

光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置 混合型集合资产管理计划 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：上海光大证券资产管理有限公司

基金托管人：广发银行股份有限公司

送出日期：2021 年 03 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

集合计划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。

集合计划托管人广发银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2021 年 3 月 2 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。

本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益。投资需谨慎，敬请投资者注意投资风险。投资者欲了解本集合计划的详细情况，请于投资集合计划前认真阅读集合计划的产品合同、更新的招募说明书等法律文件以及相关业务公告。敬请投资者关注适当性管理相关规定，提前做好风险测评，并根据自身的风险承受能力购买风险等级相匹配的产品。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本集合计划出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2020 年 3 月 25 日起至 2020 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	13
3.4 过去三年基金的利润分配情况	13
§ 4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	18
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	18
§ 5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	18
§ 6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§ 7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	24

§ 8 投资组合报告	52
8.1 期末基金资产组合情况	52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
8.6 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	65
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	66
8.8 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贵金属投资明细	66
8.9 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	66
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	66
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
8.12 投资组合报告附注	67
§ 9 基金份额持有人信息	68
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	70
§ 10 开放式基金份额变动	70
§ 11 重大事件揭示	71
11.1 基金份额持有人大会决议	71
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	71
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
11.4 基金投资策略的改变	71
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	71
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
11.8 其他重大事件	72
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	73
12.1 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	73
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	73
§ 13 备查文件目录	73
13.1 备查文件目录	73
13.2 存放地点	74
13.3 查阅方式	74

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划		
基金简称	光大阳光对冲 6 个月持有混合		
基金主代码	860010		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2020 年 3 月 25 日		
基金管理人	上海光大证券资产管理有限公司		
基金托管人	广发银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	1,912,644,697.73 份		
基金合同存续期	3 年		
下属分级基金的基金简称	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C
下属分级基金的交易代码	860010	860028	860029
报告期末下属分级基金的份额总额	9,395,579.84 份	77,046,282.80 份	1,826,202,835.09 份

注：本报告中所述的“基金”包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

2.2 基金产品说明

投资目标	通过深入研究，捕捉宏观环境及政策趋势走向，灵活精选投资策略，在合理控制投资风险和保障集合计划资产流动性的基础上，追求集合计划资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本集合计划主要采用对冲套利的投资策略。通过数量化投资模型，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，并使用股指期货进行对冲操作，有效规避市场涨跌的系统性风险，获取选股的超额收益。力争实现集合计划资产长期稳健的绝对收益。另通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、信用风险、证券市场估值水平等因素，综合配置固定收益等各类资产，以实现整体资产的稳健增值。</p> <p>（一）股票投资策略</p> <p>本集合计划主要通过数量化投资模型，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。数量化投资模型的投资逻辑基于学术研究、投资实践中被普遍接受的选股因子构建对于个股的收益进行预测，因子包括价值、质量、成长、事件驱动、市场等大类。通过现代组合管理的数量化模型进行组合构建，优化系统风险及个股特定风险的最优配比。</p> <p>对于因子的选取，我们的方法论是自上而下的投资逻辑，首先保证其在经济学、金融学、行为金融学上的意义，判断其符合当前的经济和市场环境，然后再重点关注因子的稳定性、解释性、统计显著性。力求甄选出基本面绩优、在行业内有竞争优势、当前具有估值机会、具备核心成长潜力等方面的优秀上市公司。</p>

	<p>(二) 金融衍生工具对冲策略</p> <p>本集合计划在通过以上股票投资策略的基础上, 使用股指期货对冲组合的系统性风险, 从而分离出组合的超额收益。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, 参与股指期货对冲。综合考虑股指期货不同合约之间的价差关系、套利机会、流动性等因素, 在各股指期货合约之间进行动态配置和临近到期合约的展期操作, 以提升组合收益和套期保值的效果。</p> <p>随着其他金融衍生工具的发展, 本集合计划会考虑使用法律法规允许范围内的其他对冲工具, 例如融券卖空、期权等。通过优选对冲工具, 提高管理市场风险的能力。</p> <p>(三) 融券投资策略</p> <p>本集合计划在投资机会和融券成本合适的情况下, 采用融券的方式进行配对交易。通过多因子模型, 可以找到行业、风格相近的股票之间存在的理论价差, 通过买入低价股、融券卖空高价股获得绝对收益。</p> <p>(四) 其他绝对收益投资策略</p> <p>包括: (1) 普通债券投资策略; (2) 可转债投资策略; (3) 衍生品投资策略; (4) 一级市场申购策略; (5) 现金类资产投资策略。</p> <p>(五) 资产支持证券投资策略</p> <p>本集合计划将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析, 并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型, 评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。</p>
业绩比较基准	本集合计划的业绩比较基准为: 中国人民银行公布的同期 1 年期银行定期存款基准利率 (税后) +1%。
风险收益特征	本集合计划为混合型集合计划, 其预期风险和预期收益高于债券型基金、债券型集合计划、货币市场基金和货币型集合资产管理计划, 低于股票型基金和股票型集合计划。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海光大证券资产管理有限公司	广发银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	朱轶	李今
	联系电话	021-32068300	010-65169498
	电子邮箱	zhuyi1@ebscn.com	lijin@cgbchina.com.cn
客户服务电话	95525	4008308003	
传真	021-32068585	010-65169555	
注册地址	中国 (上海) 自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层	广东省广州市越秀区东风东路 713 号	
办公地址	中国 (上海) 自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层	北京市西城区菜市口大街 1 号院 2 号楼信托大厦	
邮政编码	200127	100053	
法定代表人	熊国兵	尹兆君	

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ebscn-am.com
基金年度报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
注册登记机构	上海光大证券资产管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年 3 月 25 日（基金合同生效日）-2020 年 12 月 31 日		
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C
本期已实现收益	1,383,727.22	17,419,595.83	-33,747,924.99
本期利润	1,298,107.23	14,470,937.08	-8,107,947.64
加权平均基金份额本期利润	0.0517	0.0699	-0.0118
本期加权平均净值利润率	4.91%	6.73%	-1.12%
本期基金份额净值增长率	5.26%	5.69%	5.40%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末		
期末可供分配利润	713,477.98	4,380,840.47	98,592,478.69
期末可供分配基金份额利润	0.0759	0.0569	0.0540
期末基金	10,109,057.82	81,427,123.27	1,924,795,313.78

资产净值			
期末基金份额净值	1.0759	1.0569	1.0540
3.1.3 累计期末指标	2020 年末		
基金份额累计净值增长率	5.26%	5.69%	5.40%

注：1、表中的“期末”均指报告期最后一日，即 12 月 31 日，“本期”指 2020 年 3 月 25 日-2020 年 12 月 31 日。

2、上述集合计划业绩指标不包括持有人认购或交易集合计划的各项费用（例如，集合计划的申购赎回费、集合计划转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、本期已实现收益指集合计划本期利息收入、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。

4、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

5、B 类份额设立日为 2020 年 3 月 25 日，C 类份额设立日为 2020 年 3 月 25 日。

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

光大阳光对冲 6 个月持有混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-0.96%	0.19%	0.63%	0.01%	-1.59%	0.18%
过去六个月	3.03%	0.31%	1.27%	0.01%	1.76%	0.30%

自基金合同生效起至今	5.26%	0.27%	1.95%	0.01%	3.31%	0.26%
------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

光大阳光对冲 6 个月持有混合 B

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-0.83%	0.19%	0.63%	0.01%	-1.46%	0.18%
过去六个月	3.29%	0.31%	1.26%	0.01%	2.03%	0.30%
自基金合同生效起至今	5.69%	0.27%	1.94%	0.01%	3.75%	0.26%

光大阳光对冲 6 个月持有混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-0.92%	0.19%	0.63%	0.01%	-1.55%	0.18%

过去六个月	3.10%	0.31%	1.26%	0.01%	1.84%	0.30%
自基金合同生效起至今	5.40%	0.27%	1.94%	0.01%	3.46%	0.26%

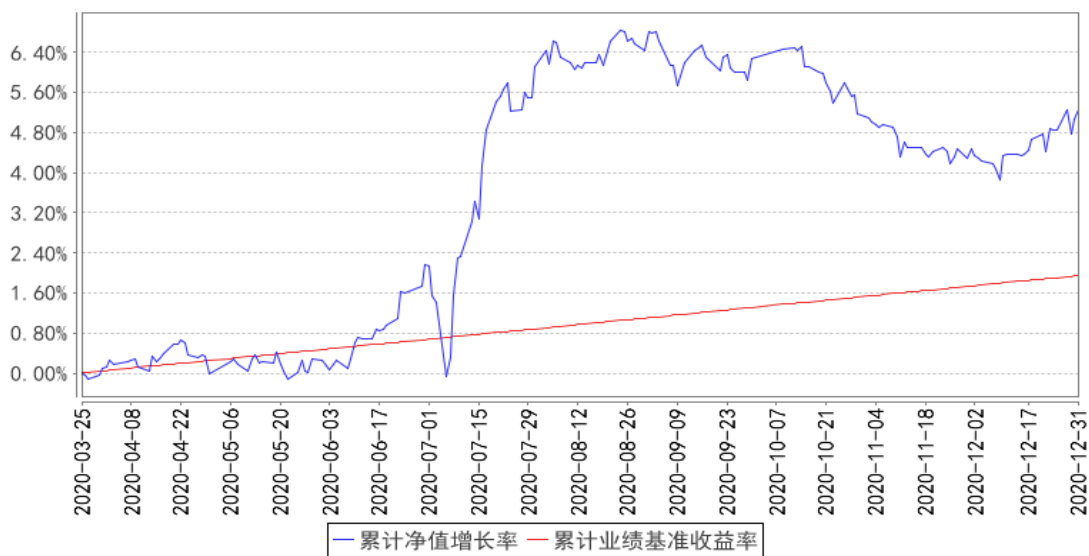
注：(1)自基金合同生效日起至今指2020年3月25日-2020年12月31日；

(2)业绩比较基准为：中国人民银行公布的同期1年期银行定期存款基准利率（税后）+1%

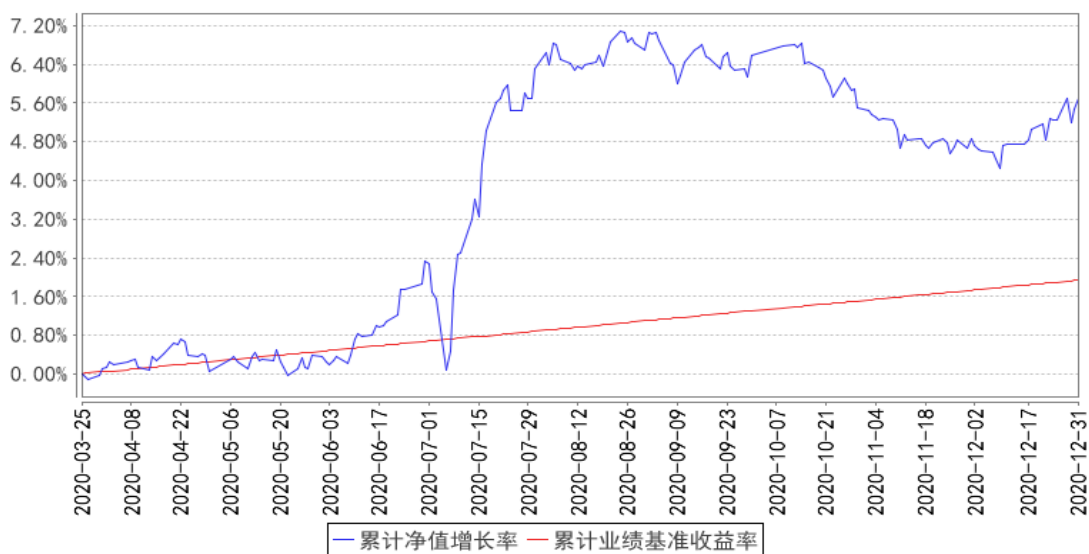
(3)B类份额设立日为2020年3月25日,C类份额设立日为2020年3月25日。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

