

# 光大保德信北证 50 成份指数型证券投资基金

## 2026 年第 3 季度报告

2026 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：二〇二六年十月二十七日

## § 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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 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 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |                                                                                                   |
|------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 光大保德信北证 50 成份指数                                                                                   |
| 基金主代码      | 027323                                                                                            |
| 交易代码       | 027323                                                                                            |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                            |
| 基金合同生效日    | 2026 年 6 月 2 日                                                                                    |
| 报告期末基金份额总额 | 303,728,412.06 份                                                                                  |
| 投资目标       | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的预期日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.35%，预期年化跟踪误差不超过 4%。 |
| 投资策略       | 1、股票投资策略<br>(1) 指数化投资策略                                                                           |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重来构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。</p> <p>（2）替代性策略</p> <p>当成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可采取其他合理的投资方法适当调整基金投资组合，包括通过投资成份股、备选成份股、非成份股等进行替代，以达到紧密跟踪标的指数的目的，尽量降低跟踪误差。</p> <p>特殊情形包括但不限于：1）法律法规的限制；2）标的指数成份股流动性严重不足；3）标的指数的成份股票长期停牌；4）标的指数成份股进行配股、增发或被吸收合并等公司行为；5）标的指数成份股派发现金股息；6）指数成份股定期或临时调整；7）标的指数编制方法发生变化；8）其他基金管理人认定不适合投资的股票或可能限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。</p> <p>（3）本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部程序后及时对相关成份股进行调整。</p> <p>（4）存托凭证投资策略</p> <p>本基金将根据投资目标和股票投资策略，通过定性和定量分析相结合的方式，对存托凭证的发行</p> |
|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>企业和所属行业进行深入研究判断，在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，精选出具备投资价值的存托凭证进行投资。</p> <p>2、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>信用债投资策略方面，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>本基金通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势等因素，并结合各种固定收益类资产在特定经济形势下的估值水平、预期收益和预期风险特征，在符合本基金相关投资比例规定的前提下，决定组合的期限结构和类属配置，并在此基础上实施债券投资组合管理，力争获取较高的投资收益。</p> <p>3、可转换债券和可交换债券投资策略</p> <p>可转换债券（以下或称“可转债”）兼具权益类证券与固定收益类证券的特性。本基金主要从公司基本面分析、理论定价分析、债券发行条款、投资导向的变化等方面综合评估可转债投资价值，选取具有较高价值的可转债进行投资。本基金将着重对可转债对应的基础股票进行分析与研究，对那些有着较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转债进</p> |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>行重点选择。</p> <p>本基金将综合分析可交换债券的基本情况、发行人资质、转股标的等因素，对可交换债券的风险收益特征进行评估，在风险可控的前提下，选取具有盈利空间的优质标的进行投资。</p> <p>同时，本基金还将密切跟踪可交换债券的估值变化情况和发行主体经营状况，合理控制可交换债券的投资风险。</p> <p>4、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>5、衍生品投资策略</p> <p>本基金在进行股指期货投资时，将按照风险管理的原则，以套期保值为目的，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，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。</p> <p>6、融资及转融通证券出借业务的投资策略</p> <p>本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资及转融通证券出借业务。本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵</p> |
|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |                   |
|-------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|
|             | <p>保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。本基金参与转融通证券出借业务，将综合分析市场情况、投资者结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等条件，合理确定转融通证券出借的范围、期限和比例。</p> <p>若相关融资及转融通证券出借业务法律法规和监管要求发生变化，本基金将从其新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。</p> <p>7、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。</p> |                   |
| 业绩比较基准      | 北证 50 成份指数收益率×95%+活期存款基准利率×5%。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |                   |
| 风险收益特征      | <p>本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金投资北京证券交易所股票，将面临因投资标的、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 | 光大保德信北证 50 成份指数 A                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 光大保德信北证 50 成份指数 C |

|                 |                 |                  |
|-----------------|-----------------|------------------|
| 下属分级基金的交易代码     | 027323          | 027324           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 60,810,438.16 份 | 242,917,973.90 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 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日) |                       |
|----------------|-----------------------------------------|-----------------------|
|                | 光大保德信北证 50 成份<br>指数 A                   | 光大保德信北证 50 成份<br>指数 C |
|                |                                         |                       |
| 1.本期已实现收益      | -1,675,328.31                           | -6,716,561.42         |
| 2.本期利润         | -9,227,746.31                           | -36,086,196.85        |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.1444                                 | -0.1476               |
| 4.期末基金资产净值     | 51,380,568.08                           | 204,902,951.80        |
| 5.期末基金份额净值     | 0.8449                                  | 0.8435                |

