

**光大保德信健康优加混合型证券投资基金**  
**2026 年第 2 季度报告**  
**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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年七月二十一日

## §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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 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 2026 年 4 月 01 日起至 6 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                      |
|------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 光大保德信健康优加混合                                                                                                                                                                          |
| 基金主代码      | 012284                                                                                                                                                                               |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                               |
| 基金合同生效日    | 2021 年 8 月 5 日                                                                                                                                                                       |
| 报告期末基金份额总额 | 823,666,022.72 份                                                                                                                                                                     |
| 投资目标       | 本基金将在充分控制风险的前提下，通过把握健康产业股票的投资机会，力争实现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>本基金将通过对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</p> |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>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>（1）健康主题界定</p> <p>本基金所指的健康产业相关股票包含医疗保健、健康消费、养老产业等三大方向：</p> <p>1）医疗保健，如生物医药、医疗器械、医疗服务、体检服务、药品零售、保健品等医疗保健相关行业上市公司；</p> <p>2）健康消费，如休闲服务，文化传媒，食品饮料，纺织服装等高层次健康需求相关行业上市公司；</p> <p>3）养老产业，如消费电子、酒店旅游、教育、家庭用品、养老保险、互联网软件行业等相关行业上市公司。</p> <p>（2）A 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，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</p> |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>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。</p> <p>（3）港股通标的股票投资策略</p> <p>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：</p> <p>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；</p> |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>2) 具有行业稀缺性的香港本地和外资公司;</p> <p>3) 与 A 股同类公司相比具有估值优势的公司。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>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。</p> <p>4、证券公司短期公司债券投资策略</p> <p>本基金将通过对证券行业分析、证券公司资产负债分析、公司现金流分析等调查研究, 分析证券公司短期公司债券的违约风险及合理的利差水平, 对证券公司短期公司债券进行独立、客观的价值评估。</p> <p>5、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>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</p> |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |               |
|-------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|
|             | <p>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      | $\text{中证医药卫生指数收益率} \times 50\% + \text{中证内地消费主题指数收益率} \times 20\% + \text{恒生指数收益率} \times 10\% + \text{中证全债指数收益率} \times 20\%$                                                                                                                                                                                                                                               |               |
| 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       | 中国工商银行股份有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |               |
| 下属分级基金的基金简称 | 光大保德信健康优加混合 A                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | 光大保德信健康优加混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 012284                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 018076        |

|                     |                  |                |
|---------------------|------------------|----------------|
| 报告期末下属分级基金的份<br>额总额 | 818,561,032.12 份 | 5,104,990.60 份 |
|---------------------|------------------|----------------|

### §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<br>(2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日) |                   |
|----------------|-----------------------------------------|-------------------|
|                | 光大保德信健康优加混<br>合 A                       | 光大保德信健康优加混<br>合 C |
|                |                                         |                   |
| 1.本期已实现收益      | 14,310,042.44                           | 35,507.21         |
| 2.本期利润         | -27,779,859.84                          | 51,282.67         |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0320                                 | 0.0165            |
| 4.期末基金资产净值     | 623,421,458.63                          | 3,980,174.49      |
| 5.期末基金份额净值     | 0.7616                                  | 0.7797            |

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。

#### 3.2 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

##### 1、光大保德信健康优加混合 A：

| 阶段    | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①－③    | ②－④   |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -4.14%     | 1.98%         | -7.36%         | 0.91%                 | 3.22%  | 1.07% |
| 过去六个月 | -3.35%     | 2.06%         | -9.46%         | 0.91%                 | 6.11%  | 1.15% |
| 过去一年  | -2.26%     | 2.02%         | -7.58%         | 0.82%                 | 5.32%  | 1.20% |
| 过去三年  | -0.82%     | 1.76%         | -11.02%        | 0.98%                 | 10.20% | 0.78% |
| 成立以来  | -23.84%    | 1.63%         | -33.97%        | 1.02%                 | 10.13% | 0.61% |

