

# 光大阳光新兴产业集合资产管理计划 2020 年度 资产管理报告

计划管理人：上海光大证券资产管理有限公司

计划托管人：中国工商银行股份有限公司

报告期间：2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日

## 重要提示

本报告依据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其他有关规定制作。

中国证监会 2010 年 12 月 14 日对本集合计划出具了批准文件（证监机构字[2010]1821 号文《关于核准光大证券有限公司设立光大阳光新兴产业集合资产管理计划的批复》），但中国证监会对本集合计划作出的任何决定，均不表明中国证监会对本集合计划的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明参与本集合计划没有风险。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

托管人已复核了本报告中主要财务指标、投资组合报告、集合计划份额变动情况中的数据。

管理人保证本报告中所载资料的真实性、准确性和完整性。

本报告中的内容由管理人负责解释。

本报告中的金额单位除特指外均为人民币元。

### 一、集合计划简介

计划名称	光大阳光新兴产业集合资产管理计划
计划交易代码	860008
计划产品类型	混合型资产管理计划
计划合同生效日	2011-01-31
成立规模	1,284,966,952.60 元
计划合同存续期限	无固定存续期
报告期末资产份额总额	54,651,518.43 份
业绩比较基准	-

风险收益特征	-
资产管理人	上海光大证券资产管理有限公司
资产托管人	中国工商银行股份有限公司

## 二、主要财务指标和集合计划净值表现

### (一) 主要财务指标

(单位: 元)

主要财务指标	报告期 (2020年01月01日 -2020年12月31日)
1. 本期已实现收益	33,019,822.90
2. 本期利润	38,880,988.86
3. 期末资产净值	96,059,794.02
4. 期末份额净值	1.7577

注: 主要财务指标如下:

“本期利润”指标的计算方法为当期净收益加上当期因对金融资产进行估值产生的未实现利得变动额。

所述集合计划业绩指标不包括持有人交易本集合计划的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### (二) 净值表现

#### 1. 与同期业绩比较基准变动的比较:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	18.38%	1.04%	13.60%	0.99%	4.78%	0.05%
过去六个月	34.54%	1.28%	25.15%	1.35%	9.38%	-0.07%
过去一年	55.87%	1.39%	27.21%	1.43%	28.66%	-0.05%
过去三年	77.27%	1.04%	29.28%	1.34%	47.99%	-0.30%
自基金合同生效起至今	184.50%	1.11%	69.39%	1.42%	115.11%	-0.31%

## 三、集合计划管理人报告

### (一) 投资经理简介

沈吟 女士

英国拉夫堡大学金融管理硕士。现任上海光大证券资产管理有限公司多策略投资部副总

经理，从 2009 年进入光大证券股份有限公司，曾任光大证券固定收益总部债券承销经理助理，金融市场总部投资经理。2014 年进入上海光大证券资产管理有限公司，担任绝对收益产品投资经理。

## （二）投资经理工作报告

2020 年产品净值增长 56%，沪深 300 上涨 25%，大幅跑赢指数。

2020 年一季度国内新冠疫情爆发，市场全球市场出现了大幅下跌，得益于国内有力的疫情控制举措，二季度国内经济逐渐走出疫情冲击，内需逐渐恢复。三季度随着市场信心的恢复，外资开始回流，A 股和港股市场出现反弹，其中成长板块反弹最大，内需板块相对稳健。四季度市场开始演绎经济复苏逻辑，顺周期板块开始表现。

全年我们持续对持仓行业和品种做出调整，随着市场的结构性变化，我们增持了医药、消费、化工等行业，减持了机械、新能源等行业。我们全年的仓位维持在 90%左右。

A 股市场在过去两年时间中，陆续经历了经济下滑、贸易战、去杠杆、疫情等外在冲击的洗礼，展现出了较强的韧性。目前市场表面上波澜不惊，实际已经发生了较为明显的变化。过去三年中，除金周期股外，所有的股票估值均有所抬升，整个市场的定价已经相对合理。经历了三年的大幅上涨，市场平均估值已经不低，诸多股票股价均创出了历史新高，市场又一次出现了局部的泡沫。

市场总是在不同风格间变换，但我们对于企业价值的投资挖掘是一以贯之的，我们坚信 A 股市场将会继续进化，逐渐与国际接轨，将会诞生一批又一批的优质上市公司，我们将坚持投资风格，与优秀企业一起成长。

## 四、合规管理与风险控制报告

### 1、集合计划运作合规性声明

本报告期内，集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》及其他法律法规的规定，本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划资产，在严格控制风险的基础上，为集合计划持有人谋求最大利益。本报告期内，本集合计划运作合法合规，无损害集合计划持有人利益的行为，本集合计划的投资管理符合有关法规的规定。

### 2、合规管理报告

在本报告期内，公司级的合规部门对投资决策、投资授权、投资交易及合规性进行了全面细致的审查。本集合计划管理人对集合计划的管理始终都能按照有关法律法规、公司相关制度和集合资产管理计划说明书的要求进行。本集合计划的投资决策、投资交易程序、投资