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 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、光大保德信北证 50 成份指数 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 | -14.81%    | 1.78%         | -16.08%        | 1.88%                 | 1.27% | -0.10% |
| 自基金合同 | -15.51%    | 1.58%         | -15.97%        | 1.90%                 | 0.46% | -0.32% |

|       |  |  |  |  |  |  |
|-------|--|--|--|--|--|--|
| 生效起至今 |  |  |  |  |  |  |
|-------|--|--|--|--|--|--|

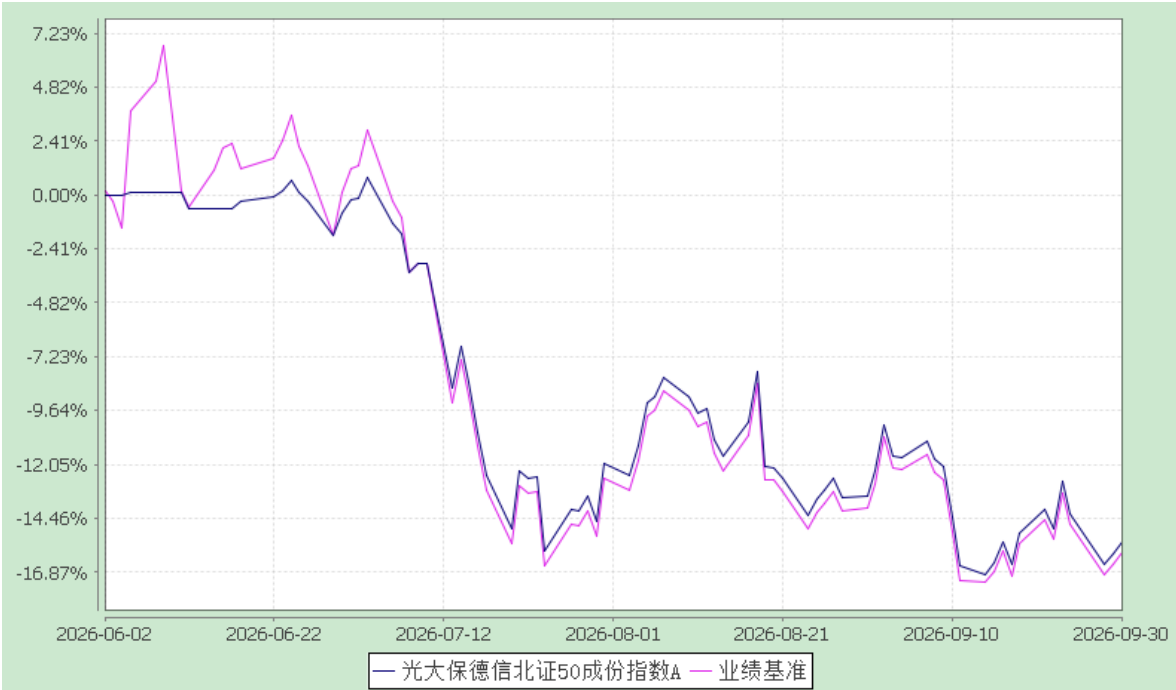
2、光大保德信北证 50 成份指数 C：

| 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          | -14.88%    | 1.78%         | -16.08%        | 1.88%                 | 1.20% | -0.10% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -15.65%    | 1.58%         | -15.97%        | 1.90%                 | 0.32% | -0.32% |