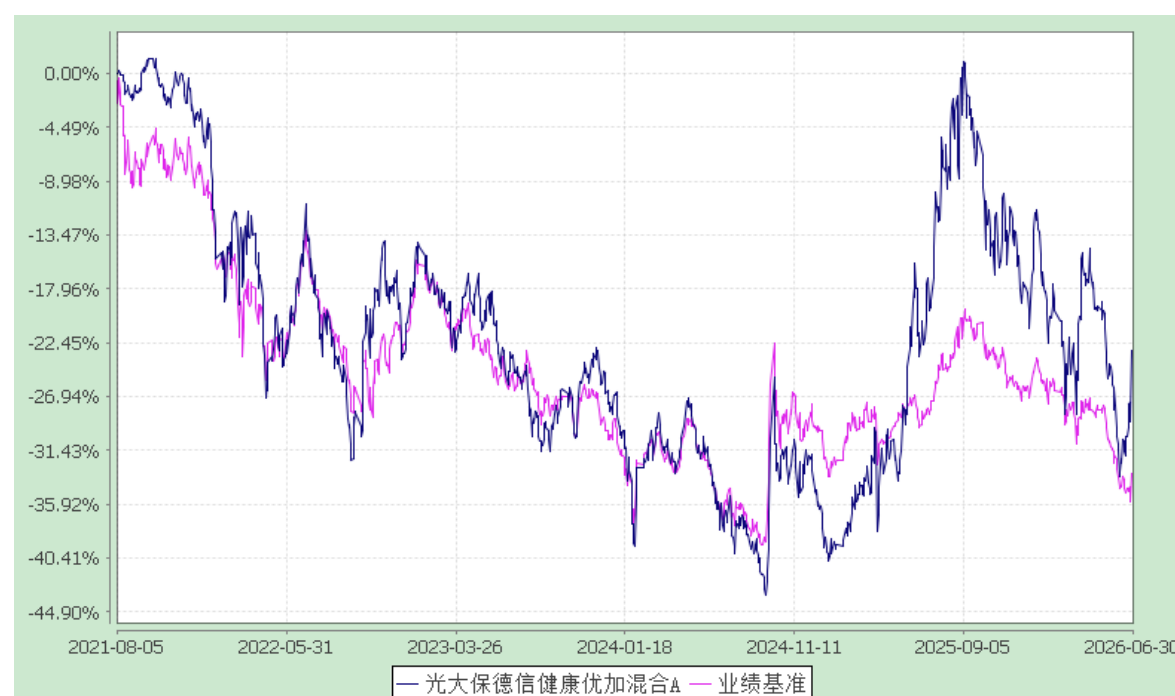
## 2、光大保德信健康优加混合 C:

| 阶段    | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -4.13%     | 1.98%         | -7.36%         | 0.91%                 | 3.23%  | 1.07% |
| 过去六个月 | -3.25%     | 2.06%         | -9.46%         | 0.91%                 | 6.21%  | 1.15% |
| 过去一年  | -1.15%     | 2.02%         | -7.58%         | 0.82%                 | 6.43%  | 1.20% |
| 过去三年  | 1.76%      | 1.76%         | -11.02%        | 0.98%                 | 12.78% | 0.78% |
| 成立以来  | -2.59%     | 1.71%         | -16.26%        | 0.96%                 | 13.67% | 0.75% |

### 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

光大保德信健康优加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的历史走势对比图  
(2021 年 8 月 5 日至 2026 年 6 月 30 日)

#### 1. 光大保德信健康优加混合 A:



#### 2. 光大保德信健康优加混合 C:



注：本基金 C 类份额设立于 2023 年 3 月 13 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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 朱剑涛 | 权益管理总部量化投资团队副团队长（主持工作）、基金经理 | 2026-04-11  | -    | 18 年   | 朱剑涛先生，2008 年毕业于复旦大学，获得理学硕士。2008 年 7 月至 2010 年 8 月在华宝信托有限责任公司任职量化研究助理；2010 年 9 月至 2015 年 3 月在海通证券股份有限公司任职金融工程高级分析师；2015 年 4 月至 2022 年 5 月在东方证券股份有限公司任职金融工程首席分析师；2022 年 6 月至 2023 年 8 月在海南进化论私募基金管理有限公司任职量化研究负责人；2023 年 8 月加入光大保德信基金管理有限公司，现任权益管理总部量化投资团队副团队长（主持工作），2024 年 5 月至今担任光大保德信量化核心证券投资 |

|     |          |            |            |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|-----|----------|------------|------------|------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |          |            |            |      | 资基金的基金经理，2024 年 5 月至 2026 年 4 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，2024 年 10 月至今担任光大保德信风格轮动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、光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理，2024 年 10 月至 2026 年 4 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，2025 年 3 月至今担任光大保德信红利量化选股混合型证券投资基金的基金经理，2025 年 5 月至今担任光大保德信沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理，2026 年 1 月至今担任光大保德信双鑫收益债券型证券投资基金的基金经理，2026 年 4 月至今担任光大保德信健康优加混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 徐晓杰 | 基金经<br>理 | 2021-08-05 | 2026-04-11 | 20 年 | 徐晓杰女士，中科院上海生命科学院博士。1998 年 7 月至 2001 年 9 月在吉林省农科院作物研究所任职助理研究员；2006 年 6 月至 2007 年 8 月在上海邦联资产管理有限公司任职研究部行业研究员；2007 年 8 月至 2020 年 7 月在华泰柏瑞基金管理有限公司历任投资研究部研究员、研究总监助理、基金经理助理、基金经理、投决会成员；2020 年 7 月加入光大保德信基金管理有限公司，历任权益管理总部权益投资团队副团队长，2020 年 10 月至 2026 年 2 月担任光大保德信红利混合型证券投资基金的基金经理，2021 年 8 月至 2026 年 4 月担任光大保德信健康优加混合型证券投资基金的基金经理。                                               |