权限等各方面均符合规定的要求；交易行为合法合规，未出现异常交易、操纵市场的现象；未发现内幕交易的情况；本集合计划持有的证券符合规定的比例要求；相关的信息披露和财务数据皆真实、完整、准确、及时。

### 3、风险控制报告

本报告期内，集合计划管理人通过独立的风险控制部门，加强对集合资产管理业务风险的事前分析、事中监控和事后评估，并提出风险控制措施。本次风险控制报告综合了集合计划管理人全面自查和风险管理部日常监控、重点检查的结果。

本集合计划管理人的风险控制工作主要通过上海光大证券资产管理有限公司内部控制进行。为加强资产管理业务的风险管理，集合计划管理人成立了独立的风险与绩效管理部，作为资产管理业务的风险管理职能部门，全面负责资产管理业务的内部控制、风险管理工作，内容包括集合计划的风险揭示及管理、逐日盯市、授权管理、绩效评估、定期与不定期检查、交易印章的使用、交易合同的报备等。

## 五、集合计划托管人报告

-

## 六、审计报告

### 资产负债表（2020 年度）

编制单位：光大阳光新兴产业集合资产管理计划 金额单位：元

资产	期末余额	年初余额	负债与持有人权益	期末余额	年初余额
资产：			负债：		
银行存款	8,889,783.33	6,884,545.46	短期借款	-	-
清算备付金	61,338.55	381,523.17	交易性金融负债	-	-
存出保证金	31,166.69	57,020.47	衍生金融负债	-	-
交易性金	87,793,810.53	91,386,673.92	卖出回	-	-

融资产			购金融 资产款		
其中：股票 投资	87,793,810.53	65,604,177.00	应付证 券清算 款	-	-
债券投资	-	25,782,494.39	应付赎 回款	137,172.36	136,299.35
基金投资	-	2.53	应付管 理人报 酬	102,618.78	101,430.95
资产支持证 券投资	-	-	应付托 管费	19,523.93	20,633.99
理财投资	-	-	应付受 托费	-	-
权证投资	-	-	应付销 售服务 费	-	-
衍生金融 资产	-	-	应付投 资顾问 费	-	-
可供出售金 融资产减值 准备	-	-	应付交 易费用	7,201.58	29,949.46
买入返售 金融资产	-	-	应交税 费	435,776.96	252,621.84
应收证券 清算款	-	-	应付利 息	-	-
应收利息	988.53	48,622.16	应付利 润	-	-
应收股利	-	-	应付其 他运营 费用	-	-
应收申购 款	-	-	其他负 债	15,000.00	20,273.14
其他资产	-	-	负债合 计	717,293.61	561,208.73
			所有者 权益：		
			实收计 划	54,651,518.43	87,078,210.21
			资本公 积	-	-
			未分配	41,408,275.59	11,118,966.24

			利润		
			所有者 权益合 计	96,059,794.02	98,197,176.45
<b>资产总计</b>	96,777,087.63	98,758,385.18	<b>负债及 所有者 权益总 计</b>	96,777,087.63	98,758,385.18

### 利润表（2020 年度）

编制单位：光大阳光新兴产业集合资产管理计划 金额单位：元

项 目	本年数	上年数
一、收入	41,319,455.29	61,779,034.10
1、利息收入	76,606.37	346,949.56
其中：存款利息收入	58,719.00	176,803.84
债券利息收入	17,028.47	51,639.76
资产支持证券利息收 入	-	-
买入返售金融资产收 入	858.90	118,505.96
2、投资收益（损失以“-”填 列）	35,360,506.52	16,107,281.43
其中：股票投资收益	31,694,631.92	5,498,210.36
债券投资收益	2,619,159.62	887,458.69
基金投资收益	2.15	5,979,864.09
权证投资收益	-	-
资产支持证券投资收 益	-	-
衍生工具收益	-	-
理财产品投资收益	-	-
股利收益	1,046,712.83	3,741,748.29
基金红利收益	-	-
3、公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	5,882,342.40	45,324,803.11
4、汇兑损益（损失以“-”填 列）	-	-
5、其他收入（损失以“-”号 填列）	-	-
二、费用	2,438,466.43	4,423,684.56
1、管理人报酬	1,045,525.75	2,249,280.49
2、托管费	217,817.83	468,600.11
3、销售服务费	-	-

4、运营服务费	-	-
5、投资顾问费	-	-
6、交易费用	977,493.24	1,603,392.77
7、财务费用	-	-
8、利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
9、其他费用	197,629.61	102,411.19
三、利润总额（亏损总额以“-”填列）	38,880,988.86	57,355,349.54
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”填列）	38,880,988.86	57,355,349.54