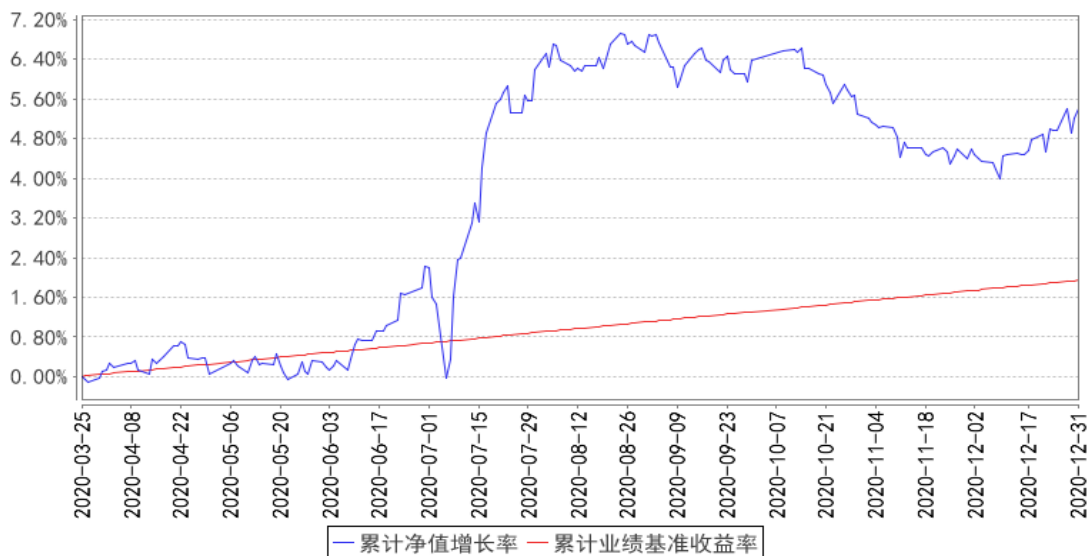
光大阳光对冲6个月持有混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



光大阳光对冲6个月持有混合**B**累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

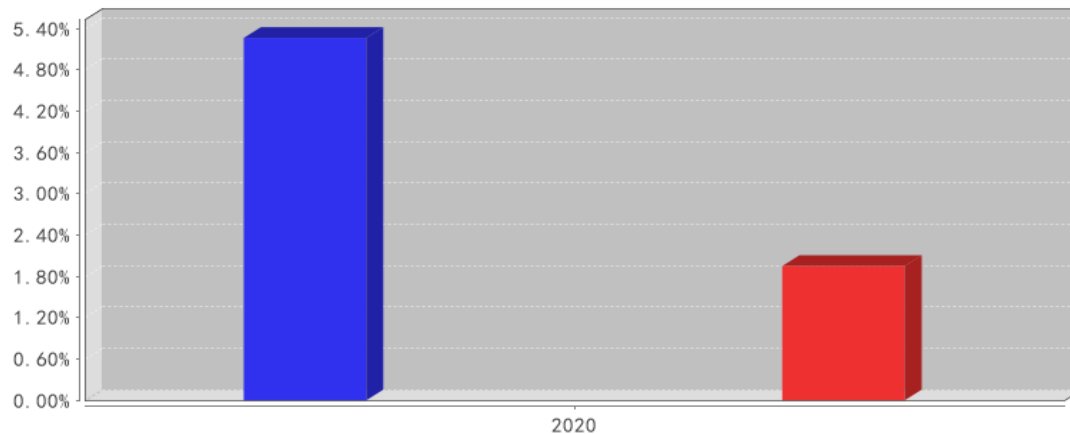


光大阳光对冲6个月持有混合**C**累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



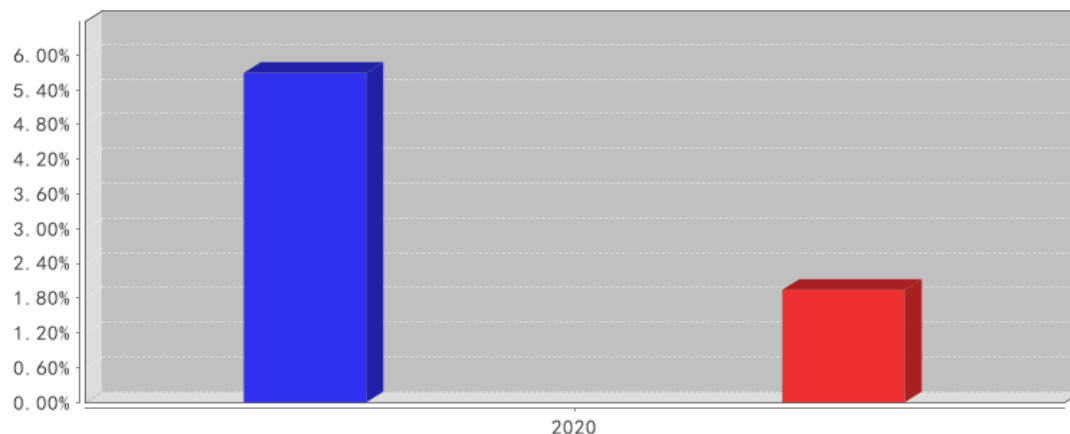
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

光大阳光对冲6个月持有混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



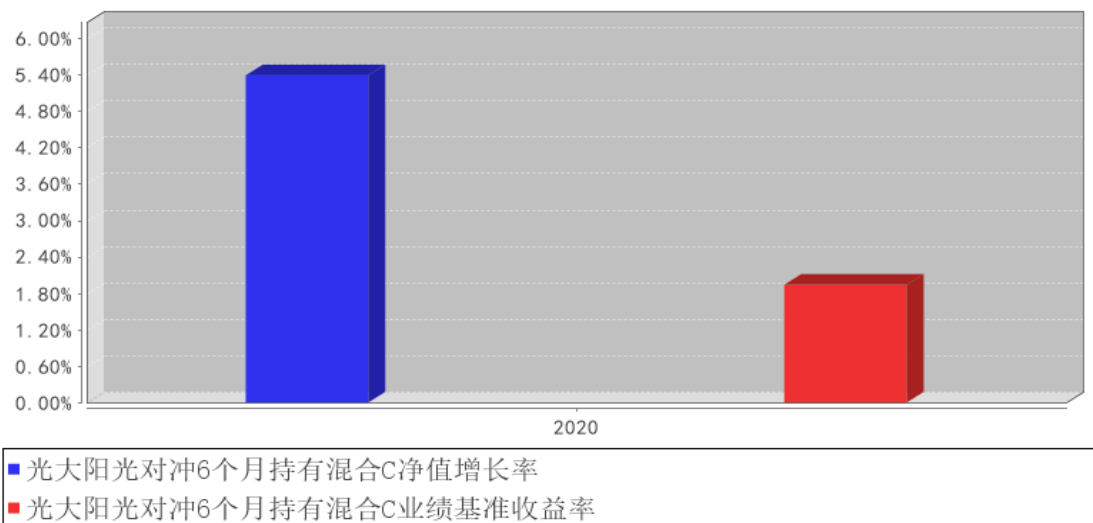
- 光大阳光对冲6个月持有混合A净值增长率
- 光大阳光对冲6个月持有混合A业绩基准收益率

光大阳光对冲6个月持有混合B基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



- 光大阳光对冲6个月持有混合B净值增长率
- 光大阳光对冲6个月持有混合B业绩基准收益率

光大阳光对冲6个月持有混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本集合计划过去三年未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上海光大证券资产管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）成立于2012年5月9日，前身为原光大证券股份有限公司资产管理总部，继承了光大证券的客户资产管理业务与资格。2002年5月14日，中国证券监督管理委员会核发证监机构字[2002]127号《关于核准光大证券有限责任公司受托投资管理业务资格的批复》，同意光大证券从事客户资产管理业务。2011年11月23日，中国证券监督管理委员会核发证监许可[2011]1886号《关于核准光大证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》，同意光大证券设立资产管理子公司并核准公司章程。2012年2月21日，公司在上海市工商行政管理局登记注册，注册资本2亿元，光大证券持股100%。

截至2020年12月末，本公司共管理9只参照开放式证券投资基金管理的集合计划，公司在投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从业年限	说明

		任职日期	离任日期		
李聚华	总经理助理兼量化公募投资部总经理	2020年03月25日	-	16	李聚华先生 美国哥伦比亚大学统计学硕士，CFA。曾任美国对冲基金 Aristeia Capital 高级分析师，光大证券金融市场总部执行董事。现任光证资管总经理助理兼量化公募投资部总经理。
李禄俊	量化公募投资部投资经理	2020年03月25日	-	5	李禄俊先生 本硕均毕业于北京大学，曾在中金基金管理公司量化投资部任职，2018年加入光证资管，现任量化公募投资部投资经理。

注：1、集合计划的首任投资经理，其“任职日期”为集合计划合同生效日，其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任投资经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本集合计划管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及集合计划合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作集合计划资产，在严格控制风险的基础上，为集合计划份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本集合计划运作合规，不存在违反集合计划合同和损害集合计划份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《上海光大证券资产管理有限公司公平交易与利益冲突防范管理办法》，将公司所已经管理、未来可能管理的所有公募及私募资产管理产品的投资组合等不同资产组合参与的投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节均纳入公平交易管理，在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动，建立对公平交易的执行、监督及审核流程，严禁在不同投资组合之间进行利益输送。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本集合计划管理人一贯公平的对待旗下管理的所有产品，指定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》与《上海光大证券资产管理有限公司公平交易与利益冲突防范管理办法》。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，本集合计划未发生违法违规且对集合计划财产造成损失的异常交易行为。本报告期内未发生管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年百年难遇的新冠疫情几乎影响到了全世界的每个角落，各国政府为了应对疫情造成的冲击亦采取了前所未有的应对措施。A 股市场在如此大环境下，在上半年走出了一个大致的 W 形态。以沪深 300 为代表的蓝筹指数在 6 个月内大幅震荡，半年内的波动幅度达到近 20%，但涨幅却在零附近。我们的对冲策略产品成立于 3 月底，主要使用量化选股模型构建股票投资组合，并使用股指期货进行对冲以获得绝对收益。受到市场大环境的影响，在操作期内对冲收益的波动较大，因此我们在建仓初期选用了较为稳妥的逐步加仓的方式，以保产品在净值方面不会产生过大的波动。六月建仓完成以后，选股模型获得了明显的超额收益。同期基差贴水加深，基差波动对净值的正贡献从一定程度上预支了下半年的投资收益。