注：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；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《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规的规定和基金合同、招募说明书等有关法律文件的约定，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。本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 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年二季度 A 股市场呈现显著的结构特征，主要指数全线收涨，但板块分化较为剧烈。科创 50 指数以 75.74% 的涨幅领跑，创业板指上涨 36.35%，对比之下，中证红利和万得小市值指数分别下跌 12.3% 和 14.1%；从行业看，半导体行业涨幅超过 100%，通信设备涨幅接近 80%，全市场深度聚焦 AI 产业链，半导体等硬科技领域，而传统的周期和消费板块表现疲弱，石油石化、食品饮料下跌均超过 15%，中证医药下跌 7.6%。在医药行业内部，只有医疗研发外包（申万）子行业在二季度录得正收益，血液制品，线下药店，医院等子行业跌幅都在 15% 以上。二季度回调后医药板块估值和资金配置比例处于历史低位，稳中向好的政策面和基本面有望驱动修复；但修复并不意味着全面普涨，而是以结构性机会为主，内部分化可能加剧，创新药将是我们继续关注的重点。

#### 4.5 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-4.14%，业绩比较基准收益率为-7.36%；本基金 C 份额净值增长率为-4.13%，业绩比较基准收益率为-7.36%。

#### 4.6 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              | 584,952,949.23 | 92.93        |
|    | 其中：股票             | 584,952,949.23 | 92.93        |
| 2  | 固定收益投资            | 35,266,182.28  | 5.60         |
|    | 其中：债券             | 35,266,182.28  | 5.60         |
|    | 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      | 8,783,220.13   | 1.40         |
| 7  | 其他资产              | 444,789.42     | 0.07         |
| 8  | 合计                | 629,447,141.06 | 100.00       |

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为人民币143784105.64元，占期末净值比例22.92%。

## 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         | -              | -            |
| B  | 采矿业              | 188,025.72     | 0.03         |
| C  | 制造业              | 302,066,228.50 | 48.15        |
| 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  | -              | -            |
| J  | 金融业              | -              | -            |
| 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       | 135,666,757.37 | 21.62        |
| 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          | 3,247,832.00   | 0.52         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -              | -            |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 441,168,843.59 | 70.32        |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币）      | 占基金资产净值比例（%） |
|------|----------------|--------------|
| 医疗保健 | 143,784,105.64 | 22.92        |
| 合计   | 143,784,105.64 | 22.92        |

注：以上行业分类采用GICS全球行业分类标准。

## 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  | 603259 | 药明康德   | 379,100.00 | 47,201,741.00 | 7.52         |
| 2  | 01801  | 信达生物   | 593,764.00 | 41,050,812.29 | 6.54         |
| 3  | 06990  | 科伦博泰生物 | 99,443.00  | 37,675,125.14 | 6.00         |
| 4  | 688331 | 荣昌生物   | 286,423.00 | 37,309,459.98 | 5.95         |
| 5  | 688235 | 百济神州   | 139,644.00 | 35,554,758.84 | 5.67         |
| 6  | 002422 | 科伦药业   | 715,415.00 | 27,557,785.80 | 4.39         |
| 7  | 02162  | 康诺亚－B  | 341,500.00 | 20,985,145.12 | 3.34         |
| 8  | 600276 | 恒瑞医药   | 395,428.00 | 20,578,073.12 | 3.28         |
| 9  | 002294 | 信立泰    | 638,200.00 | 20,352,198.00 | 3.24         |
| 10 | 688621 | XD 阳光诺 | 326,240.00 | 17,913,838.40 | 2.86         |

#### 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      | 35,266,182.28 | 5.62         |
| 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        | 35,266,182.28 | 5.62         |

#### 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  | 019792 | 25 国债 19 | 349,000 | 35,266,182.28 | 5.62         |

## 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

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 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   | 95,559.58  |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | 282,488.34 |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | 66,741.50  |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 444,789.42 |

### 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。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目           | 光大保德信健康优加混合A   | 光大保德信健康优加混合C |
|--------------|----------------|--------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 929,095,486.97 | 2,074,170.96 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 6,623,799.80   | 4,536,784.96 |

|                |                |              |
|----------------|----------------|--------------|
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 117,158,254.65 | 1,505,965.32 |
| 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   | 818,561,032.12 | 5,104,990.60 |

## §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、中国证监会准予光大保德信健康优加混合型证券投资基金注册的文件
- 2、光大保德信健康优加混合型证券投资基金基金合同
- 3、光大保德信健康优加混合型证券投资基金招募说明书
- 4、光大保德信健康优加混合型证券投资基金托管协议
- 5、光大保德信健康优加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健康优加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

二〇二六年七月二十一日