

# 光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

## 2019 年第 3 季度报告

2019 年 9 月 30 日

基金管理人：光大保德信基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年十月二十三日

## § 1 重要提示

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

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 10 月 22 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 2019 年 8 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 光大保德信尊丰纯债定期开放债券发起式  |
| 基金主代码      | 005426  |
| 交易代码       | 005426  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2019 年 8 月 1 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 210,000,000.00 份  |
| 投资目标       | 本基金在控制信用风险、谨慎投资的前提下，力争在获取持有期收益的同时，实现基金资产的长期稳定增值。  |
| 投资策略       | 1、封闭期投资策略<br>本基金将在控制信用风险、谨慎投资的前提下，力争在获取持有期收益的同时，实现基金资产的长期稳定增值。基于此目标，本基金将充分发挥基金管理人的研究优势，将规范的宏观研究、严谨的个券分析与积极主动的投资风格 |

|  |  |
|--|--|
|  | <p>相结合，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，动态调整固定收益类资产配置比例，自上而下决定债券组合久期及债券类属配置；在严谨深入的基本面分析和信用分析基础上，综合考量各类债券的流动性、供求关系、风险及收益率水平等，自下而上地精选个券。</p> <p>（1）资产配置策略</p> <p>本基金根据工业增加值、通货膨胀率等宏观经济指标，结合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，综合分析债券市场的变动趋势。最终确定本基金在债券类资产中的投资比率，构建和调整债券投资组合。</p> <p>（2）目标久期策略及凸性策略</p> <p>在组合的久期选择方面，本基金将综合分析宏观面的各个要素，主要包括宏观经济所处周期、货币财政政策动向、市场流动性变动情况等，通过对各宏观变量的分析，判断其对市场利率水平的影响方向和程度，从而确定本基金固定收益投资组合久期的合理范围。并且动态调整本基金的目标久期，即预期利率上升时适当缩短组合久期，在预期利率下降时适当延长组合久期，从而提高债券投资收益。</p> <p>由于债券价格与收益率之间往往存在明显的非线性关系，所以通过凸性管理策略为久期策略补充，可以更好地分析债券的利率风险。凸性越大，利率上行引起的价格损失越小，而利率下行带来的价格上升越大；反之亦然。本基金将通过严格的凸性分析，对久期策略做出适当的补充和修正。</p> <p>（3）收益率曲线策略</p> <p>在确定了组合的整体久期后，组合将基于宏观经济研究和债券市场跟踪，结合收益率曲线的拟合和波动模拟模型，</p> |
|--|--|

|  |   |
|--|---|
|  | <p>对未来的收益率曲线移动进行情景分析，从而根据不同期限的收益率变动情况，在期限结构配置上适时采取子弹型、哑铃型或者阶梯型等策略，进一步优化组合的期限结构，增强基金的收益。</p> <p>(4) 信用债投资策略</p> <p>信用类债券是本基金的重要投资对象，因此信用策略是本基金债券投资策略的重要部分。由于影响信用债券利差水平的因素包括市场整体的信用利差水平和信用债自身的信用情况变化，因此本基金的信用债投资策略可以具体分为市场整体信用利差曲线策略和单个信用债信用分析策略。</p> <p>1) 市场整体信用利差曲线策略</p> <p>本基金将从经济周期、市场特征和政策因素三方面考量信用利差曲线的整体走势。在经济周期向上阶段，企业盈利能力增强，经营现金流改善，则信用利差可能收窄，反之当经济周期不景气，企业的盈利能力减弱，信用利差扩大。同时本基金也将考虑市场容量、信用债结构以及流动性之间的相互关系，动态研究信用债市场的主要特征，为分析信用利差提供依据。另外，政策因素也会对信用利差造成很大影响。这种政策影响集中在信用债市场的供给方面和需求方面。本基金将从供给和需求两方面分别评估政策对信用债市场的作用。</p> <p>本基金将综合各种因素，分析信用利差曲线整体及分行业走势，确定信用债券总的投资比例及分行业的投资比例。</p> <p>2) 单个信用债信用分析策略</p> <p>信用债的收益率水平及其变化很大程度上取决于其发行主体自身的信用水平，本基金将对不同信用类债券的信用等级进行评估，深入挖掘信用债的投资价值，增强本基金的收益。</p> |
|--|---|