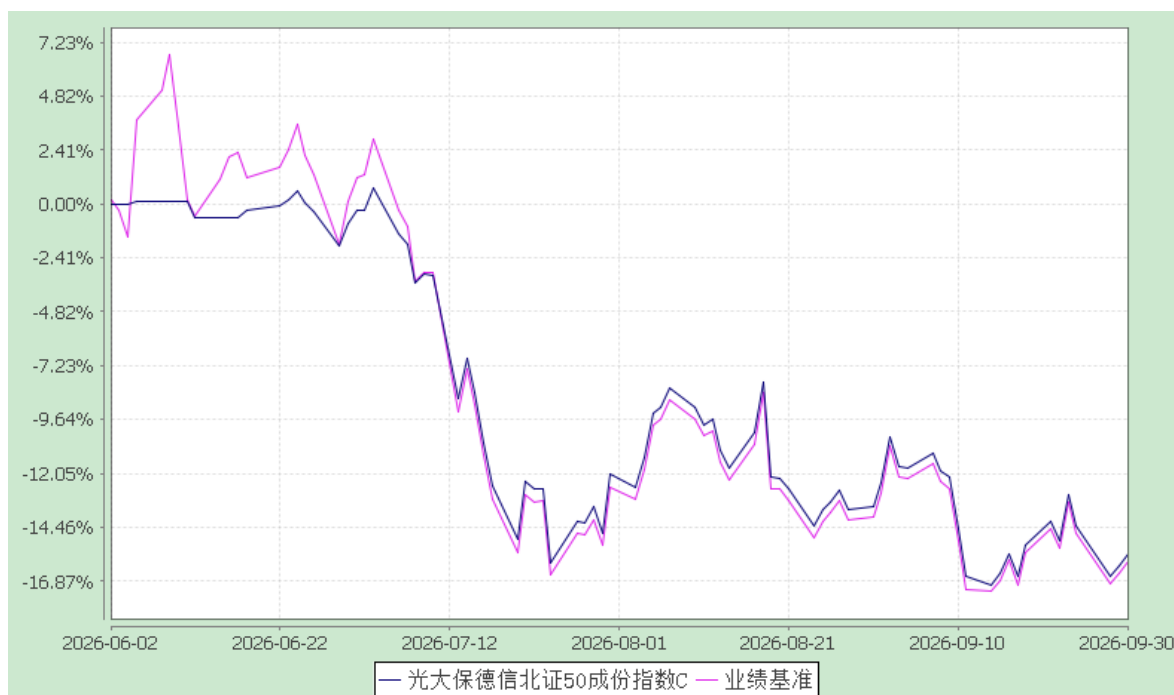
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

光大保德信北证 50 成份指数型证券投资基金  
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  
(2026 年 6 月 2 日至 2026 年 9 月 30 日)

1. 光大保德信北证 50 成份指数 A：



2. 光大保德信北证 50 成份指数 C：



注：根据基金合同的规定，本基金建仓期为 2026 年 6 月 2 日至 2026 年 12 月 1 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 |        |                                                                                                                                                                                                                           |
| 姚石 | 基金经理 | 2026-06-02  | -    | 12 年   | 姚石先生，北京大学硕士。2014 年 7 月至 2015 年 8 月在中国金融期货交易所股份有限公司任职助理经理；2015 年 8 月至 2021 年 8 月在海通证券股份有限公司任职高级分析师；2021 年 9 月至 2025 年 4 月在华泰证券（上海）资产管理有限公司任职研究员、基金经理；2025 年 4 月加入光大保德信基金管理有限公司，2025 年 11 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、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,2026 年 6 月至今担任光大保德信北证 50 成份指数型证券投资基金的基金经理,2026 年 7 月至今担任光大保德信中证科创创业人工智能指数型证券投资基金的基金经理,2026 年 9 月至今担任光大保德信国证粮食产业指数型证券投资基金的基金经理,2026 年 10 月至今担任光大保德信国证机器人产业指数型发起式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。

#### 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，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 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪北证 50 成份指数，该指数由北京证券交易所规模大、流动性好的最具市场代表性的 50 只上市公司证券组成，以综合反映市场整体表现。报告期内本基金主要采取完全复制法，即原则上完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

2026 年三季度，国际油价再度攀升，美联储加息预期升温，市场风格剧烈切换，投资者风险偏好回落，市场流动性显著收缩。北交所市场对流动性环境变化敏感度较高，北证 50 指数在此冲击下出现深度回调，下跌 16.91%，跌幅大于中证 2000 指数，小于中证 1000 指数与创业板指。

运作层面上，本基金在报告期内完成建仓，各项操作和指标均符合基金合同的要求。报告期内，本基金跟踪误差的来源主要是基金申购赎回的影响和指数成份股调整的影响，其中受成份股调整的影响最大。本基金为指数型基金，基金管理人将继续按照基金合同的要求，坚持指数化投资策略，积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的影响，努力将基金的偏离度和跟踪误差控制在较低水平。