下半年市场进入存量博弈阶段，缺乏明显的赚钱效应。由于美国大选未决、海外疫情进一步发酵、新冠疫苗研制成功等事件的接连冲击，市场不断调整对未来的预期，导致期间热点切换迅速。我们的选股模型注重所选股票的中长期持续增长和基本面稳健，在短期市场中处于暂时不利环境，因此出现连续跑输沪深 300 指数的情况，造成了净值的回撤。根据当时的市场环境，我们在选股模型方面进行了迭代升级，并进一步缩小选股与基准指数的跟踪误差以控制风险。但我们也始终在思考：如果短期的市场状态不可预测，我们也不应该过激地改动原有模型，更不能盲目追逐市场热点，在努力控制风险的同时，坚持核心的基本面投资逻辑。我们将重点放在寻找盈利确定性的股票组合上。四季度中后期前期被错杀的基本面优质个股兑现了收益，使得四季度产品净值有了明显的回升。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 12 月 31 日，光大阳光对冲策略 6 个月持有混合 A 类份额净值为 1.0759 元，本报告期份额净值增长率为 5.26%；光大阳光对冲策略 6 个月持有混合 B 类份额净值为 1.0569 元，本报告期份额净值增长率为 5.69%。光大阳光对冲策略 6 个月持有混合 C 类份额净值为 1.0540 元，本报告期份额净值增长率为 5.4%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年，两会提出的 GDP 目标采用“底线式”，为高质量发展留下空间，加大动力；货

币政策的表述延续“灵活”、“合理适度”的总基调。两会传递的信息符合市场预期，2021 年是十四五规划的开局之年，内需消费和新能源产业的发展机会不容低估，资本市场改革红利仍在稳步释放，注册制改革和完善退市机制，整体而言有望加强 A 股的良好循环，有利于 A 股中长期的风险偏好修复，也有利于吸引更多的长线资金入市，对中长期经济基本面会有积极的正反馈。现阶段市场中风险资产面临估值夯实压力，但市场情绪短期内有望企稳，会逐步回归到聚焦长线逻辑的投资主线之中。

综合财政和货币政策判断债券短期偏空，上半年全球经济回温和通胀上行对债券基本面保持压制，下半年配置性拐点可能会出现。权益资产方面，上半年全球经济复苏将持续带动上游资源品的上涨，延续顺周期投资逻辑，但到了二季度应该关注通胀因素对于货币政策的压力，届时信贷环境的收紧会持续对高估值板块形成一定的压力。短期来看低估值、高股息、顺周期、具有确定性的板块和板块中业绩优秀的个股占有优势，长期来看，两会重点强调的“碳中和”有望带来近百万亿清洁能源的市场，大规模的投资将聚焦于光伏、风电、输电设施领域等，因此可再生绿色能源、高端制造、自主可控等符合十四五国家政策方向的投资主线预计将持续有超额收益。

2021 年市场普遍对股市和债市的预期收益较之去年明显降低，因此对冲型产品在今年的宏观环境中明显的优势。虽然短期而言市场风格的快速调整对选股策略造成一定的损失，但当策略重新校准市场的配置均衡位置后，选股策略将有效平衡核心资产和估值优势个股的配比，同时控制市值、行业的整体暴露，力争达到市场风格中性的投资结果，并在此基础上捕捉更多的绝对收益的投资机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，管理人继续完善内部控制、提升风险管理水平，着重开展了以下各项工作：

1、继续完善内部控制体系

公司根据法律法规、监管要求及业务发展需求，不断优化现有的标准化业务流程体系，强调业务流程服务于加强风险防范和提升运营效率，通过信息技术手段持续提升业务操作的系统化程度，并不断优化。

2、持续改进投资监控的方法与手段，保证集合计划投资业务的合法合规性

报告期内，在投资日常合规监控工作方面，公司根据法律法规和产品特点进一步完善了投资监控系统以提升投资监控效率；在实现交易价差分析、银行间交易分析、研究报告检查等专项检查工作定期化、日常化的基础上，公司加强了内幕交易风险的检查和防范，多次开展有关内幕交易的合规培训，进一步强化全体投研人员对内幕交易行为和结果的认识。

3、规范集合计划销售业务，保证集合计划销售业务的合法合规性

报告期内，在集合计划持续营销活动中，公司严格规范销售业务，按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金宣传推介材料管理暂行规定》及相关法规规定审查宣传推介材料，逐步落实反洗钱法律法规各项要求，并督促销售部门做好投资者教育工作，本报告期内没有出现主动违规行为。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

(1) 日常估值流程

集合计划的估值由集合计划会计负责，集合计划会计对公司所管理的集合计划以集合计划为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同产品之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。

集合计划会计核算独立于公司会计核算。集合计划会计核算采用专用的财务核算软件系统进行产品核算及账务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行集合计划估值。集合计划会计核算采用集合计划管理人与托管行双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就集合计划的会计核算、集合计划估值等与托管银行进行核对；每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。集合计划会计除设有专职集合计划会计核算岗外，还设有集合计划会计复核岗位，负责集合计划会计核算的日常事后复核工作，确保集合计划净值核算无误。

配备的集合计划会计具备会计资格和基金从业资格，在集合计划核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验，熟悉及了解集合计划估值法规、政策和方法。

(2) 特殊业务估值流程

根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》的相关规定，本公司成立停牌股票等没有市价的投资品种估值委员会，成员由投资与研究部门、运营保障部、合规监察部、风险与绩效管理部与营销管理部相关人员组成。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与或决定基金日常估值。

基金经理参与估值小组对停牌股票估值的讨论，发表相关意见和建议，与估值小组成员共同商定估值原则和政策。

3、本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4. 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本集合计划报告期内未进行利润分配。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本集合计划未出现连续二十个工作日集合计划份额持有人数量不满二百人或者集合计划资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，广发银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划（以下称“本集合计划”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、集合计划合同和托管协议的有关规定，不存在任何损害集合计划份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、集合计划合同和托管协议的规定，对本集合计划管理人的投资运作方面进行了必要的监督，对集合计划资产净值的计算、集合计划份额申购赎回价格的计算以及集合计划费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本集合计划管理人存在损害份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2021）审字第 61263195_B06 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划全体份额持有人
审计意见	我们审计了光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年 3 月 25 日（集合计划合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益（集合计划净值）

	<p>变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 3 月 25 日（集合计划合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p>

	<p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	王自清 丁诗怡
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12
审计报告日期	2021 年 3 月 31 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	21,871,738.77
结算备付金		81,554,644.23
存出保证金		148,867,591.34
交易性金融资产	7.4.7.2	1,879,269,542.24

其中：股票投资		1,291,906,844.29
基金投资		-
债券投资		373,862,697.95
资产支持证券投资		213,500,000.00
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		5,716,507.62
应收利息	7.4.7.5	7,065,344.14
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		2,144,345,368.34
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		1,556,905.78
应付赎回款		2,628,833.39
应付管理人报酬		1,708,328.30
应付托管费		340,514.48
应付销售服务费		646,069.76
应付交易费用	7.4.7.7	1,293,614.11
应交税费		22,407.65
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	119,817,200.00
负债合计		128,013,873.47
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	1,912,644,697.73
未分配利润	7.4.7.10	103,686,797.14
所有者权益合计		2,016,331,494.87
负债和所有者权益总计		2,144,345,368.34

注：

报告截止日 2020 年 12 月 31 日，本集合计划份额总额为 1,912,644,697.73 份，其中光大阳光对冲 6 个月持有混合 A 集合计划份额总额为 9,395,579.84 份，集合计划份额净值 1.0759 元；光大阳光对冲 6 个月持有混合 B 集合计划份额总额为 77,046,282.8 份，集合计划份额净值 1.0569

元；光大阳光对冲 6 个月持有混合 C 集合计划份额总额为 1,826,202,835.09 份，集合计划份额净值 1.0540 元。

7.2 利润表

会计主体：光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划

本报告期：2020 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 3 月 25 日（基金合同 生效日）至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		31,736,475.48
1. 利息收入		8,609,254.81
其中：存款利息收入	7.4.7.11	554,216.81
债券利息收入		3,490,186.39
资产支持证券利息收入		3,031,823.66
买入返售金融资产收入		1,533,027.95
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		520,527.78
其中：股票投资收益	7.4.7.12	79,246,899.03
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-793,251.40
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-81,188,226.55
股利收益	7.4.7.16	3,255,106.70
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	22,605,698.61
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	994.28
减：二、费用		24,075,378.81
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	7,499,009.48
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,479,299.33
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	2,202,960.32
4. 交易费用	7.4.7.19	11,372,822.46
5. 利息支出		121,156.35
其中：卖出回购金融资产支出		121,156.35
6. 税金及附加		1,251,998.07
7. 其他费用	7.4.7.20	148,132.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,661,096.67

减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,661,096.67

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划

本报告期：2020 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	38,874,579.27	861,058.70	39,735,637.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,661,096.67	7,661,096.67
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,873,770,118.46	95,164,641.77	1,968,934,760.23
其中：1. 基金申购款	2,177,276,617.07	112,612,332.23	2,289,888,949.30
2. 基金赎回款	-303,506,498.61	-17,447,690.46	-320,954,189.07
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,912,644,697.73	103,686,797.14	2,016,331,494.87

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

汪沛

詹朋

杨薇

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划是由光大阳光稳健添利集合资产管理计划转型而来。本集合计划管理人上海光大证券资产管理有限公司于 2020 年 3 月 17 日发布《光大阳光稳健添利集合资产管理计划合同变更公告》。根据公告，光大阳光稳健添利集合资产管理计划名称变更为“光大阳光对冲 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划”，光大阳光稳健添利集合资产管理计划份额转换为光大阳光对冲 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划 A 类份额。合同变更后，本集合计划的托管人，登记机构不变。自 2020 年 3 月 25 日起《光大阳光对冲 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》、《光大阳光对冲 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划托管协议》生效。本集合计划自资产管理合同变更生效之日起存续期不得超过 3 年。本集合计划管理人为上海光大证券资产管理有限公司，托管人为广发银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《光大阳光对冲 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》，本集合计划的投资范围为：具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或同意注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券（含超短期融资券）、公司债、中期票据、可交换债券、可转换债券（含可分离可转换债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、股指期货以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本集合计划可以参与融券业务。如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本集合计划的投资组合比例为：股票资产占集合计划资产的比例为 0%-95%；投资银行存款和同业存单合计占比不超过集合计划资产的 20%；本集合计划权益类多头头寸价值减去权益类空头头寸价值，占集合计划资产净值比例范围 0-10%。其中，权益类多头头寸价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合正风险敞口暴露价值及其他权益类工具多头价值的合计值。权益类空头头寸价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合负风险敞口暴露价值及其他权益类工具空头价值的合计值；每个交易日日终，持有的买入股指期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过集合计划资产净值的 95%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于集合计划资产净值的 5%，现金不包括结算备付

金、存出保证金和应收申购款等。本集合计划投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。本集合计划的业绩比较基准为：中国人民银行公布的同期 1 年期银行定期存款基准利率（税后）+1%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《光大阳光对冲 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划于 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 3 月 25 日（集合计划合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本集合计划财务报表所载财务信息根据下列企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2020 年 3 月 25 日（集合计划合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本集合计划以人民币为记账本位币，除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本集合计划对金融资产的持有意图和持有能力。本集合计划目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。本集合计划目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具（主要为权证