|  |  |
|--|--|
|  | <p>本基金主要通过发行主体偿债能力、抵押物质量、契约条款和公司治理情况等方面分析和评估单个信用债券的信用水平：</p> <p>信用债作为发行主体的一种融资行为，发行主体的偿债能力是首先需要考虑的重要因素。本基金将从行业和企业两个层面来衡量发行主体的偿债能力。A) 行业层面：包括行业发展趋势、政策环境和行业运营竞争状况；B) 企业层面：包括盈利指标分析、资产负债表分析和现金流分析等。</p> <p>抵押物作为信用债发行时的重要组成部分，是债券持有人分析和衡量该债券信用风险的关键因素之一。对于抵押物质量的考察主要集中在抵押物的现金流生成能力和资产增值能力。抵押物产生稳定现金流的能力越强、资产增值的潜力越大，则抵押物的质量越好，从而该信用债的信用水平也越高。</p> <p>契约条款是指在信用债发行时明确规定的，约束和限制发行人行为的条款内容。具体包含承诺性条款和限制性条款两方面，本基金首先分析信用债券中契约条款的合理性和可实施性，随后对发行人履行条款的情况进行动态跟踪与评估，发行人对契约条款的履行情况越良好，其信用水平也越高。</p> <p>对于通过发行债券开展融资活动的企业来说，该发行人的公司治理情况是该债券维持高信用等级的重要因素。本基金关注的公司治理情况包括持有人结构、股东权益与员工关系、运行透明度和信息披露、董事会结构和效率等。</p> <p>(5) 可转换债券投资策略</p> <p>本基金在分析宏观经济运行特征和证券市场趋势判断的前提下，在综合分析可转换债券的债性特征、股性特征等因素的基础上，选择其中安全边际较高、股性活跃并具有</p> |
|--|--|

|  |   |
|--|---|
|  | <p>较高上涨潜力的品种进行投资。结合行业分析和个券选择，对成长前景较好的行业和上市公司的可转换债券进行重点关注，选择投资价值较高的个券进行投资。</p> <p>(6) 中小企业私募债投资策略</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>(7) 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>(8) 证券公司短期公司债券投资策略</p> <p>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。</p> <p>基金投资证券公司短期公司债券，基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。</p> |
|--|---|

|        |  |
|--------|--|
|        | <p>(9) 债券回购投资策略</p> <p>在本基金的日常投资中，还将充分利用组合的债券回购操作，利用债券回购收益率低于债券收益率的机会，融入资金购买收益率较高的债券品种，在严格头寸管理的基础上，在资金相对充裕的情况下进行风险可控的债券回购投资策略以放大债券投资收益。</p> <p>(10) 国债期货投资策略</p> <p>基金管理人可运用国债期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在国债期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与国债期货的投资，以管理投资组合的利率风险，改善组合的风险收益特性。</p> <p>2、开放期投资策略</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。</p> |
| 业绩比较基准 | 中债总全价指数收益率。  |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金，但低于股票型基金和混合型基金。   |
| 基金管理人  | 光大保德信基金管理有限公司  |
| 基金托管人  | 中国光大银行股份有限公司   |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

|        |  |
|--------|--|
| 主要财务指标 | <p>报告期</p> <p>(2019 年 8 月 1 日 (基金合同生效日) - 2019 年 9 月</p> |
|--------|--|

|                 | 30 日)             |
|-----------------|-------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 991, 103. 75      |
| 2. 本期利润         | 1, 121, 343. 75   |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0. 0053           |
| 4. 期末基金资产净值     | 211, 121, 343. 75 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1. 0053           |

