

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 本基金投资的前十名股票未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)
----	----	-------

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	14,563,662
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,683,766
5	应收申购款	692,211
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,360.693

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券余额

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受重大影响的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在受重大影响的情况。

§ 6 开放式基金份额变动

本报告期初基金份额总额	91,506,428.92
报告期内基金份额变动	1,520,469.68
报告期末基金份额总额	2,161,463.90
报告期内基金份额变动情况	
本报告期末基金份额总额	90,476,223.76

单位：份

§ 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

本基金报告期内,基金管理人不存在持有、申购、赎回或买卖本基金的情况。

§ 8 报告期内基金投资业务的其他重要事项

8.1 报告期内前十大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				报告期末持有基金份额情况	
序号		期初持有份额 例数占投资者总数 20%的时间区间	申购	赎回	持有的份 额	份额占比	
机构	B类人	2018/10/01- 12/31	37, 922, 15,046	-	37, 922, 15,046	41.82%	
产品特有风险							
本基金基金份额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或大额赎回导致的风险，包括：							
(1) 对基金的投资造成冲击，存在对利率和债券价格的敏感引发净值波动的风险。							
(2) 基金管理人对基金份额的流动性需求可能导致部分投资者的赎回申请，或因赎回费归入基金资产而间接影响基金资产净值波动等风险。							
(3) 因基金份额持有人结构不均，而导致部分投资者不购买基金份额而在同一投资标的下及投资策略、或投资决策上难以满足持续操作的需求。							
本基金A类基金份额的大额申购对基金持有集中度有影响，在运作中保持合适的流动性水平，保持持有人利益。							
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 备查文件目录			
1、中国证监会核准光大保德信现金增利混合型证券投资基金基金设立的文件				2、光大保德信现金增利混合型证券投资基金合同			

3、光大保德信风格轮动混合型证券投资基金招募说明书
4、光大保德信风格轮动混合型证券投资基金投资经理报告
5、光大保德信风格轮动混合型证券投资基金基金法律意见书
6、基金管理人业务资格证件、营业执照、公司章程
7、基金托管人业务资格证件、营业执照、公司章程
8、报告期内光大保德信风格轮动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

22. 存放地点
上海市浦东新区中山东二路558号外滩金融中心1幢6至10层本基金管理人办公地址。

23. 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:40088-2022-888,021-80252888,公司网站:www.evgf.com.cn

光大保德信基金管理有限公司
二〇一九年一月十八日

5.10.1 本期国债期货投资策略
本基金本报告期未投资国债期货。

5.10.2	报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细	
5.10.3	本报告期末未有持仓国债期货	
5.11	本报告期国债期货投资 本基金本报告期末未有国债期货	
5.12	投资组合报告附注	
5.12.1	报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体(除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)	
5.12.2	本基金未投资超出基金合同规定的各备选股票	
5.12.3	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	111,219,338.44	
5	应收申购款	-	
6	其他应收款	-	
7	待摊费用	-	
8	其他	-	
9	合计	111,219,338.44	

5.1.1.4报告期末持有的处于转股期且可转换债券明细

本基金本报告期末持有处于转股期且可转换债券

5.1.1.5报告期末前十名股票持仓存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有受限。

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	光大保德信永利纯债债券A	光大保德信永利纯债债券C
本报告期期初基金份额总额	5,198,631,707.08	40,964,771
报告期间基金份额净申购	63,027,112	15,810,517
报告期间基金份额净赎回	672,623	1,467,390
本报告期末基金份额总额	5,189,026,121.59	58,008,398

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基金份额变动情况

本报告由本基金的基金管理人独立编制。除法律法规另有规定外，本基金管理人、基金托管人及会计师事务所均不承担由此引起的任何责任。

本报告期前，基金管理人不存在持有、申购、赎回或买卖本基金的情况。

基金管理人、基金托管人和基金销售机构及其相关人员均承诺：在提供本报告期间数据时，保证所披露的数据真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

R.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		报告期期初持有基金份额占期末基金份额比例			报告期末持有基金份额		
序号		持有的基金份额 占总份额的比例	期初份数	中期份数	期末份数	持有份额	份额占比
例	1	2018年10月1日至12月31日	6,198,492.00 5.01%	-	-	6,198,492.00 49.02%	100.00%

机构投资者

本报告期末持有基金份额为0股，无基金份额持有人。

本基金本报告期间任一投资者持有基金份额比例达到20%的期间，可侧面反映出该投资者的投资情况，具体如下：

- (1) 该机构投资者持有基金份额过程中，存在对标的股票进行短线交易的情形；
- (2) 该机构投资者以基金合同约定的出资方式要求被投资企业接受投资后，将被投资企业从基金管理人处取得基金份额并作为其出资，从而成为被投资企业股东；
- (3) 该机构投资者通过认购方式，向被投资企业投入资金实现基金合同约定的对外投资及股权投资。

