从而筛选未来有持续向好发展的行业。</p> <p>(2) 个股选择策略</p> <p>本基金将通过自下而上的研究方式，结合定性和定量分析，关注上市公司在不同行业周期和自身发展阶段下的新机遇，深入挖掘上市公司的投资价值，精选估值合理且成长性良好的上市公司进行投资。具体包括以下几个方面：</p> <p>1) 定量分析</p> <p>本基金结合与上市公司经营有关的重要定量指标，对上市公司的价值进行深入挖掘，为个股选择提供依据。具体的定量指标包括：</p> <p>盈利增长指标：公司是否具有较强的盈利能力，主要分析指标包括净资产收益率（ROE）、毛利率、净利率、盈利增长率（<math>\Delta E</math>）等；</p> <p>成长指标：公司是否具有成长性，主要分析指标包括营业收入增长率、主营业务利润增长率、净利润增长率等；</p> <p>估值指标：公司估值水平是否合理，可供选择的估值方法包括市盈率法（P/E）、市净率法（P/B）、市盈率相对盈利增长比率（PEG）、自由现金流贴现模型（FCFF）或股利贴现模型（DDM）等；</p> <p>运营效率指标：公司是否具有较高的运营效率，主要分析指标包括总资产周转率、存货周转率、应收账款周转率等；</p> <p>财务结构指标：公司财务结构是否合理，主要分析指标包括资产负债率（D/A）、流动比率、速动比率等。</p> <p>2) 定性分析</p> <p>本基金认为股票价格的合理区间并非完全由其财务数据决定，还必须结合企业学习与创新能力、企业发展战略、技术专利优势、市场拓展能力、公司治理结构和管理水平、公司的行业地位、公司增长的可持续性 etc 定性因素，给予</p> |
|--|---|

股票一定的折溢价水平，并最终决定股票合理的价格区间。根据上述定性定量分析的结果，本基金进一步从价值和成长两个纬度对备选股票进行评估。对于价值被低估且成长性良好的股票，本基金将重点关注；对于价值被高估但成长性良好，或价值被低估但成长性较差的股票，本基金将通过深入的调研和缜密的分析，有选择地进行投资；对于价值被高估且成长性较差的股票，本基金不予考虑投资。

### （3）港股通标的股票投资策略

本基金关注互联互通机制下港股市场投资机会，将重点关注以下几个方面：

- 1) 基金管理人的研究团队重点覆盖的行业中，精选港股通中有代表性的行业龙头公司；
- 2) 具有行业稀缺性的香港本地和外资公司；
- 3) 与 A 股同类公司相比具有估值优势的公司。

### 3、债券投资策略

本基金密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率变动走势，自上而下地确定投资组合久期，并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合，配置能够提供稳定收益的债券品种。

### 4、证券公司短期公司债券投资策略

本基金将通过证券行业分析、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。

### 5、资产支持证券投资策略

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>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>6、衍生品投资策略</p> <p>为更好地实现投资目标,本基金在注重风险管理的前提下,以套期保值为目的,适度运用股指期货、股票期权等金融衍生品。本基金利用金融衍生品合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点,提高投资组合的运作效率。</p> <p>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理估值水平。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。</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。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>7、其他品种投资策略</p> <p>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 | 70%×沪深 300 指数收益率+10%×恒生指数收益率+20%×  |

|        |   |
|--------|---|
|        | 中证全债指数收益率   |
| 风险收益特征 | <p>本基金为混合型基金，其预期收益和预期风险高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。</p> <p>本基金还可投资港股通标的股票。除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p> |
| 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                                |
|-----------------|------------------------------------|
|                 | (2022 年 10 月 1 日-2022 年 12 月 31 日) |
| 1. 本期已实现收益      | -17,376,535.63                     |
| 2. 本期利润         | 12,095,775.03                      |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0417                             |
| 4. 期末基金资产净值     | 285,961,206.70                     |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0039                             |