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

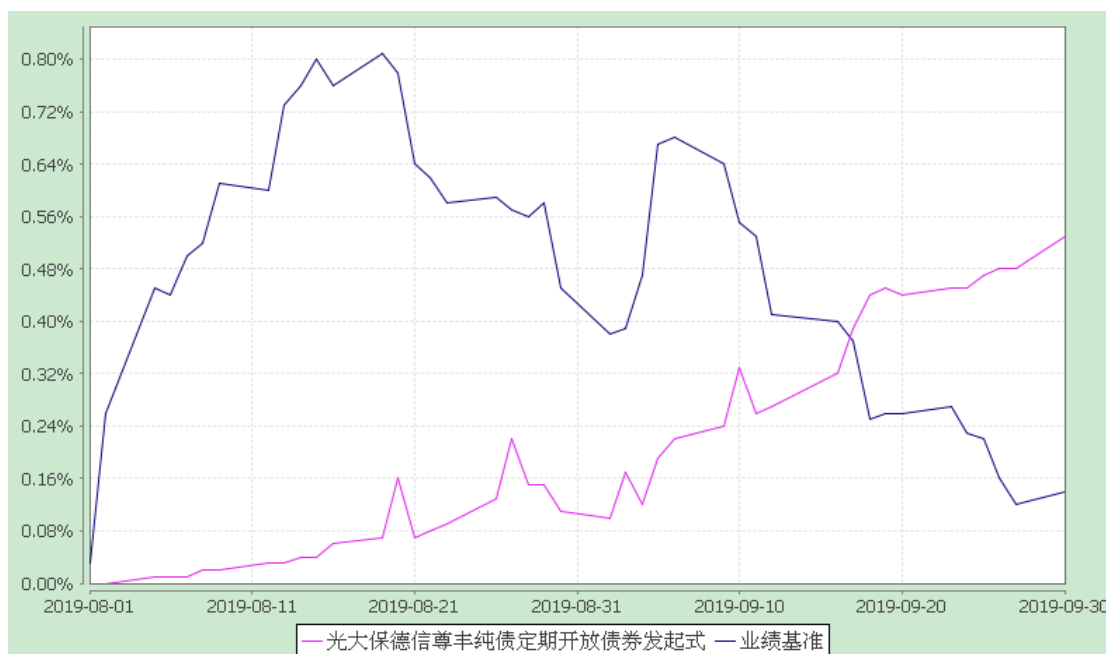
#### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | 0. 53% | 0. 04%    | 0. 14%     | 0. 08%        | 0. 39% | -0. 04% |

#### 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

光大保德信尊享纯债定期开放债券型发起式证券投资基金  
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2019 年 8 月 1 日至 2019 年 9 月 30 日)





注：根据基金合同的规定，本基金建仓期为2019年8月1日至2020年1月31日。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期内。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务   | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|----|------|-------------|------|--------|--|
|    |      | 任职日期        | 离任日期 |        |  |
| 沈荣 | 基金经理 | 2019-08-10  | -    | 7年     | 沈荣先生, 2007年获得上海交通大学工学学士学位, 2011年获得上海财经大学金融学硕士学位。2007年7月至2008年9月在上海电器科学研究所(集团)有限公司任职CAD开发工程师; 2011年6月至2012年3月在国金证券股份有限公司任职行业研究员; 2012年3月至2014年4月在宏源证券股份有限公司任职行业分析师、固定收益分析师; 2014年4月至2017年6月 |

|     |          |            |   |     |   |
|-----|----------|------------|---|-----|---|
|     |          |            |   |     | <p>在平安养老保险股份有限公司任职债券助理研究经理、投资经理；2017 年 7 月加入光大保德信基金管理有限公司，担任固定收益部基金经理。现任光大保德信货币市场基金、光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金基金经理、光大保德信尊享盈半年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、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基金经理、光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、光大保德信中高等级债券型证券投资基金基金经理、光大保德信尊享 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、光大保德信超短债债券型证券投资基金基金经理、光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。</p> |
| 曾小丽 | 基金经<br>理 | 2019-08-01 | - | 4 年 | <p>曾小丽女士，硕士。2009 年获得天津外国语大学国际贸易专业学士学位，2011 年获得中国人民大学世界经济专业硕士学位。2011 年 7 月至 2014 年 7 月在大公国际资信评估有限公司历任分析师、处经理、技术总监/评审委员；2014 年 8 月加入光大保德信基金管理有限公司，历任信用研究员，现任固收研究负责人一职。现任光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、光大保德信诚鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、光大保德信增利收益债券型证券投</p>   |