投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。本集合计划持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本集合计划目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本集合计划持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本集合计划成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:

(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;

(2)该金融资产已转移,且本集合计划将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者

(3)该金融资产已转移,虽然本集合计划既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本集合计划持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的,应对市场交易价

格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本集合计划持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本集合计划(1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且(2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。以公允价值计量且

其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬、托管费和销售服务费（如有）在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本集合计划收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 外币交易

无。

7.4.4.13 分部报告

本集合计划以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本集合计划内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本集合计划的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本集合计划能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本集合计划目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本集合计划的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本集合计划确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本集合计划根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基

金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 于2017年10月23日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自2017年10月23日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本集合计划持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本集合计划持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税

[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本集合计划的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2020年12月31日	
活期存款	21,871,738.77	
定期存款	-	
其中：存款期限1个月以内	-	
存款期限1-3个月	-	
存款期限3个月以上	-	
其他存款	-	
合计	21,871,738.77	

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2020年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	1,231,531,055.82	1,291,906,844.29	60,375,788.47	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	124,507,204.14	124,749,697.95	242,493.81
	银行间市场	248,516,800.00	249,113,000.00	596,200.00
	合计	373,024,004.14	373,862,697.95	838,693.81
资产支持证券	213,500,000.00	213,500,000.00	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,818,055,059.96	1,879,269,542.24	61,214,482.28	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末			备注
	合同/名义金额	2020年12月31日		
		公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-1,127,618,486.55	-	-	
其中：股指期货投资	-1,127,618,486.55	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	

合计	-1,127,618,486.55	-	+
----	-------------------	---	---

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则（试行）》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“权益衍生工具-股指期货投资”与“证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵消的条件，故将“权益衍生工具-股指期货投资”的期末公允价值以抵消后的净额列报，净额为零。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本集合计划本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本集合计划于本报告期末未持有任何买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
应收活期存款利息	4,216.28
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	10,998.50
应收债券利息	4,182,089.92
应收资产支持证券利息	2,874,271.24
应收买入返售证券利息	-6,813.70
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	581.90
合计	7,065,344.14

7.4.7.6 其他资产

本集合计划本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,292,039.11
银行间市场应付交易费用	1,575.00
合计	1,293,614.11

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	0.00
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	135,000.00
其他	119,682,200.00
合计	119,817,200.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

光大阳光对冲 6 个月持有混合 A

项目	本期 2020 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	38,874,579.27	38,874,579.27
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-29,478,999.43	-29,478,999.43
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	9,395,579.84	9,395,579.84

光大阳光对冲 6 个月持有混合 B

项目	本期 2020 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	294,218,367.58	294,218,367.58
本期赎回（以“-”号填列）	-217,172,084.78	-217,172,084.78
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	77,046,282.80	77,046,282.80

光大阳光对冲 6 个月持有混合 C

项目	本期 2020 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	1,883,058,249.49	1,883,058,249.49
本期赎回（以“-”号填列）	-56,855,414.40	-56,855,414.40

-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,826,202,835.09	1,826,202,835.09

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

光大阳光对冲 6 个月持有混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	5,148,748.34	-4,287,689.64	861,058.70
本期利润	1,383,727.22	-85,619.99	1,298,107.23
本期基金份额交易产生的变动数	-4,825,076.99	3,379,389.04	-1,445,687.95
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-4,825,076.99	3,379,389.04	-1,445,687.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,707,398.57	-993,920.59	713,477.98

光大阳光对冲 6 个月持有混合 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	17,419,595.83	-2,948,658.75	14,470,937.08
本期基金份额交易产生的变动数	-12,961,337.49	2,871,240.88	-10,090,096.61
其中：基金申购款	2,929,978.87	-91.76	2,929,887.11
基金赎回款	-15,891,316.36	2,871,332.64	-13,019,983.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,458,258.34	-77,417.87	4,380,840.47

光大阳光对冲 6 个月持有混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-33,747,924.99	25,639,977.35	-8,107,947.64
本期基金份额交易产生的变动数	134,312,897.34	-27,612,471.01	106,700,426.33
其中：基金申购款	137,992,489.78	-28,310,046.64	109,682,443.14
基金赎回款	-3,679,592.44	697,575.63	-2,982,016.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	100,564,972.35	-1,972,493.66	98,592,478.69

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
活期存款利息收入		401,392.61
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		-
结算备付金利息收入		146,968.21
其他		5,855.99
合计		554,216.81

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		79,246,899.03
股票投资收益——赎回差价收入		-
股票投资收益——申购差价收入		-
股票投资收益——证券出借差价收入		-
合计		79,246,899.03

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年12	

	月 31 日
卖出股票成交总额	3,851,242,308.75
减：卖出股票成本总额	3,771,995,409.72
买卖股票差价收入	79,246,899.03

7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本集合计划本报告期无股票证券出借差价收入。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-793,251.40
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-793,251.40

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	374,076,028.91
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	370,068,023.03
减：应收利息总额	4,801,257.28
买卖债券差价收入	-793,251.40

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本集合计划本报告期无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本集合计划在本报告期未进行贵金属投资。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本集合计划在本报告期无买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本集合计划在本报告期无贵金属赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本集合计划在本报告期无贵金属申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本集合计划本报告期无买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日
股指期货投资收益	-81,188,226.55

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,255,106.70
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,255,106.70

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	62,702,872.06
股票投资	61,807,119.81
债券投资	895,752.25
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-40,097,173.45
权证投资	-
期货	-40,097,173.45
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	22,605,698.61

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日
基金赎回费收入	750.48
其他收入	243.80
合计	994.28

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日
交易所市场交易费用	11,364,466.46
银行间市场交易费用	5,025.00
其他交易费用	3,331.00
合计	11,372,822.46

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日
审计费用	11,557.68
信息披露费	120,000.00

证券出借违约金	-
银行费用	675.12
账户维护费	15,900.00
合计	148,132.80

7.4.7.21 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本集合计划未发生需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本集合计划无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
上海光大证券资产管理有限公司（“光证资管”）	集合计划管理人、集合计划销售机构
广发银行股份有限公司	集合计划托管人
光大证券股份有限公司	集合计划管理人的股东、集合计划销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
光大证券	8,852,117,244.00	100.00

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
光大证券	1,325,043,920.00	100.00

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
光大证券	34,692,000,000.00	100.00

7.4.10.1.4 权证交易

本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
光大证券	6,447,920.78	100.00	1,292,039.11	100.00

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和手续费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本集合计划提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,499,009.48
其中：支付销售机构的客户维护费	3,670,136.15

注：1、本集合计划A类份额的管理费按前一日集合计划A类份额资产净值的1.5%的年费率计提。

A类份额管理费的计算方法如下： $H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$

H为每日应计提的集合计划A类份额管理费

E为前一日的集合计划A类份额的资产净值，A类份额管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、本集合计划 B 类份额的管理费按前一日集合计划 B 类份额资产净值的 1%的年费率计提。B 类份额管理费的计算方法如下： $H=E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的集合计划 B 类份额管理费

E 为前一日的集合计划 B 类份额的资产净值，B 类份额管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、本集合计划 C 类份额的管理费按前一日集合计划 C 类份额资产净值的 1%的年费率计提。C 类份额管理费的计算方法如下： $H=E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的集合计划 C 类份额管理费

E 为前一日的集合计划 C 类份额的资产净值，C 类份额管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

4、实际支付销售机构的客户维护费以本集合计划管理人和各销售机构对账确认的金额为准。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,479,299.33

注：本集合计划的托管费按前一日集合资产净值的 0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值集合计划托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期			
	2020 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C	合计
上海光大证券资产管理有限公司	-	-	810.27	810.27

光大证券股份有限公司	-	-	197,313.75	197,313.75
合计	-	-	198,124.02	198,124.02

注：1、销售服务费仅对 C 类份额收取。

2、销售服务费按前一日 C 类份额资产净值 0.4% 的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划销售服务费

E 为前一日的集合计划 C 类份额的资产净值。销售服务费逐日累计至每月月末，按月支付给各销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本集合计划本期未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本集合计划本期未与关联方进行转融通证券出借业务。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本集合计划本期未与关联方进行转融通证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期管理人未持有本集合计划份额。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期除管理人之外的其他关联方未持有本集合计划份额。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
广发银行股份有限公司	21,871,738.77	401,392.61

注：本集合计划的银行存款由基金托管人广发银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本集合计划本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本集合计划支付给光大期货的股指期货交易手续费参考市场价格经本集合的管理人与对方协商确定，以包括中国金融期货交易所收取的上交手续费的全额列示。于2020年12月31日，本集合无应付交易手续费余额。于2020年3月25日-2020年12月31日期间，本集合期间交易手续费支出214,946.63元。

本集合计划用于期货交易结算的资金分别存放于光大期货的结算账户和保证金账户中，结算备付金按银行同业利率计息，由光大期货进行结息处理，存出保证金不计息。于2020年12月31日，本集合的结算备付金余额为57,113,507.63元，存出保证金余额为147,574,412.00元。

7.4.11 利润分配情况

本集合计划本报告期末未进行利润分配。

7.4.12 期末(2020年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300860	锋尚文化	2020年8月6日	2021年2月24日	非公开限售	138.02	126.67	149	20,564.98	18,873.83	-
300861	美畅股份	2020年8月6日	2021年2月24日	非公开限售	43.76	51.10	421	18,422.96	21,513.10	-
300864	南大环境	2020年8月13日	2021年2月24日	非公开限售	71.71	90.85	156	11,186.76	14,172.60	-
300865	大宏立	2020年8月11日	2021年2月24日	非公开限售	20.20	37.22	3,170	64,034.00	117,987.40	-
300868	杰美特	2020年8月12日	2021年2月24日	非公开限售	41.26	43.28	385	15,885.10	16,662.80	-
300876	蒙泰高新	2020年8月	2021年2月	非公开限售	20.09	36.62	307	6,167.63	11,242.34	-

		14日	24日							
300881	盛德鑫泰	2020年8月25日	2021年3月1日	非公开限售	14.17	32.31	245	3,471.65	7,915.95	-
300882	万胜智能	2020年8月27日	2021年3月10日	非公开限售	10.33	25.79	336	3,470.88	8,665.44	-
300883	龙利得	2020年9月3日	2021年3月10日	非公开限售	4.64	14.05	8,266	38,354.24	116,137.30	-
300886	华业香料	2020年9月8日	2021年3月16日	非公开限售	18.59	45.67	121	2,249.39	5,526.07	-
300889	爱克股份	2020年9月9日	2021年3月16日	非公开限售	27.97	30.12	237	6,628.89	7,138.44	-
300890	翔丰华	2020年9月10日	2021年3月17日	非公开限售	14.69	48.85	215	3,158.35	10,502.75	-
300891	惠云钛业	2020年9月10日	2021年3月17日	非公开限售	3.64	16.40	562	2,045.68	9,216.80	-
300892	品渥食品	2020年9月11日	2021年3月24日	非公开限售	26.66	60.01	223	5,945.18	13,382.23	-
300893	松原股份	2020年9月17日	2021年3月24日	非公开限售	13.47	35.08	212	2,855.64	7,436.96	-
300895	铜牛信息	2020年9月17日	2021年3月24日	非公开限售	12.65	45.30	233	2,947.45	10,554.90	-
300896	爱美客	2020年9月21日	2021年3月29日	非公开限售	118.27	603.36	412	48,727.24	248,584.32	-
300898	熊猫乳品	2020年10月9日	2021年4月16日	非公开限售	10.78	33.03	200	2,156.00	6,606.00	-
300900	广联航空	2020年10月19日	2021年4月29日	非公开限售	17.87	33.16	448	8,005.76	14,855.68	-
300907	康平科技	2020年11月11日	2021年5月18日	非公开限售	14.30	26.85	283	4,046.90	7,598.55	-

