

光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金

2021 年第 3 季度报告

2021 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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年十月二十七日

§ 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 26 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	光大保德信国企改革股票
基金主代码	001047
交易代码	001047
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 3 月 25 日
报告期末基金份额总额	196,238,903.13 份
投资目标	本基金将精选受益于国企改革的相关证券，在有效控制风险前提下，力求超越业绩比较基准的投资回报，争取实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略 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。

	首先，建立宏观指标监测体系。 本基金将严密跟踪分析反映宏观经济及证券市场运行的指标，以求把握整个宏观经济形势的未来走向和节奏，进而为本基金的资产配置决策提供支持。 具体来说，宏观经济运行指标主要包括： （1）宏观经济先行指标，如狭义货币供应量（M1）、广义货币供应量（M2）、财政预算、制造业采购经理指数（PMI）、大宗商品库存及价格变化等； （2）宏观经济状态指标，如 GDP、CPI、PPI、规模以上工业企业增加值及利润和失业率等。 证券市场指标主要包括： （1）股票市场：估值水平及历史估值波动区间、资金供求状况、成交量及换手率等、投资者结构数据及其变化等； （2）债券市场：债券收益率水平、收益率曲线历史变动、流动性和资金供求状况等。 其次，对上述数据与大类资产收益率数据进行分析研究，把握其联系及规律。 在确立上述宏观经济指标和证券市场指标对各类资产预期收益率的影响模式后，再结合对上述宏观指标的分析预测，最终确定各大类资产的配置比例。 2、股票投资策略 本基金认为当前受益于国企改革的上市公司股票涉及多个行业，本基金将通过自下而上研究入库的方式，对各个行业中受益于国企改革主题的上市公司进行深入研究，并将这些股票组成本基金的核心股票库。对国企改革主题的上市公司界定如下： I、受益于制度改革的国有企业，包括通过国资监管体制改革、产权制度改革（如兼并重组、整合上市、混合所有
--	--

	制改革等)以及国企管理制度改革(如经营机制、激励机制改革等)等多种方式,提高运营效率和竞争力的国有上市公司; II、通过国企改革,一些行业的垄断格局被打破,因此激发出更多活力的部分民营上市公司。 未来若出现其他受益于国企改革进程的上市公司,本基金也应在深入研究的基础上,将其列入核心股票库。本基金将在核心股票库的基础上,以定性和定量相结合的方式、从价值和成长等因素对个股进行选择,精选估值合理且成长性良好的上市公司进行投资。 (1) 定量分析 本基金结合盈利增长指标、现金流量指标、负债比率指标、估值指标、盈利质量指标等与上市公司经营有关的重要定量指标,对目标上市公司的价值进行深入挖掘,并对上市公司的盈利能力、财务质量和经营效率进行评析,为个股选择提供依据。 (2) 定性分析 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,本基金将通过升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) 存托凭证的投资策略 本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。 3、固定收益类品种投资策略 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。 4、股指期货投资策略 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、中小企业私募债 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。 6、权证及其他品种投资策略 本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，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。 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。
业绩比较基准	中证国有企业改革指数×80% +中证全债指数×20%。
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益和风险高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§ 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 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日)
1. 本期已实现收益	-17,208,754.26
2. 本期利润	-35,610,900.77
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1586
4. 期末基金资产净值	357,580,023.10