|    |                 |            |   |     |  |
|----|-----------------|------------|---|-----|--|
|    |                 |            |   |     | 资基金基金经理、光大保德信安祺债券型证券投资基金基金经理、光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。   |
| 周华 | 固定收益部投资副总监、基金经理 | 2019-08-01 | - | 9 年 | 周华先生，香港大学金融学硕士，曾任泰康资产管理有限责任公司第三方投资部固定收益投资总监，景顺长城基金管理有限公司投资经理、信用研究员、债券交易员，第一创业证券股份有限公司债券交易员；2018 年 6 月加入光大保德信基金管理有限公司，任职固定收益部投资副总监一职。现任光大保德信晟利债券型证券投资基金基金经理、光大保德信永利纯债债券型证券投资基金基金经理、光大保德信安诚债券型证券投资基金基金经理、光大保德信安泽债券型证券投资基金基金经理、光大保德信信用添益债券型证券投资基金基金经理、光大保德信安和债券型证券投资基金基金经理、光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金基金经理、光大保德信多策略精选 18 个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理、光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。 |

注：1. 对基金的首任基金经理，其任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司做出决定之日；非首任基金经理，其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2. 曾小丽女士因个人原因（休产假、生育假）无法正常履行职务，本基金管理人依据有关法律法规及公司制度的规定，批准曾小丽女士自2019年10月10日开始休假，暂定休假持续至2020年2月23日止。在曾小丽女士休产假期间，由沈荣先生、周华先生共同管理本基金。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观方面，三季度经济增长有所回落，通货膨胀保持高位，略有类滞涨的特征。二季度政治局会议态度求稳，再提“六稳”。三季度的金融数据平稳，社融和信贷都基本符合预期，反映出信用派生的过程比较温和。经济数据有所下行，主要是工业增加值同比增速下行比较明显。房地产相关数据保持平稳，房地产销售基本持平，但地产融资政策有所收紧，房企资金来源边际弱化，在施工的支撑下房地产投资还是保持稳健。另外，基建投资略有抬升，总体投资水平较为平稳。消费也呈现出偏下行的特征，主要是受到汽车销售疲弱的影响。受到猪价上涨驱动，CPI 三季度保持高位，后期可能会继续抬升。总而言之，经济短期呈现出稳态，但后期受到地产和出口回落的影响，仍然下滑压力较大。

债券市场方面，由于三季度政策预期仍然偏宽松，加之基本面下行，利率债收益率有所回落，信用债收益率也有所下行。具体而言，短端 1 年国债和 1 年国开分别下行 8BP 和 1BP。

受到宏观经济下的影响，长端小幅下行，10Y 国债和 10Y 国开均下行 8BP。信用债表现的略好于利率债，1Y 的 AAA 信用债下行 7BP。稍长久期的信用债表现更好，3Y 的 AAA 信用债下行 21BP。信用利差在较低水平上有所反弹，中等评级的表现略差一些，3Y 的 AA 信用债下行 15BP。我们认为，第三季度的债券行情主要反映三点特征：一是经济尚未企稳，宏观增速下行。二是宏观政策环境宽松。三是信用利差偏低，继续压缩缺乏空间。

本报告期内，本基金保持了仓位调整的灵活性，组合配置上维持资产负债匹配原则，维持中短久期策略。在信用债券评级方面，增加中高等级信用品种占比。通过审慎和积极的管理，在把握流动性的基础上，力求为投资者赚取收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内份额净值增长率为 0.53%，业绩比较基准收益率为 0.14%。

#### 4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目              | 金额(元)          | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-----------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资            | -              | -            |
|    | 其中：股票           | -              | -            |
| 2  | 固定收益投资          | 221,804,000.00 | 98.84        |
|    | 其中：债券           | 221,804,000.00 | 98.84        |
|    | 资产支持证券          | -              | -            |
| 3  | 贵金属投资           | -              | -            |
| 4  | 金融衍生品投资         | -              | -            |
| 5  | 买入返售金融资产        | -              | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融 | -              | -            |

|   |              |                |        |
|---|--------------|----------------|--------|
|   | 资产           |                |        |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 1,142,641.02   | 0.51   |
| 7 | 其他各项资产       | 1,462,674.68   | 0.65   |
| 8 | 合计           | 224,409,315.70 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -              | -            |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 221,804,000.00 | 105.06       |
|    | 其中：政策性金融债 | 221,804,000.00 | 105.06       |
| 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        | 221,804,000.00 | 105.06       |

