

# 光大保德信耀钱包货币市场基金

## 2020 年第 4 季度报告

2020 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：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年一月二十二日

## § 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 2021 年 1 月 21 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 2020 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	光大保德信耀钱包货币
基金主代码	001973
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 11 月 4 日
报告期末基金份额总额	12,068,760,343.10 份
投资目标	本基金力争保持基金资产的流动性和安全性，追求高于业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	<p>本基金将综合考虑各类投资品种的收益和风险特征，在保证基金资产安全性的基础上力争为投资人创造稳定的收益。同时，本基金将关注宏观经济走势、货币政策和财政政策的变化，结合对货币市场利率变动的预期，对投资组合进行管理。</p> <p>1、久期策略</p> <p>本基金将在对宏观经济环境深入研究的基础上，预期未来市场利率的变化趋势，确定本基金的久期。若预测未来利率将上升，则本基金将通过缩短组合平均剩余期限的办法</p>

	<p>规避利率风险；若预测未来利率下降，则本基金将延长组合平均剩余期限，获取利率下降带来的回报。</p> <p>2、类属资产配置策略</p> <p>类属配置指组合在各类短期金融工具如央行票据、国债、金融债、企业短期融资券以及现金等投资品种之间的配置比例。本基金将通过分析各类属的相对收益、利差变化、流动性风险、信用风险等因素来确定类属配置比例，寻找具有投资价值的投资品种，力争取得较高的回报。</p> <p>3、银行存款投资策略</p> <p>银行存款一般具有收益稳定、风险低等基本特征，特别是机构投资者在投资银行存款时，往往能获得比普通投资者更高的收益率。本基金在投资银行存款时将对不同银行的银行存款收益率做深入的分析，同时结合各银行的信用等级、存款期限等因素的研究，综合考量整体利率市场环境及其变动趋势，在严格控制风险的前提下决定各银行存款的投资比例。</p> <p>4、个券选择策略</p> <p>在个券选择层面，将首先考虑安全性因素，优先选择央票、短期国债等高信用等级的债券品种以规避违约风险。在具体的券种选择上，基金管理人将在正确拟合收益率曲线的基础上，找出收益率出现明显偏高的券种，并客观分析收益率出现偏离的原因。若出现因市场原因所导致的收益率高于公允水平，则该券种价格出现低估，本基金将对此类低估品种进行重点关注。此外，鉴于收益率曲线可以判断出定价偏高或偏低的期限段，从而指导相对价值投资，这也可以帮助基金管理人选择投资于定价低估的短期债券品种。</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</p>
--	---

	<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、证券公司短期公司债券投资策略</p> <p>对于证券公司短期公司债券，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，对拟投资或已投资的证券公司短期公司债券进行流动性分析和监测，尽量选择流动性相对较好的品种进行投资，并适当控制债券投资组合整体的久期，保证本基金的流动性。为防范大额赎回可能引发的流动性风险，本基金将尽量选择可回售给发行方的证券公司短期公司债券进行投资；同时，紧急情况下，为保护基金份额持有人的利益，基金管理人还将启用风险准备金防范流动性风险。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>7、回购策略</p> <p>基金管理人将密切关注短期资金需求激增的机会，通过逆回购的方式融出资金以分享短期资金利率陡升的投资机会。</p>	
业绩比较基准	人民币活期存款利率(税后)。	
风险收益特征	本基金预期收益和风险低于债券型基金、混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	光大保德信耀钱包货币 A	光大保德信耀钱包货币 B
下属分级基金的交易代码	001973	003481
报告期末下属分级基金的份额总额	5,540,534,591.86 份	6,528,225,751.24 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(2020年10月1日-2020年12月31日)	
	光大保德信耀钱包货币 A	光大保德信耀钱包货币 B
1. 本期已实现收益	29,833,813.64	37,690,078.26
2. 本期利润	29,833,813.64	37,690,078.26
3. 期末基金资产净值	5,540,534,591.86	6,528,225,751.24

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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