5. 期末基金份额净值	1.822
-------------	-------

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。

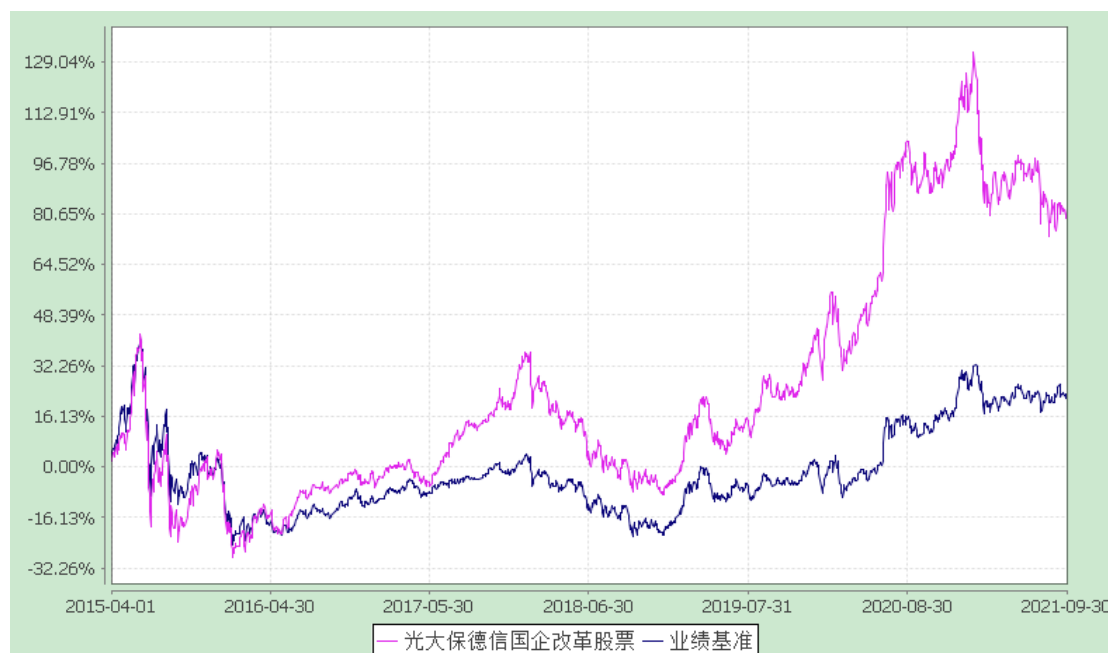
3.2 基金净值表现

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	-6.95%	1.64%	-0.64%	0.91%	-6.31%	0.73%
过去六个月	-2.93%	1.43%	2.07%	0.85%	-5.00%	0.58%
过去一年	-3.70%	1.52%	11.59%	0.97%	-15.29%	0.55%
过去三年	78.10%	1.51%	39.79%	1.10%	38.31%	0.41%
过去五年	96.76%	1.35%	44.90%	0.98%	51.86%	0.37%
自基金合同生效起至今	82.20%	1.69%	22.56%	1.33%	59.64%	0.36%

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

光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2015 年 3 月 25 日至 2021 年 9 月 30 日)



注：本基金于2015年3月25日成立，根据基金合同的规定，本基金建仓期为2015年3月25日至2015年9月25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		
林晓凤	权益管理总部权益投资团队副团长、基金经理	2020-10-24	-	17 年	林晓凤女士，复旦大学国际金融系硕士。2003年至2016年在兴业证券股份有限公司担任证券投资部研究员、投资经理、总助、副总监、兴证投资子公司常务副总；2016 年 6 月加入光大保德信基金管理有限公司，历任专户投资部总监，2016 年 12 月至 2018 年 9 月担任光大保德信多策略价值收益 1 号资产管理计划的投资经理，2017 年 6 月至 2018 年

					9 月担任光大保德信多策略价值收益 2 号资产管理计划的投资经理，2017 年 11 月至 2018 年 9 月担任光大保德信光耀量化对冲 1 号资产管理计划、光大保德信光耀量化对冲 2 号资产管理计划的投资经理，2018 年 3 月至 2018 年 9 月担任光大保德信多策略掘金价值 1 号资产管理计划的投资经理，现任权益管理总部权益投资团队副团队长，2018 年 10 月至今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，2018 年 11 月至 2020 年 7 月担任光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 11 月至今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，2020 年 10 月至今担任光大保德信国企改革主题股票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，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

2021Q3 市场继续分化，表现最好的是国证 2000，涨 7.6%，沪深 300 则只有-6.8%，科创 50 -13.8%，上证-0.6%，深成指-5.6%，创业板指-6.7%，说明主题泛化配置的二三线个股表现优秀，同时成长板块调整严重，主要是景气度有所下降或政策扰动的 TMT、医药、餐饮等。