## 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  | 180212    | 18 国开 12   | 1,200,000 | 121,608,000.00 | 57.60        |
| 2  | 091918001 | 19 农发清发 01 | 800,000   | 80,192,000.00  | 37.98        |
| 3  | 190202    | 19 国开 02   | 200,000   | 20,004,000.00  | 9.48         |

## 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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于股指期货。

## 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

基金管理人可运用国债期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在国债期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与国债期货的投资，以管理投资组合的利率风险，改善组合的风险收益特性。

### 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

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 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中，18 国开 12（180212）、19 国开 02（190202），银保监会网站 2019 年 1 月 4 日发布《河南银保监局筹备组行政处罚信息公开表（豫银保监筹银罚决字〔2018〕1 号）》，主要内容为：国家开发银行河南省分行因办理信贷业务过程中存在调查、审查不尽职，合同签订、担保确认不审慎；未落实抵质押担保措施即发放贷款；贷后管理不到位，风险管控措施不充分等严重不审慎行为，被河南银保监局筹备组合计罚款 150 万元。作出行政处罚决定的日期为 2018 年 12 月 11 日。

固收研究团队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债券主体投资库并跟踪研究。该行政处罚事件发生后，本基金管理人对该发行主体进行了进一步的研究分析，认为此事件未对该债券投资价值判断产生重大的实质性影响。

报告期内本基金投资的前十名证券的其他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内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 本基金未投资超出基金合同规定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | -            |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 1,462,674.68 |
| 5  | 应收申购款   | -            |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |



|   |    |              |
|---|----|--------------|
| 8 | 其他 | -            |
| 9 | 合计 | 1,462,674.68 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

#### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

报告期内本基金没有其他需要说明的重要事项。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                         |                |
|-------------------------|----------------|
| 基金合同生效日基金份额总额           | 210,000,000.00 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额   | -              |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | -              |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额  | -              |
| 本报告期期末基金份额总额            | 210,000,000.00 |

### § 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

单位：份

|                        |               |
|------------------------|---------------|
| 基金合同生效日管理人持有的本基金份额     | -             |
| 基金合同生效日起至报告期期末买入/申购总份额 | 10,000,000.00 |

|                           |               |
|---------------------------|---------------|
| 基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回总份额    | -             |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额          | 10,000,000.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%) | 4.76          |

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期       | 交易份额 (份)      | 交易金额 (元)      | 适用费率 |
|----|------|------------|---------------|---------------|------|
| 1  | 认购   | 2019-07-31 | 10,000,000.00 | 10,001,000.00 | -    |
| 合计 |      |            | 10,000,000.00 | 10,001,000.00 |      |

注：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。

## § 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额<br>总数    | 持有份额占<br>基金总份额<br>比例 | 发起份额<br>总数    | 发起份额占<br>基金总份额<br>比例 | 发起份额承诺<br>持有期限  |
|-------------|---------------|----------------------|---------------|----------------------|-----------------|
| 基金管理人固有资金   | 10,000,000.00 | 4.76%                | 10,000,000.00 | 4.76%                | 自合同生效之日起不少于 3 年 |
| 基金管理人高级管理人员 | -             | -                    | -             | -                    | -               |
| 基金经理等人员     | -             | -                    | -             | -                    | -               |
| 基金管理人股东     | -             | -                    | -             | -                    | -               |
| 其他          | -             | -                    | -             | -                    | -               |
| 合计          | 10,000,000.00 | 4.76%                | 10,000,000.00 | 4.76%                | 自合同生效之日起不少于 3 年 |

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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              | 20190801-20190930      | -    | 200,000,000.00 | -    | 200,000,000.00 | 95.24% |

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。

**9.2 影响投资者决策的其他重要信息**

无。

**§ 10 备查文件目录**

**10.1 备查文件目录**

- 1、中国证监会批准设立光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型的文件
- 2、光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型基金合同
- 3、光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型招募说明书
- 4、光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型托管协议
- 5、光大保德信尊享丰纯债定期开放债券型法律意见书
- 6、光大保德信基金管理有限公司的业务资格批件、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尊享丰纯债定期开放债券型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

**10.2 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。

**10.3 查阅方式**

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

光大保德信基金管理有限公司

二〇一九年十月二十三日