#### 3.2 基金净值表现

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

###### 1、光大保德信耀钱包货币 A:

阶段	净值收益率 ①	净值收益率 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	0.5846%	0.0006%	0.0894%	0.0000%	0.4952%	0.0006%
过去六个月	1.0056%	0.0012%	0.1789%	0.0000%	0.8267%	0.0012%
过去一年	2.0593%	0.0012%	0.3558%	0.0000%	1.7035%	0.0012%
过去三年	8.4212%	0.0021%	1.0656%	0.0000%	7.3556%	0.0021%
过去五年	15.3887%	0.0022%	1.7763%	0.0000%	13.6124%	0.0022%
自基金合同 生效起至今	15.7880%	0.0022%	1.8326%	0.0000%	13.9554%	0.0022%

###### 2、光大保德信耀钱包货币 B:

阶段	净值收益率 ①	净值收益率 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	0.6452%	0.0006%	0.0894%	0.0000%	0.5558%	0.0006%

过去六个月	1.1275%	0.0012%	0.1789%	0.0000%	0.9486%	0.0012%
过去一年	2.3043%	0.0012%	0.3558%	0.0000%	1.9485%	0.0012%
过去三年	9.2029%	0.0021%	1.0656%	0.0000%	8.1373%	0.0021%
自基金合同生效起至今	13.7762%	0.0023%	1.4311%	0.0000%	12.3451%	0.0023%

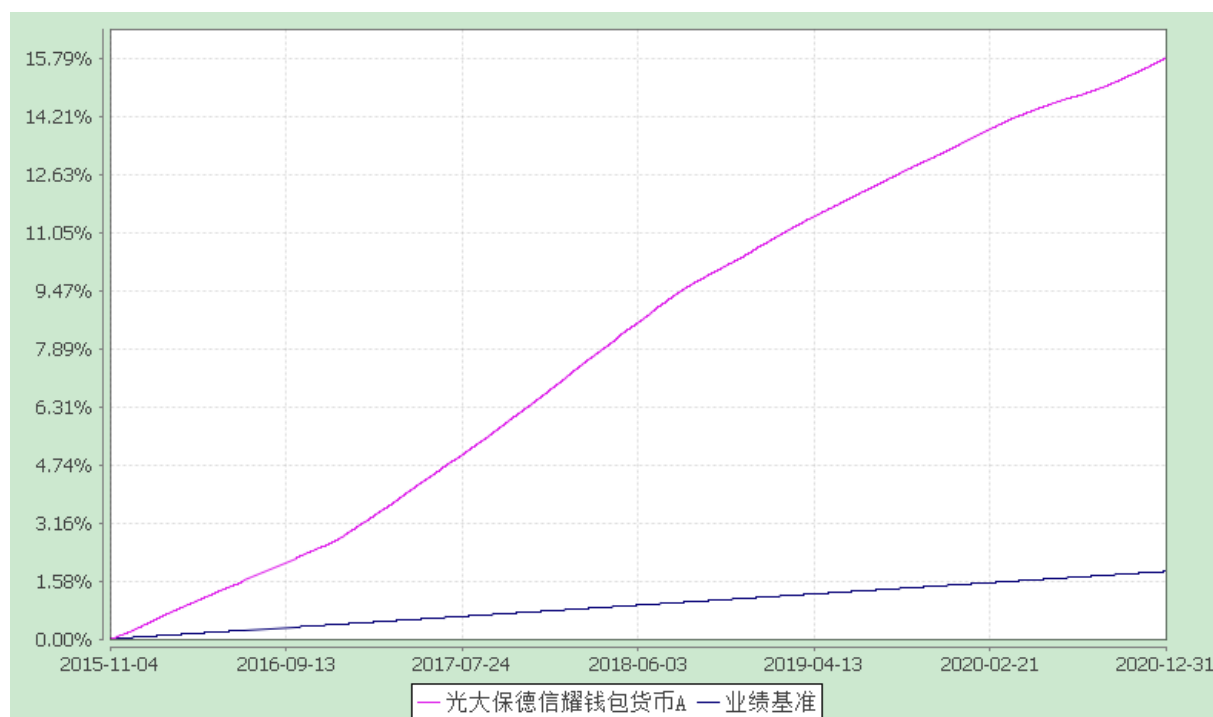
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