		日								
300908	仲景食品	2020年11月13日	2021年5月24日	非公开限售	39.74	60.44	139	5,523.86	8,401.16	-
300910	瑞丰新材	2020年11月20日	2021年5月27日	非公开限售	30.26	47.87	208	6,294.08	9,956.96	-
300911	亿田智能	2020年11月24日	2021年6月3日	非公开限售	24.35	33.06	168	4,090.80	5,554.08	-
300913	兆龙互连	2020年11月27日	2021年6月7日	非公开限售	13.21	23.94	259	3,421.39	6,200.46	-
300917	特发服务	2020年12月14日	2021年6月21日	非公开限售	18.78	31.94	116	2,178.48	3,705.04	-
300918	南山智尚	2020年12月15日	2021年6月22日	非公开限售	4.97	8.94	546	2,713.62	4,881.24	-
300922	天秦装备	2020年12月18日	2021年6月25日	非公开限售	16.05	31.58	152	2,439.60	4,800.16	-
300925	法本信息	2020年12月21日	2021年6月30日	非公开限售	20.08	37.33	174	3,493.92	6,495.42	-
605277	新亚电子	2020年12月25日	2021年1月6日	新股未上市	16.95	16.95	134	2,271.30	2,271.30	-
003030	祖名股份	2020年12月25日	2021年01月06日	新股未上市	15.18	15.18	129	1,958.22	1,958.22	-
003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年01月04日	新股未上市	15.27	15.27	110	1,679.70	1,679.70	-

		日	日							
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年01月07日	新股未上市	10.76	10.76	1,801	19,378.76	19,378.76	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年01月07日	新股未上市	13.39	13.39	1,000	13,390.00	13,390.00	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113044	大秦转债	2020年12月16日	2021年01月15日	新债未上市	200.00	100.00	10,740	1,074,000.00	1,074,000.00	-
113616	韦尔转债	2020年12月29日	2021年01月22日	新债未上市	100.00	100.00	2,070	207,000.00	207,000.00	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本集合计划本报告期末未持有的暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本集合计划本报告期末参与银行间市场债券正回购。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本集合计划本报告期末参与交易所市场债券正回购。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本集合计划本报告期末参与转融通证券出借业务。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划在日常经营活动中面临的与金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。管理人制定内部风险管理制度来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

公司建立四个层级的风险管理体系，即董事会、经理层及各专业委员会、各风险管理职能部门、各业务部门。公司董事会是风险管理的最高决策机构，承担全面风险管理的最终责任。公司经理层就公司风险管理工作的有效性向董事会负责，对全面风险管理承担主要责任。公司经理层在董事会的领导下，全面负责公司风险管理的日常工作。公司经理层下设专业委员会就不同类别风险管理对经理层负责，委员会根据公司各委员会议事规则确定的职责范围，行使公司风险管理职能。各风险管理职能部门按照公司授权对公司不同风险进行识别、监测、评估和报告，并制定公司不同类型风险管理办法，明确具体工作流程，并为业务决策提供对口风险管理建议，协助、指导和检查各部门的对口风险管理工作。公司各业务部门按照公司授权管理体系在被授予的权限范围内开展业务，严禁越权从事经营活动，并通过制度、流程、系统等方式，进行有效管理和控制。

本集合计划的管理人主要通过定性分析和定量分析的方法评估各种金融工具风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本集合计划的投资目标，结合集合计划资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者集合计划所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。

本集合计划的银行存款存放在本集合计划的托管行广发银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本集合计划在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本集合计划的管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本集合计划债券投资的信用评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年12月31日
AAA	3,951,976.60
AAA以下	6,769,104.65
未评级	-
合计	10,721,081.25

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级；未包括国债、中央银行票据和政策性金融债。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年12月31日
AAA	213,500,000.00
AAA以下	-
未评级	-
合计	213,500,000.00

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指集合计划管理人未能以合理价格及时变现集合计划资产以支付投资者赎回款项的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于计划份额持有人可随时要求赎回其持有的计划份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划的管理人在运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本集合计划资产的流动性风险进行管理，集合计划管理人建立了健全的流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，对组合持仓集中度、流动性受限资产比例、现金类资产比例等流动性指标进行持续的监测和分析，通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，对交易对手进行必要的尽职调查和准入，加强逆回购的流动性风险和交易对手风险的管理，并健全了逆回购交易质押品管理制度。

本集合计划所持有的证券大部分具有良好的流动性，部分证券流通暂时受限的情况参见附注 7.4.12 “期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券”，本报告期内本集合计划未出现因投资品种变现困难或投资集中而无法以合理价格及时变现集合计划资产以支付赎回款的情况。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指集合计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本集合计划的管理人定期对本集合计划面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	21,871,738.77	-	-	-	21,871,738.77
结算备付金	81,554,644.23	-	-	-	81,554,644.23
存出保证金	148,867,591.34	-	-	-	148,867,591.34
交易性金融资产	224,597,697.95	362,765,000.00	-	-1,291,906,844.29	1,879,269,542.24
应收利息	-	-	-	7,065,344.14	7,065,344.14
应收证券清算款	-	-	-	5,716,507.62	5,716,507.62

资产总计	476,891,672.29	362,765,000.00	-1,304,688,696.05	2,144,345,368.34
负债				
应付赎回款	-	-	2,628,833.39	2,628,833.39
应付管理人报酬	-	-	1,708,328.30	1,708,328.30
应付托管费	-	-	340,514.48	340,514.48
应付证券清算款	-	-	1,556,905.78	1,556,905.78
应付销售服务费	-	-	646,069.76	646,069.76
应付交易费用	-	-	1,293,614.11	1,293,614.11
应交税费	-	-	22,407.65	22,407.65
其他负债	-	-	119,817,200.00	119,817,200.00
负债总计	-	-	128,013,873.47	128,013,873.47
利率敏感度缺口	476,891,672.29	362,765,000.00	-1,176,674,822.58	2,016,331,494.87

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2020年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-1,084,386.80
	市场利率下降 25 个基点	1,084,386.80

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本集合计划的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

无。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是集合计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素发生变动时产生的价格波动风险。本集合计划主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于

证券市场整体波动的影响。本集合计划严格按照合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，管理人每日对本集合计划所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对集合计划进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	1,291,906,844.29	64.07
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	1,291,906,844.29	64.07

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2020年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	94,767,580.26
	业绩比较基准下降5%	-94,767,580.26

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 1,414,612,296.28 元，属于第二层次的余额为 464,657,245.96 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本集合计划据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日，本集合计划未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本集合计划无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,291,906,844.29	60.25
	其中：股票	1,291,906,844.29	60.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	587,362,697.95	27.39

	其中：债券	373,862,697.95	17.43
	资产支持证券	213,500,000.00	9.96
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	103,426,383.00	4.82
8	其他各项资产	161,649,443.10	7.54
9	合计	2,144,345,368.34	100.00

注：本集合计划本报告期末持有港股通交易机制投资的港股。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	10,863,926.32	0.54
B	采矿业	61,093,763.62	3.03
C	制造业	663,693,817.04	32.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,899,603.70	0.89
E	建筑业	38,857,383.65	1.93
F	批发和零售业	2,018,746.71	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	18,182,553.58	0.90
H	住宿和餐饮业	360,710.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	33,385,036.97	1.66
J	金融业	253,853,279.01	12.59
K	房地产业	41,408,789.21	2.05
L	租赁和商务服务业	50,206,554.69	2.49
M	科学研究和技术服务业	16,813,095.08	0.83
N	水利、环境和公共设施管理业	6,859,191.75	0.34
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	10,512,015.06	0.52
Q	卫生和社会工作	54,795,361.07	2.72
R	文化、体育和娱乐业	11,103,016.83	0.55
S	综合	-	-
	合计	1,291,906,844.29	64.07

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本集合计划本期末未持有港股通投资股票投资组合。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	600519	贵州茅台	22,819	45,592,362.00	2.26
2	601888	中国中免	113,138	31,955,828.10	1.58
3	601166	兴业银行	1,415,857	29,548,935.59	1.47
4	601318	中国平安	337,013	29,313,390.74	1.45
5	000001	平安银行	1,290,420	24,956,722.80	1.24
6	300015	爱尔眼科	329,651	24,687,563.39	1.22
7	600584	长电科技	526,900	22,430,133.00	1.11
8	000961	中南建设	2,414,704	21,321,836.32	1.06
9	601658	邮储银行	4,445,811	21,250,976.58	1.05
10	000568	泸州老窖	93,505	21,147,090.80	1.05
11	601117	中国化学	3,571,474	20,964,552.38	1.04
12	600705	中航资本	4,575,732	20,041,706.16	0.99
13	300059	东方财富	632,908	19,620,148.00	0.97
14	603501	韦尔股份	79,600	18,395,560.00	0.91
15	002027	分众传媒	1,826,825	18,030,762.75	0.89
16	600438	通威股份	465,906	17,909,426.64	0.89
17	601211	国泰君安	1,006,948	17,651,798.44	0.88
18	601899	紫金矿业	1,815,687	16,867,732.23	0.84
19	600887	伊利股份	367,600	16,310,412.00	0.81
20	600104	上汽集团	637,700	15,585,388.00	0.77
21	002867	周大生	581,142	15,487,434.30	0.77
22	002241	歌尔股份	411,600	15,360,912.00	0.76
23	603882	金域医学	118,738	15,212,712.56	0.75
24	000661	长春高新	33,496	15,036,689.36	0.75
25	300244	迪安诊断	411,704	14,113,213.12	0.70
26	601225	陕西煤业	1,503,669	14,044,268.46	0.70
27	002281	光迅科技	479,317	13,919,365.68	0.69
28	000858	五粮液	47,500	13,862,875.00	0.69
29	002244	滨江集团	3,015,855	13,842,774.45	0.69
30	601688	华泰证券	758,800	13,665,988.00	0.68
31	600028	中国石化	3,314,131	13,355,947.93	0.66
32	600031	三一重工	372,543	13,031,554.14	0.65
33	601615	明阳智能	662,500	12,574,250.00	0.62
34	002475	立讯精密	214,878	12,058,953.36	0.60
35	600036	招商银行	270,909	11,906,450.55	0.59
36	000333	美的集团	112,104	11,035,517.76	0.55
37	300413	芒果超媒	150,500	10,911,250.00	0.54