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

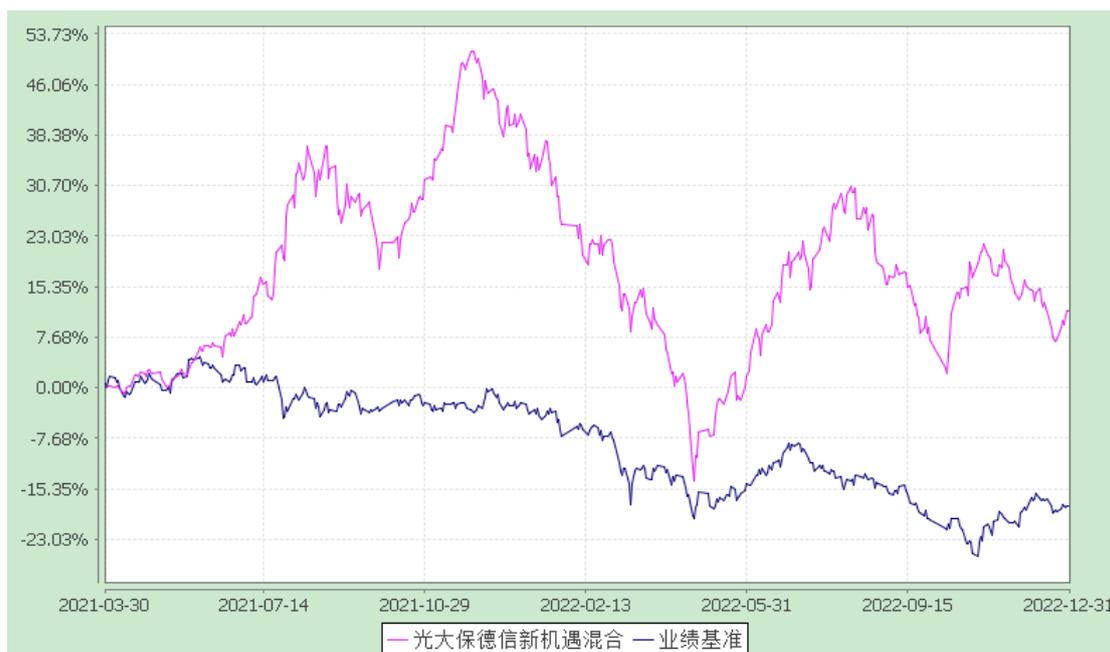
##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值增长 | 净值增长 | 业绩比较 | 业绩比较 | ①-③ | ②-④ |
|----|------|------|------|------|-----|-----|
|----|------|------|------|------|-----|-----|

|                | 率①      | 率标准差<br>② | 基准收益<br>率③ | 基准收益<br>率标准差<br>④ |        |       |
|----------------|---------|-----------|------------|-------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | 4.13%   | 1.43%     | 2.77%      | 1.10%             | 1.36%  | 0.33% |
| 过去六个月          | -6.25%  | 1.45%     | -10.19%    | 0.93%             | 3.94%  | 0.52% |
| 过去一年           | -21.09% | 1.69%     | -16.07%    | 1.06%             | -5.02% | 0.63% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 11.73%  | 1.55%     | -17.96%    | 0.95%             | 29.69% | 0.60% |

### 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

光大保德信新机遇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  
(2021 年 3 月 30 日至 2022 年 12 月 31 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 | 说明 |
|----|----|-------------|-------|----|
|----|----|-------------|-------|----|

|    |                     | 任职日期       | 离任日期 | 限    |  |
|----|---------------------|------------|------|------|--|
| 房雷 | 权益管理总部权益投资团队队长、基金经理 | 2022-08-27 | -    | 12 年 | <p>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 月至今担任光大保德信吉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 月至今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的基金经理, 2020 年 5</p> |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | 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。 |
|--|--|--|--|--|--|

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。本报告期内，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

四季度 A 股市场整体上呈现震荡的格局，结构上则显现出困境反转投资逻辑的特征，这一变化与二、三季度权益市场呈现完全不同的情景。一方面伴随着经济下行压力的逐步加大，以及海外市场衰退预期的强化，前面强势的出口产业链和国内的一些高景气资产都呈现了盈利边际下行的压力；另一方面，二十大报告、中央经济工作会议以及疫情政策的变化，使得市场的投资主线有显著的迁移。回头看四季度 A 股市场，尽管主线不明确，行业轮动较快，但整体上呈现出困境反转的投资逻辑——安全产业链相关的软件，经济复苏预期的大消费和出行产业链，以及政策利好的地产产业链等，成为市场关注的焦点，尤其是大消费领域，超额收益比较显著。

本基金在投资上继续保持成长属性的风格，结构上相应地做出了一定的调整：

1) 继续增持计算机软件，尤其是信创和数字经济相关的软件个股的配置；正如三季度业绩报所强调，我们十分青睐计算机软件板块的重大投资机遇，无论是产业景气周期还是政策，都非常友好。