月度行业和风格反转剧烈，板块轮动极快，7 月大消费被转向成长的基金继续甩卖，成长趋势投资愈演愈烈，到月底双双跳水；8 月主板震荡反弹，大消费延续跌势，景气度出现轻微下滑的高估值医药、电子成长跳水杀跌，市场交易滞涨，周期资源股成为风口的猪；9 月杀估值杀趋势，大消费反弹，周期资源股大跌，但公用事业和房地产、采掘延续上月强势。

2021q3 行业涨幅居前的也是周期和新能源：采掘 36.6%，公用事业 25.2%，有色 23.1%，钢铁 19.7%，化工 13.7%，电气设备 13.1%；跌幅居前的是大消费：医药-13.7%，休闲-13.1%，餐饮-13%，传媒-10.9%，家电-10.1%，纺服-10.1%；银行-9.6%。

我们的组合本期是坚守价值-成长平衡风格，在细分行业内做结构切换，以成长、金融和大消费为核心配置，主要底仓在 TMT、新能源、大金融、机械和农业，增持农业、建筑、电子、机械和计算机，及时降低食品饮料、医药、传媒、建材的配置。其中，新能源、军工及相关产业链的机械、材料，表现优秀，减持大消费相对成功，规避了食品饮料和家电的损失，医药做了波段，损失相对较小，农业有一定贡献。同时，坚持稳健和企业资质为底的投资底线，暴涨暴跌的周期资源股没有参与。

配置风格上，更为均衡，标的有一定分散化，前期对二三线标的较深入覆盖和研究取得

了一定效果，主要是新能源、军工产业链标的，赚取了部分收益，同时在市场情绪冲动、估值高位下也能够及时卖出。

展望后市，关注多地限电的影响及美储货币政策边际收紧的进度。经历前三季度成长-周期-消费反弹等几大板块轮动，大小票的估值收敛变化也相对到高位，对量化交易和主题基金风格偏离的监管下，趋势操作相对和缓，q4 也是更着眼明年布局的时间点，预计后继市场会进入较为正常的、平衡的投资模式。

更侧重自下而上策略，结合行业、政策景气度变化趋势：三季报基数效应削弱，更能分辨出个股的业绩和资产质量，由于市场关注度高以及涨跌幅板变大，日内波动会很大，投资中注重严控交易风险，关注交易结构的安全性。坚持价值-成长均衡配置，兼顾明年布局，在景气度、估值和市场情绪中寻找合适的性价比。自下而上，寻找和国企改革或国资参投相关的标的，近期军改或有所动作。

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-6.95%，业绩比较基准收益率为-0.64%。

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	311,879,624.84	86.53
	其中：股票	311,879,624.84	86.53
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	28,891,648.11	8.02
7	其他各项资产	19,643,641.47	5.45
8	合计	360,414,914.42	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	29,281,124.70	8.19
B	采矿业	-	-
C	制造业	124,758,687.48	34.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	24,785,428.39	6.93
F	批发和零售业	26,107.51	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	3,345.12	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	51,843,737.30	14.50
J	金融业	51,652,292.00	14.44
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	29,486,363.34	8.25
N	水利、环境和公共设施管理业	38,613.78	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,925.22	0.00

S	综合	-	-
	合计	311,879,624.84	87.22

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	002230	科大讯飞	563,700.00	29,819,730.00	8.34
2	000998	隆平高科	1,365,516.00	29,263,007.88	8.18
3	300073	当升科技	355,683.00	29,201,574.30	8.17
4	300014	亿纬锂能	245,200.00	24,282,156.00	6.79
5	002049	紫光国微	110,800.00	22,913,440.00	6.41
6	600845	宝信软件	270,283.00	17,838,678.00	4.99
7	601669	中国电建	2,086,500.00	17,672,655.00	4.94
8	300450	先导智能	252,840.00	17,653,288.80	4.94
9	601398	工商银行	3,415,700.00	15,917,162.00	4.45
10	002142	宁波银行	449,800.00	15,810,470.00	4.42

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金所投资的工商银行（601398）的发行主体中国工商银行股份有限公司于 2021 年 1 月 8 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚（银保监罚决字〔2020〕71 号），具体内容如下：

