

光大保德信红利量化选股混合型证券投资基金

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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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	光大保德信红利量化混合
基金主代码	023106
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025 年 3 月 25 日
报告期末基金份额总额	71,717,145.89 份
投资目标	本基金主要投资于红利主题相关的上市公司，在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，本基金通过运用量化投资策略，进行积极的组合优化，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。
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，综合考虑宏观经济状况、国家财政政策、货币政策、市场流动性等方面的因素，结合定性定量分析、风险测算及组合优化，最终形成大类资产配置决策。

	<p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 主题界定</p> <p>本基金重点投资于分红较为稳定、股息率较高的上市公司，本基金所界定的红利主题相关公司是指同时满足以下第 1) 项和第 2) 项条件的上市公司，或满足第 3) 项条件的上市公司：</p> <p>1) 在过去两年中，至少有一年实施现金分红；</p> <p>2) 现金分红率（现金分红/净利润）或股息率（现金分红/市值）处于市场前 50%；</p> <p>3) 中证红利指数成份股和备选成份股。</p> <p>当国家政策、法律法规或相关准则发生变化，或基金管理人认为有更适当的红利主题界定标准，基金管理人在履行适当程序后，可以对界定方法进行动态调整。</p> <p>(2) 量化选股策略</p> <p>1) 个股优选</p> <p>本基金根据国内资本市场的实际运行情况和大量历史数据的实证检验，结合本基金管理人量化团队多年的研究与投资经验，充分挖掘并精选各种有效因子，构建多因子选股模型，包括成长、盈利、估值、传统量价、分析师预期等多种因子。本基金将使用多因子选股模型对股票进行评分，分析个股在各个因子的得分情况，优选出具有相对价值的个股构建投资组合。</p> <p>2) 股票投资组合的优化和风险控制</p> <p>基金管理人将利用投资组合优化工具，最大化组合的预期收益，以此来确定个股的投资权重。基金管理人将根据市场变化趋势以及后续深入持续的研究，选择适合当前市场环境的投资策略，定期或不定期地对数量化模型进行复核与检验，并对模型涉及的因子与策略进行修正与调整，不断改善模型的有效性与稳定性，力争使得本基金能够有效</p>
--	--

	<p>达成投资目标。</p> <p>（3）港股通标的股票投资策略</p> <p>本基金还将关注互联互通机制下港股市场投资机会，包括：</p> <p>1）香港股票市场制度与大陆股票市场存在的差异对股票投资价值的影响，比如行业分布、交易制度、市场流动性、投资者结构、市场波动性、涨跌停限制、估值与盈利回报等方面；</p> <p>2）人民币与港币之间的汇兑比率变化情况。</p> <p>本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。</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，通过定性分析和定量分析相结合的方式，对存托凭证的发行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>3、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</p>
--	--

	<p>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，以获取较高的投资收益。</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>为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货、股票期权、国债期货等金融衍生品。本基金利用金融衍生品合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，提高投资组合的运作效率。</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>本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，参与股票期权的投资。本基金将在有效控制风险的前提下，选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资。本基金将基于对证券市场的预判，并结合股票期权定价模型，选择估值合理的期权合约。基金管理人将根据审慎原则，</p>
--	--

	<p>建立股票期权交易决策部门或小组，按照有关要求做好人员培训工作，确保投资、风控等核心岗位人员具备股票期权业务知识和相应的专业能力，同时授权特定的管理人员负责股票期权的投资审批事项，以防范期权投资的风险。</p> <p>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。本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约，其次考虑国债期货各合约流动性情况最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理和套期保值的目标。</p> <p>6、可转换公司债券和可交换债券投资策略</p> <p>可转换债券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>7、其他品种投资策略</p> <p>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进行投资。</p>
业绩比较基准	中证红利指数收益率*90%+中证港股通高股息投资指数

	(人民币) 收益率*5%+中债-国债总全价(1-3 年) 指数收益率*5%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益和预期风险高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。 本基金若投资港股通标的股票，除了需要承担与内地股票投资类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	光大保德信红利量化混合 A	光大保德信红利量化混合 C
下属分级基金的交易代码	023106	023107
报告期末下属分级基金的份额总额	60,856,173.19 份	10,860,972.70 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	
	(2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日)	
	光大保德信红利量化混合 A	光大保德信红利量化混合 C
1.本期已实现收益	-379,620.22	-83,528.69
2.本期利润	8,965,873.74	1,567,279.00
3.加权平均基金份额本期利润	0.1317	0.1240
4.期末基金资产净值	70,011,161.27	12,289,794.26
5.期末基金份额净值	1.1504	1.1316