光大保德信耀钱包货币市场基金

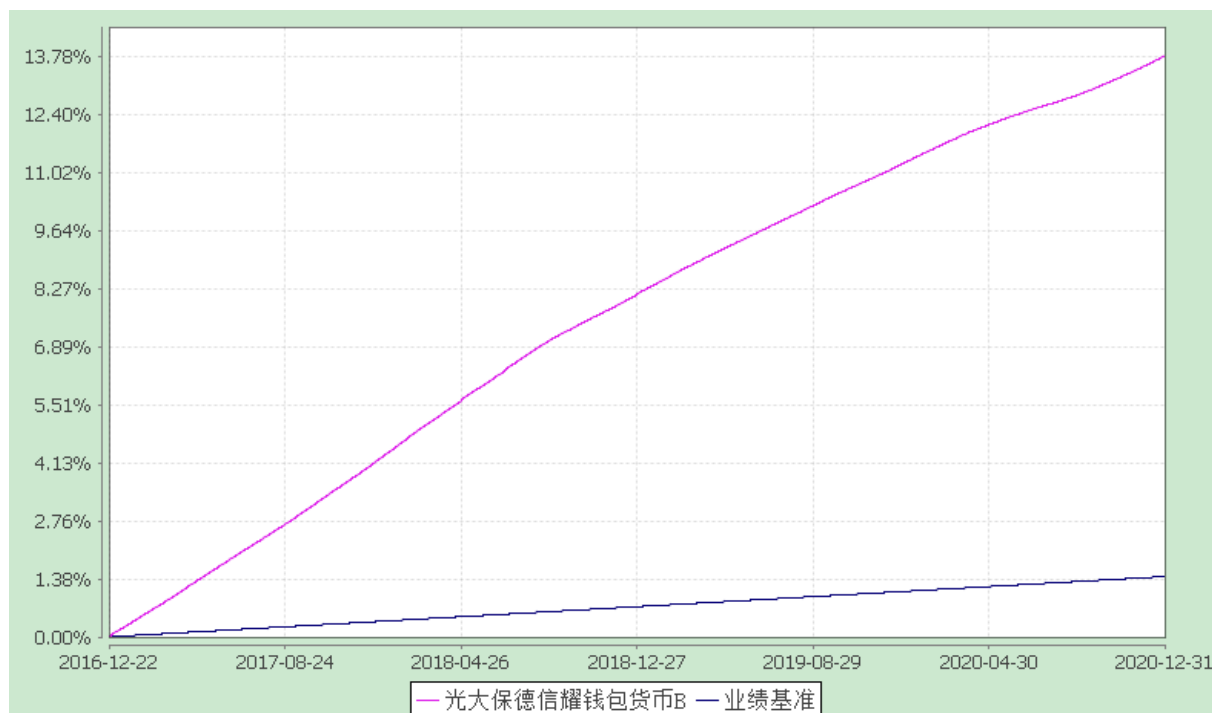
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015 年 11 月 4 日至 2020 年 12 月 31 日)

#### 1、光大保德信耀钱包货币 A



#### 2、光大保德信耀钱包货币 B



注：1、根据本基金管理人2016年12月20日发布的《关于光大保德信耀钱包货币市场基金增加B类份额并修改基金合同的公告》，自2016年12月21日起，本基金增加B类份额。

2、根据基金合同的规定，本基金建仓期为2015年11月4日至2016年5月3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		
魏丽	基金经理	2018-05-05	-	10年	魏丽女士于2007年获得南京财经大学应用数学系学士学位，2010年获得复旦大学统计学硕士学位。2010年9月至2013年7月在融通基金管理有限公司任职交易员、研究员；2013年7月至2017年10月在农银汇理基金管理有限公司任职研究员、基金经理助理、基金经理；2017

				<p>年 10 月加入光大保德信基金管理有限公司，2018 年 3 月至今担任光大保德信现金宝货币市场基金的基金经理，2018 年 5 月至今担任光大保德信耀钱包货币市场基金、光大保德信恒利纯债债券型证券投资基金的基金经理，2018 年 5 月至 2020 年 2 月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，2018 年 12 月至 2020 年 5 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 4 月至今担任光大保德信永利纯债债券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尊泰三年定期开放债券型证券投资基金的基金经理，2020 年 12 月至今担任光大保德信中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--