38	300122	智飞生物	73,105	10,812,960.55	0.54
39	601390	中国中铁	2,043,801	10,770,831.27	0.53
40	002607	中公教育	294,474	10,344,871.62	0.51
41	000725	京东方A	1,710,600	10,263,600.00	0.51
42	603833	欧派家居	75,851	10,201,959.50	0.51
43	300676	华大基因	75,938	9,762,589.28	0.48
44	002157	正邦科技	571,242	9,733,963.68	0.48
45	600809	山西汾酒	25,200	9,457,308.00	0.47
46	601919	中远海控	735,400	8,979,234.00	0.45
47	300124	汇川技术	93,611	8,733,906.30	0.43
48	300498	温氏股份	473,744	8,636,353.12	0.43
49	601377	兴业证券	971,500	8,432,620.00	0.42
50	603993	洛阳钼业	1,348,900	8,430,625.00	0.42
51	002179	中航光电	106,300	8,322,227.00	0.41
52	601633	长城汽车	219,900	8,314,419.00	0.41
53	600507	方大特钢	1,182,628	8,207,438.32	0.41
54	601336	新华保险	140,700	8,156,379.00	0.40
55	300274	阳光电源	110,700	8,001,396.00	0.40
56	300408	三环集团	213,800	7,964,050.00	0.39
57	002736	国信证券	581,900	7,937,116.00	0.39
58	002236	大华股份	390,300	7,763,067.00	0.39
59	300888	稳健医疗	45,700	7,586,200.00	0.38
60	601600	中国铝业	2,078,200	7,543,866.00	0.37
61	600177	雅戈尔	1,046,128	7,521,660.32	0.37
62	600011	华能国际	1,662,800	7,449,344.00	0.37
63	002945	华林证券	484,700	7,304,429.00	0.36
64	002100	天康生物	686,869	7,273,942.71	0.36
65	600820	隧道股份	1,227,700	6,641,857.00	0.33
66	002705	新宝股份	156,178	6,598,520.50	0.33
67	601860	紫金银行	1,563,848	6,583,800.08	0.33
68	002594	比亚迪	33,200	6,450,760.00	0.32
69	002318	久立特材	585,893	6,386,233.70	0.32
70	002080	中材科技	246,800	5,967,624.00	0.30
71	002382	蓝帆医疗	277,458	5,851,589.22	0.29
72	300737	科顺股份	266,900	5,727,674.00	0.28
73	600900	长江电力	298,000	5,709,680.00	0.28
74	002230	科大讯飞	139,050	5,682,973.50	0.28
75	000157	中联重科	572,300	5,665,770.00	0.28
76	600804	鹏博士	832,800	5,596,416.00	0.28
77	600291	西水股份	973,500	5,519,745.00	0.27
78	300529	健帆生物	80,200	5,439,164.00	0.27
79	002311	海大集团	83,000	5,436,500.00	0.27

80	002434	万里扬	609,400	5,435,848.00	0.27
81	600388	龙净环保	603,872	5,362,383.36	0.27
82	002266	浙富控股	1,190,830	5,358,735.00	0.27
83	300212	易华录	172,500	5,287,125.00	0.26
84	603045	福达合金	418,598	5,052,477.86	0.25
85	603799	华友钴业	62,400	4,948,320.00	0.25
86	600741	华域汽车	168,100	4,844,642.00	0.24
87	000423	东阿阿胶	121,627	4,708,181.17	0.23
88	601857	中国石油	1,089,000	4,519,350.00	0.22
89	600276	恒瑞医药	39,000	4,346,940.00	0.22
90	000690	宝新能源	575,199	4,198,952.70	0.21
91	600690	海尔智家	135,286	3,951,704.06	0.20
92	603486	科沃斯	44,300	3,920,107.00	0.19
93	002832	比音勒芬	237,928	3,863,950.72	0.19
94	601799	星宇股份	19,200	3,849,600.00	0.19
95	603345	安井食品	19,700	3,799,539.00	0.19
96	603986	兆易创新	18,700	3,693,250.00	0.18
97	603259	药明康德	27,140	3,656,300.80	0.18
98	300750	宁德时代	10,200	3,581,322.00	0.18
99	600019	宝钢股份	597,100	3,552,745.00	0.18
100	601168	西部矿业	281,600	3,486,208.00	0.17
101	002372	伟星新材	185,640	3,471,468.00	0.17
102	601100	恒立液压	30,673	3,466,049.00	0.17
103	600660	福耀玻璃	71,500	3,435,575.00	0.17
104	000100	TCL科技	480,400	3,401,232.00	0.17
105	002709	天赐材料	32,747	3,399,138.60	0.17
106	300496	中科创达	28,900	3,381,300.00	0.17
107	002131	利欧股份	1,100,200	3,333,606.00	0.17
108	002352	顺丰控股	37,500	3,308,625.00	0.16
109	600958	东方证券	282,500	3,285,475.00	0.16
110	002958	青农商行	637,200	3,243,348.00	0.16
111	603686	龙马环卫	197,500	3,175,800.00	0.16
112	601865	福莱特	77,900	3,108,210.00	0.15
113	603885	吉祥航空	273,000	3,104,010.00	0.15
114	002139	拓邦股份	376,300	3,051,793.00	0.15
115	300763	锦浪科技	20,263	3,019,187.00	0.15
116	002409	雅克科技	49,800	2,992,482.00	0.15
117	300578	会畅通讯	74,500	2,984,470.00	0.15
118	603208	江山欧派	28,340	2,982,785.00	0.15
119	002430	杭氧股份	102,000	2,967,180.00	0.15
120	603678	火炬电子	40,900	2,957,070.00	0.15
121	603881	数据港	48,663	2,925,132.93	0.15

122	603416	信捷电气	32,100	2,915,964.00	0.14
123	002258	利尔化学	139,400	2,913,460.00	0.14
124	300726	宏达电子	40,100	2,901,235.00	0.14
125	600372	中航电子	147,100	2,890,515.00	0.14
126	002335	科华数据	128,970	2,881,189.80	0.14
127	603877	太平鸟	96,000	2,880,000.00	0.14
128	300782	卓胜微	5,000	2,852,700.00	0.14
129	300760	迈瑞医疗	6,400	2,726,400.00	0.14
130	002940	昂利康	64,500	2,667,720.00	0.13
131	601601	中国太保	68,800	2,641,920.00	0.13
132	300759	康龙化成	21,800	2,624,720.00	0.13
133	600309	万华化学	27,900	2,540,016.00	0.13
134	002778	高科石化	105,100	2,508,737.00	0.12
135	600606	绿地控股	422,200	2,461,426.00	0.12
136	002557	洽洽食品	42,548	2,291,209.80	0.11
137	002124	天邦股份	154,800	2,260,080.00	0.11
138	002714	牧原股份	28,892	2,227,573.20	0.11
139	002142	宁波银行	62,817	2,219,952.78	0.11
140	601012	隆基股份	23,400	2,157,480.00	0.11
141	002643	万润股份	97,900	2,131,283.00	0.11
142	300535	达威股份	140,300	1,971,215.00	0.10
143	002555	三七互娱	57,300	1,789,479.00	0.09
144	600048	保利地产	112,400	1,778,168.00	0.09
145	603043	广州酒家	45,855	1,775,964.15	0.09
146	300285	国瓷材料	39,300	1,772,823.00	0.09
147	600368	五洲交通	476,400	1,743,624.00	0.09
148	600426	华鲁恒升	46,200	1,723,260.00	0.09
149	300450	先导智能	20,400	1,713,396.00	0.08
150	300119	瑞普生物	90,100	1,701,088.00	0.08
151	600486	扬农化工	12,700	1,676,400.00	0.08
152	601009	南京银行	204,700	1,653,976.00	0.08
153	000651	格力电器	25,600	1,585,664.00	0.08
154	300724	捷佳伟创	10,200	1,485,120.00	0.07
155	601398	工商银行	286,300	1,428,637.00	0.07
156	603937	丽岛新材	142,600	1,414,592.00	0.07
157	000799	酒鬼酒	9,000	1,408,500.00	0.07
158	002064	华峰化学	138,300	1,395,447.00	0.07
159	002050	三花智控	54,100	1,333,565.00	0.07
160	600030	中信证券	41,200	1,211,280.00	0.06
161	600706	曲江文旅	166,501	1,190,482.15	0.06
162	000026	飞亚达	98,700	1,128,141.00	0.06
163	600703	三安光电	40,600	1,096,606.00	0.05

164	300999	金龙鱼	10,000	1,083,200.00	0.05
165	600143	金发科技	61,200	1,048,968.00	0.05
166	601328	交通银行	228,900	1,025,472.00	0.05
167	600000	浦发银行	104,500	1,011,560.00	0.05
168	002206	海利得	258,300	1,009,953.00	0.05
169	002371	北方华创	5,500	994,070.00	0.05
170	300394	天孚通信	18,407	981,645.31	0.05
171	600016	民生银行	174,800	908,960.00	0.05
172	300715	凯伦股份	22,800	905,160.00	0.04
173	600837	海通证券	69,100	888,626.00	0.04
174	000002	万科A	30,500	875,350.00	0.04
175	603378	亚士创能	20,100	858,471.00	0.04
176	002295	精艺股份	121,200	838,704.00	0.04
177	002008	大族激光	17,500	748,125.00	0.04
178	601288	农业银行	228,400	717,176.00	0.04
179	603589	口子窖	10,000	689,000.00	0.03
180	002949	华阳国际	35,900	673,125.00	0.03
181	002614	奥佳华	48,600	653,670.00	0.03
182	601988	中国银行	170,600	542,508.00	0.03
183	002049	紫光国微	4,000	535,240.00	0.03
184	600406	国电南瑞	20,000	531,400.00	0.03
185	300618	寒锐钴业	5,200	493,532.00	0.02
186	002601	龙蟠佰利	15,300	470,781.00	0.02
187	000906	浙商中拓	69,836	466,504.48	0.02
188	000039	中集集团	30,000	449,700.00	0.02
189	002304	洋河股份	1,900	448,381.00	0.02
190	603816	顾家家居	6,300	444,213.00	0.02
191	002415	海康威视	9,082	440,567.82	0.02
192	002497	雅化集团	20,000	439,000.00	0.02
193	002568	百润股份	4,200	438,018.00	0.02
194	002624	完美世界	14,800	436,600.00	0.02
195	600763	通策医疗	1,500	414,780.00	0.02
196	300502	新易盛	7,400	410,552.00	0.02
197	600009	上海机场	5,413	409,547.58	0.02
198	603238	诺邦股份	12,400	393,700.00	0.02
199	002216	三全食品	15,000	389,250.00	0.02
200	300003	乐普医疗	13,600	369,648.00	0.02
201	002044	美年健康	32,400	367,092.00	0.02
202	000895	双汇发展	7,800	366,132.00	0.02
203	600754	锦江酒店	7,000	360,710.00	0.02
204	002353	杰瑞股份	10,000	350,000.00	0.02
205	600066	宇通客车	18,500	313,020.00	0.02