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）

扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、光大保德信红利量化混合 A：

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	11.29%	0.93%	8.46%	0.92%	2.83%	0.01%
过去六个月	-0.80%	0.94%	-3.61%	0.89%	2.81%	0.05%
过去一年	7.62%	0.86%	0.67%	0.82%	6.95%	0.04%
自基金合同 生效起至今	15.04%	0.74%	0.85%	0.80%	14.19%	-0.06%

2、光大保德信红利量化混合 C：

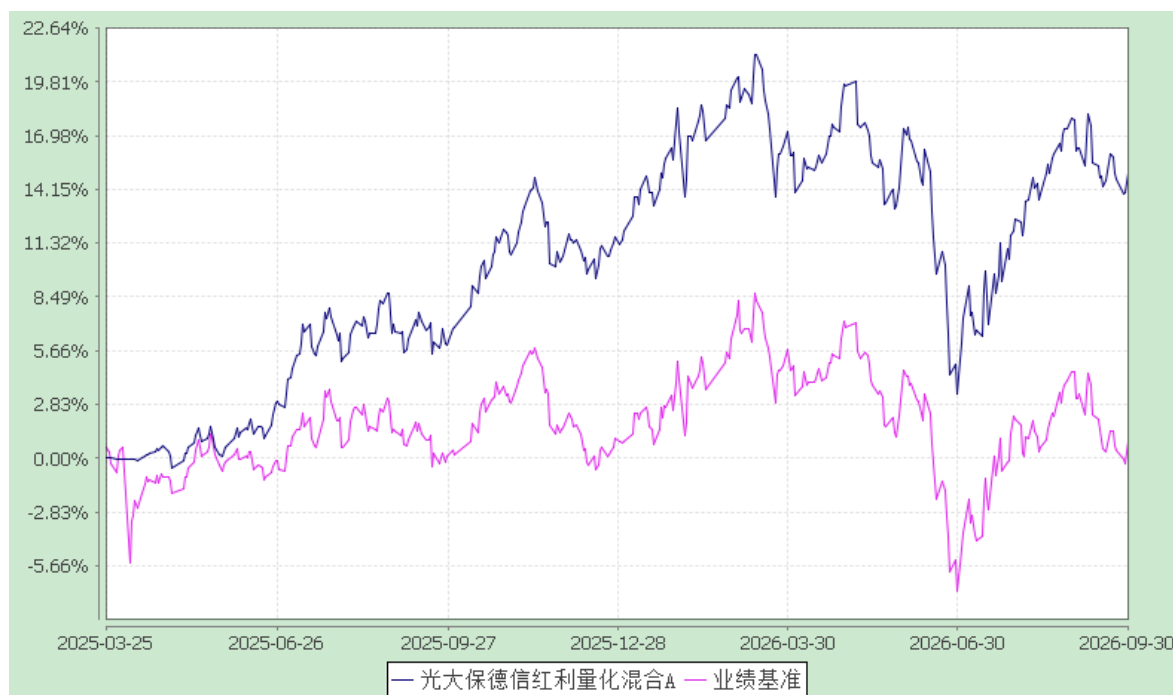
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	11.02%	0.93%	8.46%	0.92%	2.56%	0.01%
过去六个月	-1.23%	0.94%	-3.61%	0.89%	2.38%	0.05%
过去一年	6.68%	0.86%	0.67%	0.82%	6.01%	0.04%
自基金合同 生效起至今	13.16%	0.75%	0.85%	0.80%	12.31%	-0.05%

注：自2026年9月21日起，本基金的业绩比较基准由“中证红利指数收益率×90%+银行活期存款利率（税后）×10%”调整为“中证红利指数收益率*90%+中证港股通高股息投资指数（人民币）收益率*5%+中债-国债总全价（1-3年）指数收益率*5%”。