2) 增持了医疗器械和制药板块资产的配置；我们看好经济正常化后该领域的好转。

3) 在半导体领域，减持了半导体设备而增持了半导体设计类个股的配置。我们相对更看 2023 年经济恢复后国内内需产业链相关的半导体设计类资产。

4) 增持了非银尤其是保险类资产的配置。

5) 继续减持了汽车类相关的资产，主要是担忧汽车行业景气的下行。

尽管 2022 年成长类资产表现不佳，但我们仍然对经济产业的发展前景有充足的信心。本基金将会继续在以科技、智能制造和生物制药为代表的泛成长领域深度耕耘，努力为投资者创造更好的投资回报，力争给投资者分享中国科技创新时代的伟大红利。

### 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 4.13%，业绩比较基准收益率为 2.77%。

## 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              | 260,032,150.45 | 90.35        |
|    | 其中：股票             | 260,032,150.45 | 90.35        |
| 2  | 固定收益投资            | 19,645,212.93  | 6.83         |
|    | 其中：债券             | 19,645,212.93  | 6.83         |
|    | 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      | 7,794,626.19   | 2.71         |
| 7  | 其他各项资产            | 324,652.01     | 0.11         |
| 8  | 合计                | 287,796,641.58 | 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         | 5,823,768.00  | 2.04         |
| B  | 采矿业              | -             | -            |
| C  | 制造业              | 97,052,720.41 | 33.94        |
| 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     | 16,787,374.00  | 5.87  |
| H | 住宿和餐饮业          | -              | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 107,873,263.01 | 37.72 |
| J | 金融业             | 18,102,695.00  | 6.33  |
| 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      | 14,348,726.87  | 5.02  |
| 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         | 43,603.16      | 0.02  |
| R | 文化、体育和娱乐业       | -              | -     |
| S | 综合              | -              | -     |
|   | 合计              | 260,032,150.45 | 90.93 |

### 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  | 300454 | 深信服  | 182,500.00 | 20,540,375.00 | 7.18         |
| 2  | 600588 | 用友网络 | 847,800.00 | 20,491,326.00 | 7.17         |
| 3  | 603713 | 密尔克卫 | 143,900.00 | 16,787,374.00 | 5.87         |
| 4  | 002675 | 东诚药业 | 964,400.00 | 15,970,464.00 | 5.58         |
| 5  | 300298 | 三诺生物 | 460,444.00 | 15,530,776.12 | 5.43         |
| 6  | 688536 | 思瑞浦  | 53,441.00  | 14,718,185.81 | 5.15         |
| 7  | 300887 | 谱尼测试 | 439,300.00 | 14,325,573.00 | 5.01         |
| 8  | 600570 | 恒生电子 | 342,500.00 | 13,857,550.00 | 4.85         |
| 9  | 688369 | 致远互联 | 200,649.00 | 13,814,683.65 | 4.83         |
| 10 | 603986 | 兆易创新 | 129,396.00 | 13,259,208.12 | 4.64         |

#### 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      | 19,645,212.93 | 6.87 |
|    | 其中：政策性金融债 | 19,645,212.93 | 6.87 |
| 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        | 19,645,212.93 | 6.87 |

#### 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  | 220201 | 22 国开 01 | 100,000 | 10,202,128.77 | 3.57         |
| 2  | 018008 | 国开 1802  | 92,000  | 9,443,084.16  | 3.30         |

#### 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。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

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

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|----|-------|
|    |    |       |

|   |         |            |
|---|---------|------------|
| 1 | 存出保证金   | 100,291.02 |
| 2 | 应收证券清算款 | 70,518.04  |
| 3 | 应收股利    | -          |
| 4 | 应收利息    | -          |
| 5 | 应收申购款   | 153,842.95 |
| 6 | 其他应收款   | -          |
| 7 | 待摊费用    | -          |
| 8 | 其他      | -          |
| 9 | 合计      | 324,652.01 |

#### 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   | 295,865,617.95 |
| 报告期期间基金总申购份额   | 8,571,946.52   |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 19,587,773.70  |
| 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   | 284,849,790.77 |

### § 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

1. 本报告期内，经公司十一届五次董事会会议审议通过，自 2022 年 11 月 1 日起，翟昱磊女士正式离任公司首席市场总监。

2. 本报告期内，经公司十一届六次董事会会议审议通过，自 2022 年 12 月 20 日起，盛松先生正式离任公司副总经理。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予光大保德信新机遇混合型证券投资基金注册的文件
- 2、光大保德信新机遇混合型证券投资基金基金合同
- 3、光大保德信新机遇混合型证券投资基金招募说明书
- 4、光大保德信新机遇混合型证券投资基金托管协议
- 5、光大保德信新机遇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新机遇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

二〇二三年一月二十日