206	000540	中天金融	97,800	308,070.00	0.02
207	600383	金地集团	22,700	306,450.00	0.02
208	603288	海天味业	1,500	300,810.00	0.01
209	002032	苏泊尔	3,800	296,362.00	0.01
210	600161	天坛生物	6,700	279,390.00	0.01
211	002572	索菲亚	10,000	259,000.00	0.01
212	600919	江苏银行	46,410	253,398.60	0.01
213	300896	爱美客	412	248,584.32	0.01
214	300033	同花顺	1,800	223,164.00	0.01
215	601599	鹿港文化	80,200	222,956.00	0.01
216	600688	上海石化	61,400	211,216.00	0.01
217	603786	科博达	3,000	202,860.00	0.01
218	603233	大参林	2,500	195,875.00	0.01
219	601689	拓普集团	5,000	192,150.00	0.01
220	600585	海螺水泥	3,700	190,994.00	0.01
221	300385	雪浪环境	23,620	184,944.60	0.01
222	601169	北京银行	38,200	184,888.00	0.01
223	300785	值得买	2,000	181,760.00	0.01
224	000733	振华科技	3,000	176,550.00	0.01
225	603338	浙江鼎力	1,660	167,975.40	0.01
226	002621	美吉姆	29,688	167,143.44	0.01
227	600517	国网英大	27,400	166,592.00	0.01
228	601668	中国建筑	32,800	163,016.00	0.01
229	000967	盈峰环境	20,000	162,800.00	0.01
230	300639	凯普生物	4,200	157,836.00	0.01
231	600219	南山铝业	46,400	146,624.00	0.01
232	600800	渤海化学	31,400	146,324.00	0.01
233	600320	振华重工	39,600	140,976.00	0.01
234	601678	滨化股份	26,700	140,175.00	0.01
235	002010	传化智联	29,504	138,963.84	0.01
236	603323	苏农银行	27,300	135,408.00	0.01
237	600575	淮河能源	57,400	133,168.00	0.01
238	603713	密尔克卫	1,000	130,990.00	0.01
239	300002	神州泰岳	25,000	127,750.00	0.01
240	600570	恒生电子	1,200	125,880.00	0.01
241	601228	广州港	36,200	121,632.00	0.01
242	300315	掌趣科技	23,700	121,107.00	0.01
243	000012	南玻A	16,345	120,626.10	0.01
244	300865	大宏立	3,170	117,987.40	0.01
245	300883	龙利得	8,266	116,137.30	0.01
246	002713	东易日盛	14,500	114,405.00	0.01
247	601778	晶科科技	15,500	112,530.00	0.01

248	002208	合肥城建	13,400	111,488.00	0.01
249	601016	节能风电	32,400	111,132.00	0.01
250	600750	江中药业	10,300	109,283.00	0.01
251	600588	用友网络	2,400	105,288.00	0.01
252	000759	中百集团	16,300	100,734.00	0.00
253	601126	四方股份	14,300	99,528.00	0.00
254	600600	青岛啤酒	1,000	99,400.00	0.00
255	002421	达实智能	27,700	99,166.00	0.00
256	000897	津滨发展	39,800	99,102.00	0.00
257	300010	豆神教育	10,119	98,761.44	0.00
258	600556	天下秀	7,800	98,670.00	0.00
259	603113	金能科技	6,000	98,100.00	0.00
260	600196	复星医药	1,800	97,182.00	0.00
261	603018	华设集团	8,800	96,360.00	0.00
262	603178	圣龙股份	10,800	95,364.00	0.00
263	000850	华茂股份	24,200	95,106.00	0.00
264	601088	中国神华	5,200	93,652.00	0.00
265	000957	中通客车	10,400	90,792.00	0.00
266	300776	帝尔激光	600	90,120.00	0.00
267	300298	三诺生物	2,500	89,500.00	0.00
268	601966	玲珑轮胎	2,500	87,925.00	0.00
269	600901	江苏租赁	15,900	87,609.00	0.00
270	300601	康泰生物	500	87,250.00	0.00
271	300030	阳普医疗	7,000	86,100.00	0.00
272	001979	招商蛇口	6,400	85,056.00	0.00
273	300070	碧水源	11,100	84,915.00	0.00
274	600505	西昌电力	11,700	82,485.00	0.00
275	300326	凯利泰	5,200	82,420.00	0.00
276	601001	晋控煤业	13,000	81,900.00	0.00
277	300115	长盈精密	3,300	81,345.00	0.00
278	603313	梦百合	2,500	81,050.00	0.00
279	300058	蓝色光标	13,500	81,000.00	0.00
280	603893	瑞芯微	1,100	79,585.00	0.00
281	601669	中国电建	20,500	79,540.00	0.00
282	002511	中顺洁柔	3,700	77,219.00	0.00
283	600592	龙溪股份	7,400	76,812.00	0.00
284	002123	梦网科技	5,300	75,419.00	0.00
285	300024	机器人	6,100	75,030.00	0.00
286	601298	青岛港	11,500	73,945.00	0.00
287	300729	乐歌股份	1,700	72,216.00	0.00
288	002043	兔宝宝	8,000	71,760.00	0.00
289	603758	秦安股份	7,400	71,706.00	0.00

290	600737	中粮糖业	7,400	71,632.00	0.00
291	300567	精测电子	1,300	71,422.00	0.00
292	600476	湘邮科技	6,800	71,060.00	0.00
293	000630	铜陵有色	27,600	70,932.00	0.00
294	000620	新华联	28,600	70,070.00	0.00
295	600547	山东黄金	2,800	66,136.00	0.00
296	300133	华策影视	10,700	66,126.00	0.00
297	002941	新疆交建	5,900	64,900.00	0.00
298	000513	丽珠集团	1,600	64,800.00	0.00
299	600167	联美控股	5,700	64,695.00	0.00
300	600409	三友化工	6,300	64,575.00	0.00
301	600050	中国联通	14,100	62,886.00	0.00
302	603566	普莱柯	3,000	62,190.00	0.00
303	300433	蓝思科技	2,000	61,220.00	0.00
304	600657	信达地产	15,000	60,750.00	0.00
305	601989	中国重工	14,200	59,498.00	0.00
306	600745	闻泰科技	600	59,400.00	0.00
307	600305	恒顺醋业	2,676	59,246.64	0.00
308	000625	长安汽车	2,700	59,076.00	0.00
309	300677	英科医疗	350	58,852.50	0.00
310	603719	良品铺子	1,000	58,670.00	0.00
311	002959	小熊电器	514	58,261.90	0.00
312	601186	中国铁建	7,200	56,880.00	0.00
313	600461	洪城水业	8,400	56,784.00	0.00
314	603936	博敏电子	4,500	56,520.00	0.00
315	000576	甘化科工	5,300	56,180.00	0.00
316	603335	迪生力	12,000	55,680.00	0.00
317	600710	苏美达	9,900	55,440.00	0.00
318	300666	江丰电子	1,100	54,461.00	0.00
319	000932	华菱钢铁	11,300	54,014.00	0.00
320	600012	皖通高速	8,700	53,766.00	0.00
321	002539	云图控股	7,200	53,208.00	0.00
322	002367	康力电梯	5,400	53,082.00	0.00
323	002315	焦点科技	3,200	52,864.00	0.00
324	002669	康达新材	3,200	52,704.00	0.00
325	002039	黔源电力	3,400	52,394.00	0.00
326	601598	中国外运	11,900	52,360.00	0.00
327	002797	第一创业	5,200	51,740.00	0.00
328	000059	华锦股份	9,368	51,711.36	0.00
329	601163	三角轮胎	3,200	51,424.00	0.00
330	603918	金桥信息	4,900	50,666.00	0.00
331	002054	德美化工	6,200	50,530.00	0.00

332	601900	南方传媒	6,100	50,508.00	0.00
333	600871	石化油服	25,400	49,784.00	0.00
334	002548	金新农	6,100	48,617.00	0.00
335	000035	中国天楹	11,700	48,087.00	0.00
336	000671	阳光城	7,300	47,596.00	0.00
337	300253	卫宁健康	2,500	43,750.00	0.00
338	300007	汉威科技	2,700	42,012.00	0.00
339	601138	工业富联	3,000	41,070.00	0.00
340	300207	欣旺达	1,300	39,923.00	0.00
341	300136	信维通信	1,100	39,468.00	0.00
342	600466	蓝光发展	7,980	36,947.40	0.00
343	600985	淮北矿业	3,100	34,689.00	0.00
344	600125	铁龙物流	5,500	33,110.00	0.00
345	300073	当升科技	500	32,425.00	0.00
346	300558	贝达药业	300	32,211.00	0.00
347	600795	国电电力	14,300	32,175.00	0.00
348	600968	海油发展	13,300	31,787.00	0.00
349	603160	汇顶科技	200	31,110.00	0.00
350	000902	新洋丰	1,900	30,400.00	0.00
351	600008	首创股份	10,400	29,432.00	0.00
352	601066	中信建投	700	29,400.00	0.00
353	600960	渤海汽车	6,300	29,232.00	0.00
354	601999	出版传媒	4,800	28,464.00	0.00
355	300383	光环新网	1,600	27,472.00	0.00
356	000923	河钢资源	1,100	27,379.00	0.00
357	300088	长信科技	3,000	26,670.00	0.00
358	300661	圣邦股份	100	26,380.00	0.00
359	601816	京沪高铁	4,400	24,904.00	0.00
360	002641	永高股份	3,900	24,882.00	0.00
361	300146	汤臣倍健	1,000	24,150.00	0.00
362	300316	晶盛机电	800	24,064.00	0.00
363	300861	美畅股份	421	21,513.10	0.00
364	300017	网宿科技	3,000	20,670.00	0.00
365	601319	中国人保	3,117	20,478.69	0.00
366	600918	中泰证券	1,100	20,350.00	0.00
367	300926	博俊科技	1,801	19,378.76	0.00
368	300860	锋尚文化	149	18,873.83	0.00
369	300223	北京君正	200	18,298.00	0.00
370	300251	光线传媒	1,500	18,105.00	0.00
371	300773	拉卡拉	600	17,952.00	0.00
372	300296	利亚德	2,800	17,808.00	0.00
373	300009	安科生物	1,200	17,616.00	0.00

374	300868	杰美特	385	16,662.80	0.00
375	300900	广联航空	448	14,855.68	0.00
376	300864	南大环境	156	14,172.60	0.00
377	300259	新天科技	2,800	13,916.00	0.00
378	300927	江天化学	1,000	13,390.00	0.00
379	300892	品渥食品	223	13,382.23	0.00
380	600350	山东高速	2,100	12,978.00	0.00
381	300166	东方国信	1,100	12,045.00	0.00
382	300377	赢时胜	1,300	11,401.00	0.00
383	300876	蒙泰高新	307	11,242.34	0.00
384	601236	红塔证券	600	11,154.00	0.00
385	300895	铜牛信息	233	10,554.90	0.00
386	600727	鲁北化工	1,500	10,515.00	0.00
387	300890	翔丰华	215	10,502.75	0.00
388	300113	顺网科技	600	10,290.00	0.00
389	300910	瑞丰新材	208	9,956.96	0.00
390	300182	捷成股份	3,000	9,690.00	0.00
391	300891	惠云钛业	562	9,216.80	0.00
392	300889	爱克股份	287	8,713.94	0.00
393	300882	万胜智能	336	8,665.44	0.00
394	300908	仲景食品	139	8,401.16	0.00
395	300881	盛德鑫泰	245	7,915.95	0.00
396	300907	康平科技	283	7,598.55	0.00
397	300893	松原股份	212	7,436.96	0.00
398	300748	金力永磁	200	7,268.00	0.00
399	003026	中晶科技	152	7,168.32	0.00
400	300898	熊猫乳品	200	6,606.00	0.00
401	300925	法本信息	174	6,495.42	0.00
402	300913	兆龙互连	259	6,200.46	0.00
403	300911	亿田智能	168	5,554.08	0.00
404	300886	华业香料	121	5,526.07	0.00
405	002493	荣盛石化	199	5,494.39	0.00
406	605179	一鸣食品	293	5,174.38	0.00
407	300918	南山智尚	546	4,881.24	0.00
408	300922	天秦装备	152	4,800.16	0.00
409	003029	吉大正元	177	4,626.78	0.00
410	003028	振邦智能	108	4,502.52	0.00
411	000876	新希望	200	4,480.00	0.00
412	000975	银泰黄金	500	4,305.00	0.00
413	002508	老板电器	100	4,078.00	0.00
414	600784	鲁银投资	700	3,955.00	0.00
415	300917	特发服务	116	3,705.04	0.00