注：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。

## 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，四季度经济从疫情中继续修复，四季度的金融数据未呈现明显扩张，社融和信贷同比增速有所回落。四季度的经济数据小幅震荡，工业增加值同比增速回落、固定资产投资增速小幅回落、消费增速保持上行。房地产相关数据改善，其中房地产销售数据、商品房销售额回升。另外，基建投资和制造业投资有所回落。受到基数驱动，CPI 同比增速回落明显。从中微观数据来看，经济也呈现出改善的状态，发电同比增速回升，重卡、挖掘机等工程机械销售增速也小幅回升，总体经济继续维持修复态势。

债券市场方面，受货币政策基调维持和年末资金面宽松利好，利率债收益率回调，信用债收益率也下行为主。短端下行幅度大于长端，期限利差有所扩大。

报告期内，光大耀钱包拉长了久期，灵活使用杠杆，精选个券，提升静态收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内耀钱包 A 份额增长率为 0.5846%，业绩比较基准收益率为 0.0894%，耀钱包 B 份额净值增长率为 0.6452%，业绩比较基准收益率为 0.0894%。

### 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	固定收益投资	4,056,484,783.22	32.52

	其中：债券	4,056,484,783.22	32.52
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,407,223,390.82	27.32
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	4,955,180,168.34	39.73
4	其他资产	54,774,671.19	0.44
5	合计	12,473,663,013.57	100.00

## 5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	5.75	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	400,044,199.93	3.31
	其中：买断式回购融资	-	-

注：上表中，报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

## 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

无

## 5.3 基金投资组合平均剩余期限

### 5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	79
报告期内投资组合平均剩余期限	87

最高值	
报告期内投资组合平均剩余期限	54
最低值	

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

无

### 5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30天以内	36.56	3.31
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天（含）—60天	11.59	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	14.95	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天（含）—120天	8.46	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天（含）—397天（含）	31.35	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-

合计	102.90	3.31
----	--------	------

#### 5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

报告期内投资组合平均剩余存续期未有违规超过240天的情况。

#### 5.5 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	1,036,485,508.68	8.59
	其中：政策性金融债	1,036,485,508.68	8.59
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	3,019,999,274.54	25.02
8	其他	-	-
9	合计	4,056,484,783.22	33.61
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

#### 5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160416	16 农发 16	6,200,000	620,661,341.47	5.14
2	112004109	20 中国银行 CD109	4,000,000	394,556,997.84	3.27
3	180208	18 国开 08	2,100,000	210,796,278.55	1.75
4	112070034	20 深圳农商银行	2,000,000	199,674,919.83	1.65

		CD019			
5	112018037	20 华夏银行 CD037	2,000,000	199,450,546.14	1.65
6	112004051	20 中国银行 CD051	2,000,000	199,387,194.41	1.65
7	112021484	20 渤海银行 CD484	2,000,000	198,938,590.53	1.65
8	112016283	20 上海银行 CD283	2,000,000	197,380,186.74	1.64
9	112003177	20 农业银行 CD177	2,000,000	197,352,348.55	1.64
10	112003176	20 农业银行 CD176	2,000,000	197,348,613.73	1.64

### 5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0 次
报告期内偏离度的最高值	0.0474%
报告期内偏离度的最低值	-0.0190%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0130%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

无

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

无

5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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。

### 5.9 投资组合报告附注

#### 5.9.1 基金计价方法说明

(1) 本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内摊销，每日计提损益。(2) 为了避免采用摊余成本法计算的资产净值与按市场利率和交易市价计算的资产净值发生重大偏离，从

而对基金持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用市场利率或交易价格，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当基金资产净值与影子定价的偏离达到或超过基金资产净值的一定幅度时，或基金管理人认为发生了其他的重大偏离时，基金管理人可以与基金托管人商定后进行调整，使基金资产净值更能公允地反映基金资产净值，确保以摊余成本法计算的基金资产净值不会对基金持有人造成实质性的损害。(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。(4) 如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。