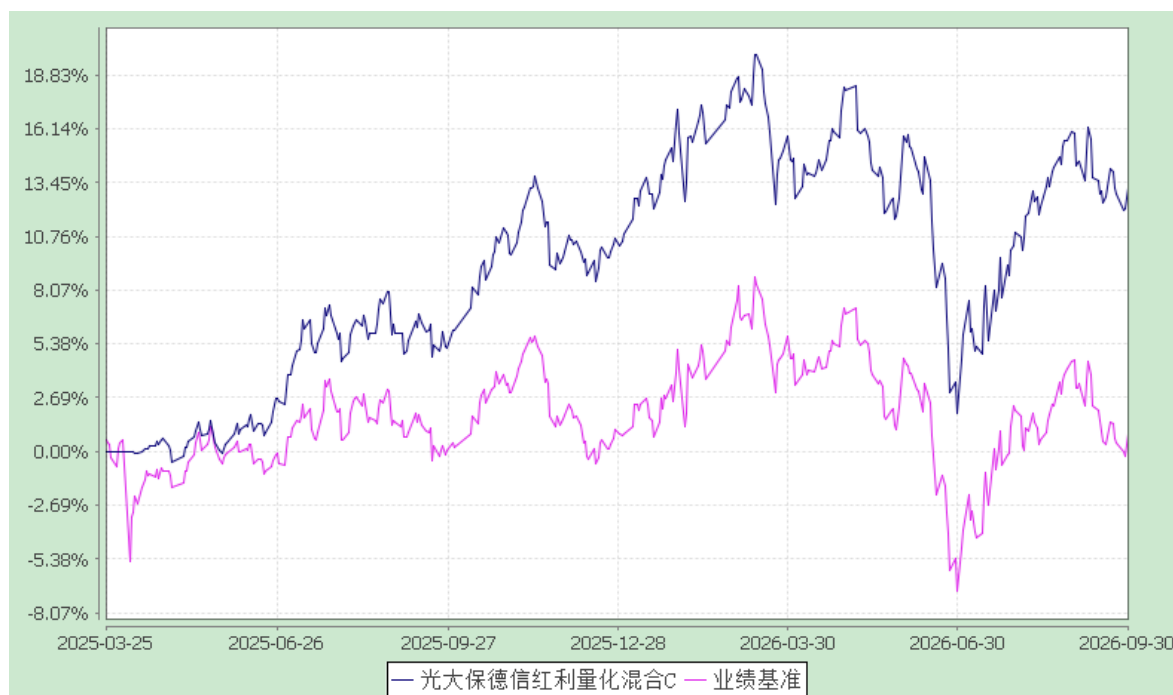
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

光大保德信红利量化选股混合型证券投资基金
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
(2025 年 3 月 25 日至 2026 年 9 月 30 日)

1. 光大保德信红利量化混合 A：



2. 光大保德信红利量化混合 C:



注：自 2026 年 9 月 21 日起，本基金的业绩比较基准由“中证红利指数收益率×90%+银行活期存款利率（税后）×10%”调整为“中证红利指数收益率×90%+中证港股通高股息投资指数（人民币）收益率×5%+中债-国债总全价（1-3 年）指数收益率×5%”。

§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		
朱剑涛	权益管理总部量化投资团队副团队长（主持工作）、基金经理	2025-03-25	-	18 年	朱剑涛先生，2008 年毕业于复旦大学，获得理学硕士。2008 年 7 月至 2010 年 8 月在华宝信托有限责任公司任职量化研究助理；2010 年 9 月至 2015 年 3 月在海通证券股份有限公司任职金融工程高级分析师；2015 年 4 月至 2022 年 5 月在东方证券股份有限公司任职金融工程首席分析师；2022 年 6 月至 2023 年 8 月在海南进化论私募基金管理有限公司任职量化研究负责人；2023 年 8 月加入光大保德信基金管理有限公司，现任权益管理总部量化投资团队副团队长（主持工作），2024 年 5 月至今担任光大保德信量化核心证券投资基金的基金经理，2024 年 5 月至 2026 年 4 月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，2024 年 10 月至今担任光大保德信风格轮动混合型证券投资基金、光大保德信诚鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理，2024 年 10 月至 2026 年 4 月担任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，2025 年 3 月至今担任光大保德信红利量化选股混合型证券投资基金的基金经理，2025 年 5 月至今担任光大保德信沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理，2026 年 1 月至今担任光大保德信双鑫收益债券型证券投资基金的基金经理，2026 年 4 月至今担任

					光大保德信健康优加混合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。
--	--	--	--	--	--

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

本基金采用机器学习量化模型，按产品合同与风格库要求，剔除市值小和流动性差的股票，在限定的具备红利特征的股票池内，选取预期收益高的股票，同时控制好策略组合与基准中证红利指数的风险偏离，构建组合。机器学习模型的输入数据，除了常用的选股指标，例如：估值、

成长、量价等，还会借助机器算力，让模型从不同类型输入数据中去学习挖掘低相关性的选股因子，并根据市场风格变化自学习合适的因子配比权重。

2026 年三季度 A 股市场风格发生剧烈反转，7 月份科技股大幅回调，创业板综指，科创板综指的单月跌幅分别达到 21.23%，27.79%，前期被压制的红利和小微盘板块领涨，中证红利指数涨 10.89%，wind 微盘股指数涨 1.46%。八月上半月科技成长有所反弹，但很快又进入下行通道，“红利+小盘”的哑铃风格继续相对强势，全市场日成交额回落到两万亿以下，市场波动率明显下降。从行业上看，三季度，煤炭、石油石化、农林牧渔，银行，医药板块领涨，电子，通信，建筑材料，电力设备，机械设备行业大幅下跌。三季度市场的 beta 收益较弱，但风格反转趋于均衡、低波动、小市值走强的市场环境，有利于量化模型的发挥。