银保监罚决字〔2020〕71 号：一、未按规定将案件风险事件确认为案件并报送案件信息确认报告；二、关键岗位未进行实质性轮岗；三、法人账户日间透支业务存在资金用途管理的风险漏洞；四、为同业投资业务提供隐性担保；五、理财产品通过申购/赎回净值型理财产品调节收益；六、非标准化债权资产限额测算不准确；七、理财资金通过投资集合资金信托计划优先级的方式变相放大劣后级

受益人的杠杆比例；八、部分重点领域业务未向监管部门真实反映；九、为违规的政府购买服务项目提供融资；十、理财资金违规用于缴纳或置换土地款；十一、通过转让分级互投实现不良资产虚假出表；十二、理财资金投资本行不良资产或不良资产收益权；十三、面向一般个人客户发行的理财产品投资权益性资产；十四、理财资金投资他行信贷资产收益权或非标资产收益权；十五、全权委托业务不规范；十六、用其他资金支付结构性存款收益；十七、自营贷款承接本行理财融资、贷款用途管理不尽职；十八、理财资金承接本行自营贷款；十九、封闭式理财产品相互交易调节收益；二十、滚动发行产品承接风险资产，且按原价交易调节收益；二十一、高净值客户认定不审慎；二十二、理财产品信息披露不到位；二十三、部分理财产品在全国银行业理财信息登记系统中未登记或超时限登记。行政处罚决定为：银保监罚决字〔2020〕71号：罚款5470万元。

本基金所投资的宁波银行（002142）的发行主体宁波银行股份有限公司于2020年10月27日收到宁波银保监局行政处罚信息公开表（甬银保监罚决字〔2020〕48号），于2021年6月11日收到宁波银保监局行政处罚信息公开表（甬银保监罚决字〔2021〕36号），于2021年7月21日收到中国人民银行宁波市中心支行的行政处罚（甬银处罚字〔2021〕2号），于2021年8月6日收到中国银行保险监督管理委员会宁波监管局的行政处罚（甬银保监罚决字〔2021〕57号），主要内容为：甬银保监罚决字〔2020〕48号：宁波银行股份有限公司授信业务未履行关系人回避制度、贷后管理不到位。宁波银保监局作出行政处罚决定为罚款人民币30万元，并责令该行对贷后管理不到位直接责任人员给予纪律处分。

甬银保监罚决字〔2021〕36号：代理销售保险不规范。宁波银保监局作出行政处罚决定为罚款人民币25万元，并责令该行对贷后管理不到位直接责任人员给予纪律处分。

甬银处罚字〔2021〕2号：1. 违规为存款人多头开立银行结算账户；2. 超过期限或未向中国人民银行报送账户开立、变更、撤销等资料；3. 占压财政存款；4. 未按照规定履行客户身份识别义务；5. 未按照规定报送大额交易报告和可疑交易报告；6. 与身份不明的客户进行交易或者为客户开立匿名账户、假名账户。处罚结果：给予警告，并处罚款286.2万元。

甬银保监罚决字〔2021〕57号：贷款被挪用于缴纳土地款或土地收储；开发贷款

支用审核不严；房地产贷款放款和支用环节审核不严；贷款资金违规流入房市；房地产贷款资金回流借款人；票据业务开展不审慎。处罚结果：罚款人民币 275 万元，并责令该行对相关直接责任人给予纪律处分。

基金管理人按照内部研究工作规范对该股票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，基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

除上述证券外，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	361,178.67
2	应收证券清算款	19,060,178.74
3	应收股利	—
4	应收利息	-1,223.66
5	应收申购款	223,507.72
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	19,643,641.47

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	250,331,374.62
报告期期间基金总申购份额	8,579,519.13
减：报告期期间基金总赎回份额	62,671,990.62
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	196,238,903.13

§ 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国企改革主题股票型证券投资基金注册的文件
- 2、光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金基金合同
- 3、光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金招募说明书
- 4、光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金托管协议

- 5、光大保德信国企改革主题股票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国企改革主题股票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。

光大保德信基金管理有限公司

二〇二一年十月二十七日