本管理人声明前述情形与大额申购和赎回行为没有关联，在运作中保持适度的流动性水平，符合基金合同约定。

R.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 查看文件目录

9.1 备查文件目录

- 中国证监会核准设立光大保德信永利纯债债券型证券投资基金的文件
- 光大保德信永利纯债债券型证券投资基金基金合同
- 光大保德信永利纯债债券型证券投资基金招募说明书

- 4、光大保德信永利纯债债券型证券投资基金托管协议
- 5、光大保德信永利纯债债券型证券投资基金法律意见书
- 6、光大保德信基金管理有限公司的公司业务资格、营业范围、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永利纯债债券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
- 10、有效身份证件

上海市浦东新区世纪大道1668号外滩金融中心1幢6层至10层本基金的基金管理人办公场所

9.3查阅方式

投资者可在本基金管理人办公时间查阅。投资者对本公告如有任何疑问，可咨询本基金管理人。客户服务电话:40082-2022-888, 021-82502888。本公司网址: www.eopfund.com.cn

光大保德信基金管理有限公司

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	申购	2018-10-09	34,000,000.00	34,000,000.00	-
2	赎回	2018-10-17	-2,000,000.00	-2,000,457.15	-
3	赎回	2018-10-22	-112,000,000.00	-112,065,715.94	-
		2018-10-22			

4	赎回	2018-11-9	-2,000,000.00	-2,002,189.65	-
5	申购	2018-11-9	26,000,000.00	26,000,000.00	-
6	赎回	2018-11-12	-4,000,000.00	-4,007,084.50	-
7	赎回	2018-11-15	-16,000,000.00	-16,001,196.60	-
8	赎回	2018-11-26	-33,000,000.00	-33,029,108.63	-
9	申购	2018-12-3	22,000,000.00	22,000,000.00	-
10	申购	2018-12-4	40,000,000.00	40,000,000.00	-
11	赎回	2018-12-12	-4,000,000.00	-4,005,945.34	-
12	赎回	2018-12-18	-5,000,000.00	-5,001,057.06	-
13	赎回	2018-12-24	-9,000,000.00	-9,006,337.03	-
14	基金转出(转出)	2018-12-26	-43,500,000.00	-43,537,866.40	-
		2018-12-31	70,000,000.00		-

15	基金转出(出)	-22,226.6	0.0000	-20,017,406.24	-
合计		0.0000	-129,500.00	38,643.00	

注：基金管理人于本报告期内快速收取业务付款的累计金额为188,670.29元。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

6.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金份额		
	序号	持有基金份额比例达到或超过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	20181001-20181231	3,712,574,062.11	26,104,319.52	-	3,738,678,401.63	24.22%
	2	20181115-20181119	2,516,439,540.42	2,516,439,540.42	693,907.26	2,534,133,447.58	16.42%
	产品特有风险						
	本基金为人民币货币型基金，追求长期持有并实现资产的持续增值，可能面临赎回、投资期限						

基金的情况,因此:

- (1)对资金的流动性造成冲击,存在对剩余投资者的赎回造成影响的風險。
- (2)基金管理人因基金固的流动性要求致使部分投资者受到限制,或因赎回者进入基金资产等原因,导致基金资产净值波动的问题,影响基金的投资运作和收益水平。
- (3)因基金资产规模过大,而导致部分投资者不能实现基金合同中所约定的投资目标及投资策略,导致基金不能满足条件赎回。

管理人将审慎评估大额申购对基金持有集中度影响,在运作中保持合适的流动性水平,保持持有人利益。

6.2 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、中国证监会批准设立光大保德信货币宝货币市场基金的文件
- 2、光大保德信货币宝货币市场基金基金合同
- 3、光大保德信货币宝货币市场基金招募说明书
- 4、光大保德信货币宝货币市场基金托管协议
- 5、光大保德信货币宝货币市场基金投资策略
- 6、光大保德信基金管理有限公司的业务资格证件、营业执照、公司章程
- 7、基金托管人业务资格证件和营业执照

8、报告期内光大保德信现金宝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568号外滩金融中心1幢6层至10层本基金管理人办公地址。

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,可咨询向本基金管理人。 客户服务中心电话:4008-202-888,021-80262888。 公司网址: www.ept.com.cn。

光大保德信基金管理有限公司

二〇一九年一月十九日