5.9.2 本基金所投资的债券 20 上海银行 CD283 (112016283. IB) 的发行主体上海银行股份有限公司于 2020 年 11 月 18 日收到上海银保监局行政处罚信息公开表（沪银保监银罚决字〔2020〕25 号），主要内容为：1. 2014 年至 2018 年，该行绩效考评管理严重违反审慎经营规则。2. 2018 年，该行未按规定延期支付 2017 年度绩效薪酬。中国银行保险监督管理委员会上海监管局作出行政处罚决定为：责令改正，并处罚款共计 80 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。

本基金所投资的债券 20 中国银行 CD109 (112004109. IB)、20 中国银行 CD051 (112004051. IB) 的发行主体中国银行股份有限公司于 2020 年 4 月 20 日、2020 年 12 月 1 日分别收到《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〕4 号）、《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〕60 号），主要内容为：

银保监罚决字〔2020〕4 号：中国银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：（一）理财产品数量漏报；（二）资金交易信息漏报严重；（三）贸易融资业务漏报；（四）分户账明细记录应报未报；（五）分户账账户数据应报未报；（六）关键且应报字段漏报或填报错误。中国银行保险监督管理委员会作出处罚决定为罚款 270 万元。

银保监罚决字〔2020〕60 号：中国银行“原油宝”产品风险事件相关违法违规行为主要包括：产品管理不规范，包括保证金相关合同条款不清晰、产品后评价工作不独立、未

对产品开展压力测试相关工作等；风险管理不审慎，包括市场风险限额设置存在缺陷、市场风险限额调整和超限操作不规范、交易系统功能存在缺陷未按要求及时整改等；内控管理不健全，包括绩效考核和激励机制不合理、消费者权益保护履职不足、全行内控合规检查未涵盖全球市场部对私产品销售管理等；销售管理不合规，包括个别客户年龄不满足准入要求、部分宣传销售文本内容存在夸大或者片面宣传、采取赠送实物等方式销售产品等。中国银行保险监督管理委员会作出处罚决定为罚款 5050 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。

本基金所投资的债券 20 深圳农商银行 CD019 (112070034. IB) 的发行主体深圳农村商业银行股份有限公司于 2020 年 4 月 2 日收到中国银保监会深圳监管局行政处罚信息公开表（深银保监罚决字（2020）11 号），主要内容为：深圳农村商业银行重大关联交易未按照监管要求进行审批；强制休假及重要岗位轮岗执行严重不到位；流动资金贷款审查严重不尽职；贷前调查不尽职导致信贷资金被挪用于缴纳土地出让金；贷款用途审查不尽职导致信贷资金回流借款人；向项目资本金不足的项目发放房地产开发贷款；以贷收贷；利用本行信贷资金承接理财产品。中国银保监会深圳监管局作出行政处罚决定为罚款 260 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。

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。

### 5.9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	54,484,571.64

4	应收申购款	290,099.55
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	54,774,671.19

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	光大保德信耀钱包货币A	光大保德信耀钱包货币B
本报告期期初基金份额总额	4,546,117,203.32	6,555,586,917.95
报告期期间基金总申购份额	23,619,125,950.67	3,442,892,078.26
报告期期间基金总赎回份额	22,624,708,562.13	3,470,253,244.97
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	5,540,534,591.86	6,528,225,751.24

## § 7 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	20201001-20201213, 20201217-20201224	2,002,339,285.79	11,337,088.90	1,000,000,000.00	1,013,676,374.69	8.40%
	2	20201217-20201224	1,000,381,514.55	6,443,760.71	0.00	1,006,825,275.26	8.34%
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

本报告期内，经公司十届五次董事会会议审议通过，自 2020 年 11 月 12 日起，翟昱磊正式担任公司首席市场总监。经公司十届十次董事会会议审议通过，自 2020 年 11 月 6 日起，林昌先生正式离任公司董事长，公司总经理刘翔先生代任公司董事长，自 2020 年 11 月 23 日起，公司总经理刘翔先生不再代任公司董事长，王翠婷女士正式担任公司董事长。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立光大保德信耀钱包货币市场基金的文件
- 2、光大保德信耀钱包货币市场基金基金合同
- 3、光大保德信耀钱包货币市场基金招募说明书
- 4、光大保德信耀钱包货币市场基金托管协议
- 5、光大保德信耀钱包货币市场基金法律意见书
- 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耀钱包货币市场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。

光大保德信基金管理有限公司

二〇二一年一月二十二日