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 11.29%，业绩比较基准收益率为 8.46%，C 份额净值增长率为 11.02%，业绩比较基准收益率为 8.46%。

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	75,912,949.47	91.87
	其中：股票	75,912,949.47	91.87
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	4,559,085.04	5.52
7	其他资产	2,160,198.26	2.61
8	合计	82,632,232.77	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	4,206.80	0.01
B	采矿业	18,655,052.00	22.67
C	制造业	18,396,254.00	22.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,788,562.77	3.39
F	批发和零售业	780,423.00	0.95
G	交通运输、仓储和邮政业	7,807,398.32	9.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,951.43	0.02
J	金融业	18,625,791.00	22.63
K	房地产业	1,415,862.00	1.72
L	租赁和商务服务业	1,656,093.00	2.01
M	科学研究和技术服务业	760,639.40	0.92
N	水利、环境和公共设施管理业	2,167,363.75	2.63
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	2,840,352.00	3.45

S	综合	-	-
	合计	75,912,949.47	92.24

5.2.2 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 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	601919	中远海控	195,100.00	3,193,787.00	3.88
2	600256	广汇能源	378,200.00	2,522,594.00	3.07
3	603565	中谷物流	201,248.00	2,332,464.32	2.83
4	601225	陕西煤业	77,700.00	2,022,531.00	2.46
5	601666	平煤股份	220,400.00	1,943,928.00	2.36
6	600919	江苏银行	141,400.00	1,750,532.00	2.13
7	600348	华阳股份	195,800.00	1,738,704.00	2.11
8	000983	山西焦煤	266,600.00	1,727,568.00	2.10
9	601838	成都银行	87,100.00	1,681,901.00	2.04
10	600153	建发股份	187,100.00	1,650,222.00	2.01

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

若本基金投资股指期货，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货、股票期权、国债期货等金融衍生品。本基金利用金融衍生品合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，提高投资组合的运作效率。

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

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。本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约，其次考虑国债期货各合约流动性情况最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理和套期保值的目标。

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 江苏银行(600919 SH)的发行主体江苏银行股份有限公司于 2026 年 9 月 8 日收到中国人民银行的行政处罚（银罚决字(2026)97 号）。

成都银行(601838 SH)的发行主体成都银行股份有限公司于 2025 年 12 月 5 日收到国家金融监督管理总局四川监管局的行政处罚。

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。除上述证券发行主体外，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	2,160,198.26
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,160,198.26

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

项目	光大保德信红利量化混 合A	光大保德信红利量化混 合C
本报告期期初基金份额总额	77,931,411.77	14,622,574.50
报告期期间基金总申购份额	11,767,643.38	959,230.50
减：报告期期间基金总赎回份额	28,842,881.96	4,720,832.30

报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	60,856,173.19	10,860,972.70

§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

项目	光大保德信红利量化混合 A	光大保德信红利量化混合C
报告期期初管理人持有的本基金份额	0.00	-
报告期期间买入/申购总份额	3,450,739.32	-
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	3,450,739.32	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	5.67	-

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	基金转换入	2026-09-30	1,737,320.60	1,980,198.02	0.00%
2	基金转换入	2026-09-14	1,713,418.72	1,980,198.02	0.00%
合计			3,450,739.32	3,960,396.04	

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 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

1、根据 2026 年 8 月 22 日《光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告》，2026 年 9 月 21 日起基金管理人将光大保德信红利量化选股混合型证券投资基金的业绩比较基准由中证红利指数收益率*90%+银行活期存款利率(税后)*10%

调整为中证红利指数收益率*90%+中证港股通高股息投资指数（人民币）收益率*5%+中债-国债总全价（1-3 年）指数收益率*5%，并对基金合同等法律文件有关条款进行修订。详情请见公告。

99 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、光大保德信红利量化选股混合型证券投资基金设立的文件
- 2、光大保德信红利量化选股混合型证券投资基金基金合同
- 3、光大保德信红利量化选股混合型证券投资基金招募说明书
- 4、光大保德信红利量化选股混合型证券投资基金托管协议
- 5、光大保德信红利量化选股混合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红利量化选股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

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

二〇二六年十月二十七日