416	605277	新亚电子	134	2,271.30	0.00
417	603809	豪能股份	100	2,069.00	0.00
418	003030	祖名股份	129	1,958.22	0.00
419	003031	中瓷电子	110	1,679.70	0.00
420	002116	中国海诚	200	1,402.00	0.00
421	002585	双星新材	100	1,006.00	0.00
422	600794	保税科技	200	660.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	106,563,300.79	5.29
2	600519	贵州茅台	85,824,361.80	4.26
3	600887	伊利股份	56,592,789.03	2.81
4	000858	五粮液	51,973,287.45	2.58
5	601166	兴业银行	50,520,679.38	2.51
6	000961	中南建设	50,354,078.27	2.50
7	300059	东方财富	49,827,863.37	2.47
8	002475	立讯精密	49,272,542.44	2.44
9	600036	招商银行	46,549,201.44	2.31
10	000333	美的集团	45,633,014.23	2.26
11	601688	华泰证券	45,058,932.25	2.23
12	601888	中国中免	43,643,407.87	2.16
13	002027	分众传媒	41,688,985.80	2.07
14	300676	华大基因	41,381,027.23	2.05
15	000001	平安银行	41,288,917.55	2.05
16	601211	国泰君安	41,124,724.87	2.04
17	300015	爱尔眼科	37,415,384.02	1.86
18	600031	三一重工	37,149,814.99	1.84
19	601319	中国人保	36,746,535.83	1.82
20	603501	韦尔股份	35,559,799.57	1.76

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	81,625,816.50	4.05
2	600519	贵州茅台	48,906,543.16	2.43
3	000858	五粮液	45,852,026.30	2.27
4	600887	伊利股份	40,663,579.44	2.02
5	000333	美的集团	40,294,313.05	2.00

6	002475	立讯精密	39,264,537.87	1.95
7	600036	招商银行	36,754,356.85	1.82
8	300059	东方财富	36,357,399.90	1.80
9	601319	中国人保	35,942,693.00	1.78
10	600048	保利地产	32,378,036.13	1.61
11	600143	金发科技	31,989,446.35	1.59
12	300676	华大基因	31,470,520.46	1.56
13	601012	隆基股份	31,414,626.76	1.56
14	000002	万科A	30,323,892.15	1.50
15	601688	华泰证券	29,799,090.72	1.48
16	600031	三一重工	29,345,172.17	1.46
17	300677	英科医疗	28,718,814.31	1.42
18	600309	万华化学	28,354,462.28	1.41
19	000961	中南建设	27,006,154.53	1.34
20	002271	东方雨虹	26,349,694.91	1.31

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,980,167,989.74
卖出股票收入（成交）总额	3,851,242,308.75

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	263,293,616.70	13.06
2	央行票据	-	-
3	金融债券	99,848,000.00	4.95
	其中：政策性金融债	99,848,000.00	4.95
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	10,721,081.25	0.53
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	373,862,697.95	18.54

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产
----	------	------	-------	------	-------

					净值比例(%)
1	200011	20 付息国债 11	1,000,000	99,850,000.00	4.95
2	019640	20 国债 10	841,410	84,031,616.70	4.17
3	200406	20 农发 06	600,000	59,856,000.00	2.97
4	200009	20 付息国债 09	500,000	49,415,000.00	2.45
5	200309	20 进出 09	400,000	39,992,000.00	1.98

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值 比例(%)
1	169365	盛安 02A	785,000	78,500,000.00	3.89
2	169255	畅融 3 优	600,000	60,000,000.00	2.98
3	169259	锦河 04A	600,000	60,000,000.00	2.98
4	138935	中和 11A	150,000	15,000,000.00	0.74

8.8 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贵金属投资明细

本集合计划本报告期末未持有贵金属投资

8.9 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

本集合计划本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/ 卖)	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IF2103	IF2103	-200	-312,696,000.00	-19,872,840.00	-
IF2101	IF2101	-150	-234,729,000.00	-9,130,108.31	-
IF2102	IF2102	-100	-156,312,000.00	-2,889,600.00	-
IH2106	IH2106	-5	-5,440,500.00	-167,730.00	-
IF2106	IF2106	-50	-77,520,000.00	-3,589,980.00	-
IC2101	IC2101	-220	-279,127,200.00	-2,152,235.14	-
IC2102	IC2102	-70	-88,160,800.00	-881,640.00	-
IC2103	IC2103	-10	-12,502,800.00	-185,680.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-38,869,813.45

股指期货投资本期收益（元）	-81,188,226.55
股指期货投资本期公允价值变动（元）	-40,097,173.45

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本集合计划使用股指期货对冲组合的系统性风险，从而分离出组合的超额收益。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，参与股指期货对冲。综合考虑股指期货不同合约之间的价差关系、套利机会、流动性等因素，在各股指期货合约之间进行动态配置和临近到期合约的展期操作，以提升组合收益和套期保值的效果。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本集合计划合同，本集合计划投资范围不包括国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末未进行国债期货投资。

8.11.3 本期国债期货投资评价

根据本集合计划合同，本集合计划投资范围不包括国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本报告编制日前一年内，本集合计划持有的“畅融3优”的发行主体五矿国际信托有限公司，因违规接受保险资金投资事务管理类信托计划被中国银行业监督管理委员会青海监管局公开处罚30万元（青银保监罚决字（2020）26号）。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本集合计划的前十名股票未超出集合计划合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	148,867,591.34
2	应收证券清算款	5,716,507.62
3	应收股利	-
4	应收利息	7,065,344.14
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	161,649,443.10

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110043	无锡转债	870,975.00	0.04
2	113583	益丰转债	810,420.00	0.04
3	128048	张行转债	611,975.00	0.03
4	110067	华安转债	590,100.00	0.03
5	110053	苏银转债	541,300.00	0.03
6	110061	川投转债	484,398.60	0.02
7	113543	欧派转债	467,575.00	0.02
8	110055	伊力转债	342,620.00	0.02
9	123048	应急转债	254,668.00	0.01
10	113588	润达转债	214,660.00	0.01
11	128113	比音转债	133,414.15	0.01

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
光大阳光对冲6个月持有	54	173,992.22	0.00	0.00	9,395,579.84	100.00

混合 A						
光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	710	108,515.89	28,146,931.88	36.53	48,899,350.92	63.47
光大阳光对冲 6 个月持有混合 C	200,960	9,087.39	841,799.05	0.05	1,825,361,036.04	99.95
合计	201,724	9,481.49	28,988,730.93	1.52	1,883,655,966.80	98.48

注：分级集合机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级集合，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级集合份额的合计数（即期末集合份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	246,554.14	2.6242
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	191,520.65	0.2486
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C	510,411.61	0.0279

金			
	合计	948,486.40	0.0496

注：从业人员持有集合占集合总份额比例的计算中，对下属分级集合，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级集合份额的合计数（即期末集合份额总额）。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	10~50
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	0~10
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	10~50
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	0
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C	0
	合计	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C
基金合同生效日（2020 年 3 月 25 日）基金份额总额	38,874,579.27	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	294,218,367.58	1,883,058,249.49
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	29,478,999.43	217,172,084.78	56,855,414.40
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分	-	-	-

变动份额（份 额减少以“-” 填列）			
本报告期末 基金份额总额	9,395,579.84	77,046,282.80	1,826,202,835.09

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本集合计划未召开集合计划份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本集合计划管理人、托管人均无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及集合计划管理人、集合计划财产、集合计划托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本集合计划投资策略未有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内集合计划管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所（特殊合伙）的报酬为 15,000.00 元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 1 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，集合计划管理人，集合计划托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单 元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	佣金	占当期佣 金 总量的比 例	
光大证券	2	8,852,117,244.00	100.00%	11,154,544.83	100.00%	-

注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易（如有）而合计支付该券商

的佣金合计，不单指股票交易佣金。

2、交易单元的选择标准和程序

(1) 选择标准

券商财务状况良好、经营行为规范，最近一年无重大违规行为；具有较强的研究服务能力；交易佣金收费合理。

(2) 选择程序

集合计划管理人根据以上标准对不同券商进行综合评价，然后根据评价选择券商，与其签订协议租用交易单元。

3、本报告期内无新增券商交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
光大证券	1,325,043,920.00	100.00%	34,692,000,000.00	100.00%	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	上海光大证券资产管理有限公司关于开通旗下部分集合计划转换业务的公告	中国证监会规定的媒介	2020年04月27日
2	光大阳光对冲策略6个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划暂停大额申购业务的公告	中国证监会规定的媒介	2020年05月14日
3	关于光大阳光对冲策略6个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划恢复大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	中国证监会规定的媒介	2020年07月22日
4	关于旗下光大阳光对冲策略6个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划增加代理销售机构的公告	中国证监会规定的媒介	2020年07月24日
5	关于旗下光大阳光对冲策略6个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划增加代理销售机构的公告	中国证监会规定的媒介	2020年08月17日
6	光大阳光对冲策略6个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划产品资料概要	中国证监会规定的媒介	2020年09月01日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、2020 年 7 月 22 日发布的关于光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划恢复大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告。

2、2020 年 7 月 24 日发布的关于旗下阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划增加代理销售机构的公告。

3、2020 年 8 月 17 日发布的关于旗下阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划增加代理销售机构的公告。

4、市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本集合计划持有股票资产 1,291,906,844.29 元，占基金资产净值的比例为 64.0721%，运用股指期货进行对冲的空头合约市值为-1,166,488,300.00 元，占基金资产净值的比例为-57.852%，空头合约市值占股票资产的比例为-90.2919%。权益类多头头寸价值（本集合计划中的股票资产以及多头合约市值（本报告期末持仓））减去权益类空头头寸价值（本集合计划中的空头合约市值），占集合计划净资产净值比例为 6.2201%。

本报告期内，本集合计划执行市场中性策略的投资收益为 1,313,779.18 元，公允价值变动损益为 21,709,946.36 元。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中国证监会关于同意光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划合同变更的函；

2、《光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》；

3、《光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划托管协议》；

4、《光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书》；

5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；

6、集合计划管理人业务资格批件、营业执照；

7、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

备查文件存放于集合计划管理人的办公场所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号3号楼26层。

13.3 查阅方式

备查文件存放于集合计划管理人的办公场所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号3号楼26层。

上海光大证券资产管理有限公司

2021年3月31日