#### 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-14.81%，业绩比较基准收益率为-16.08%，C 份额净值增长率为-14.88%，业绩比较基准收益率为-16.08%。

#### 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              | 242,319,783.02 | 94.46        |
|    | 其中：股票             | 242,319,783.02 | 94.46        |
| 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      | 14,168,532.03  | 5.52         |
| 7  | 其他资产              | 44,544.02      | 0.02         |
| 8  | 合计                | 256,532,859.07 | 100.00       |

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 积极投资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积极投资股票。

#### 5.2.2 指数投资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      | 4,416,185.42   | 1.72         |
| C  | 制造业      | 212,850,557.94 | 83.05        |

|   |                  |                |       |
|---|------------------|----------------|-------|
| 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      | 3,635,779.76   | 1.42  |
| H | 住宿和餐饮业           | —              | —     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 21,417,259.90  | 8.36  |
| 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       | —              | —     |
| 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          | —              | —     |
| R | 文化、体育和娱乐业        | —              | —     |
| S | 综合               | —              | —     |
|   | 合计               | 242,319,783.02 | 94.55 |

### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资的股票。

### 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 期末指数投资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  | 920045 | 衡东光  | 45,784.00  | 23,487,192.00 | 9.16         |
| 2  | 920438 | 戈碧迦  | 164,909.00 | 18,205,953.60 | 7.10         |
| 3  | 920185 | 贝特瑞  | 645,510.00 | 13,329,781.50 | 5.20         |

|    |        |      |                |               |      |
|----|--------|------|----------------|---------------|------|
| 4  | 920982 | 锦波生物 | 87,016.0<br>0  | 12,345,830.08 | 4.82 |
| 5  | 920599 | 同力股份 | 524,615.<br>00 | 9,117,808.70  | 3.56 |
| 6  | 920493 | 并行科技 | 68,679.0<br>0  | 7,332,856.83  | 2.86 |
| 7  | 920077 | 吉林碳谷 | 555,509.<br>00 | 7,321,608.62  | 2.86 |
| 8  | 920808 | 曙光数创 | 113,416.<br>00 | 6,456,772.88  | 2.52 |
| 9  | 920809 | 安达科技 | 906,053.<br>00 | 6,324,249.94  | 2.47 |
| 10 | 920368 | 连城数控 | 266,325.<br>00 | 6,040,251.00  | 2.36 |

### 5.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

### 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名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

本基金在进行股指期货投资时,将按照风险管理的原则,以套期保值为目的,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,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。

## 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

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 并行科技(920493 BJ)的发行主体北京并行科技股份有限公司于 2026 年 5 月 15 日收到北京证券交易所出具通报批评的纪律处分([2026]7 号)。

基金管理人按照内部研究工作规范对以上证券进行分析后将其列入基金投资对象备选库并跟踪研究。以上处罚事件发生后,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,本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的,在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、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约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   | —         |
| 2  | 应收证券清算款 | —         |
| 3  | 应收股利    | —         |
| 4  | 应收利息    | —         |
| 5  | 应收申购款   | 44,544.02 |
| 6  | 其他应收款   | —         |
| 7  | 其他      | —         |
| 8  | 合计      | 44,544.02 |

#### 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 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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

| 项目             | 光大保德信北证50成份<br>指数A | 光大保德信北证50成份<br>指数C |
|----------------|--------------------|--------------------|
| 报告期期初基金份额总额    | 72,005,525.00      | 249,949,058.14     |
| 报告期期间基金总申购份额   | 4,434,670.73       | 8,365,020.94       |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 15,629,757.57      | 15,396,105.18      |
| 报告期期间基金拆分变动份额  | -                  | -                  |
| 报告期期末基金份额总额    | 60,810,438.16      | 242,917,973.90     |

## § 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

本报告期内和上季度报告期内，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、中国证监会批准光大保德信北证 50 成份指数型证券投资基金设立的文件
- 2、光大保德信北证 50 成份指数型证券投资基金基金合同
- 3、光大保德信北证 50 成份指数型证券投资基金招募说明书
- 4、光大保德信北证 50 成份指数型证券投资基金托管协议
- 5、光大保德信北证 50 成份指数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北证 50 成份指数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

二〇二六年十月二十七日