### 计划净值变动表（2020 年度）

编制单位：光大阳光新兴产业集合资产管理计划 金额单位：元

项目	本年金额			上年金额		
	实收计划	未分配利润	所有者权益合计	实收计划	未分配利润	所有者权益合计
一、年初所有者权益（计划净值）	87,078,210.21	11,118,966.24	98,197,176.45	377,929,256.73	-42,904,981.74	335,024,274.99
二、本年经营活动产生的计划净值变动数（本年净利润）	-	38,880,988.86	38,880,988.86	-	57,355,349.63	57,355,349.63
三、本年计划份额	-32,426,691.78	-8,591,679.51	-41,018,371.29	-290,851,046.52	-3,331,401.56	-294,182,448.08

交易产生的计划净值变动数（减少以“-”号填列）						
其中： 1、计划申购款	4,360,413.21	1,970,512.94	6,330,926.15	2,448,105.12	-13,607.58	2,434,497.54
2、计划赎回款	36,787,104.99	10,562,192.45	47,349,297.44	293,299,151.64	3,317,793.98	296,616,945.62
四、本年向计划份额持有人分配利润产生的计划净值变动数	-	-	-	-	-	-
五、年末所有者权益（计划净值）	54,651,518.43	41,408,275.59	96,059,794.02	87,078,210.21	11,118,966.33	98,197,176.54

## 七、集合计划投资组合报告

**1、本报告期末计划资产组合情况**

项目名称	金额（元）	占计划资产总值比例(%)
股票	87,793,810.53	90.72
基金	-	-
债券	-	-
权证	-	-
资产支持证券	-	-
买入返售金融资产	-	-
银行存款和结算备付金合计	8,951,121.88	9.25
应收证券清算款	-	-
其他资产	32,155.22	0.03
总计	96,777,087.63	100.00

**2、本报告期末按基金分类的基金投资组合**

基金类别	市值（元）	占计划资产净值比例(%)
封闭式基金	-	-
开放式基金	-	-
ETF 投资	-	-
合计	-	-

**3、本报告期末按市值占计划资产净值比例大小排序的前十名证券明细**

序号	证券代码	证券名称	数量（股）	市值（元）	市值占净值%
1	600276	恒瑞医药	50,000.00	5,573,000.00	5.80
2	000333	美的集团	55,000.00	5,414,200.00	5.64
3	601318	中国平安	60,000.00	5,218,800.00	5.43
4	300760	迈瑞医疗	12,000.00	5,112,000.00	5.32
5	000002	万科A	170,000.00	4,879,000.00	5.08
6	600036	招商银行	105,000.00	4,614,750.00	4.80
7	600309	万华化学	50,200.00	4,570,208.00	4.76
8	300285	国瓷材料	100,000.00	4,511,000.00	4.70
9	000651	格力电器	70,000.00	4,335,800.00	4.51
10	603259	药明康德	30,000.00	4,041,600.00	4.21

**4、报告期末本计划投资的股指期货交易情况**

代码	名称	持仓量 <sup>1</sup> （买/卖）	合约市值	公允价值变动	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计					-

<sup>1</sup> 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

股指期货投资本期收益	-
股指期货投资本期公允价值变动	-

#### 5、本计划投资股指期货的投资政策<sup>2</sup>

-
---

#### 6、报告期末本集合计划投资国债期货交易情况

代码	名称	持仓量 <sup>3</sup> (买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计					-
国债期货投资本期收益					-
国债期货投资本期公允价值变动					-

#### 7、本期国债期货的投资政策<sup>4</sup>

-
---

#### 投资组合报告附注

- 1) 本集合计划本期投资的前十名证券中，无报告期内发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的证券。
- 2) 本集合计划投资的前十名股票中，没有投资于超出集合计划合同规定备选股票库之外的股票。
- 3) 集合计划其他资产的构成：

单位：元

存出保证金	31,166.69
应收利息	988.53
应收股利	-
应收申购款	-
信托投资	-
合计	32,155.22

<sup>2</sup> 填写股指期货投资政策，揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

<sup>3</sup> 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

<sup>4</sup> 填写股指期货投资政策，揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

## 八、计划份额持有人户数、持有人结构

### (一) 持有人户数、持有人结构

#### 1、报告期末计划份额持有人户数

报告期末计划份额持有人户数	-
报告期末平均每户持有计划份额	-

-

#### 2、报告期末计划份额持有人结构：

项目	持有计划份额（份）	占总份额比例(%)
计划份额总额	54,651,518.43	100.00
机构投资者	-	-
个人投资者	-	-

### (二) 集合计划份额变动情况

期初总份额（份）	期间参与份额（份）	期间退出份额（份）	期末总份额（份）
87,078,210.21	4,360,413.21	36,787,104.99	54,651,518.43

-

## 九、重要事项提示

(一) 本集合计划管理人及托管人在本报告期内没有发生涉及本集合计划管理人、财产、托管业务的诉讼事项。

(二) 本集合计划聘请的会计师事务所没有发生变更。

(三) 本报告期内集合计划的投资组合策略没有发生重大改变。

(四) 本集合计划管理人、托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员没有收到任何处罚。

## 十、备查文件目录

(一) 中国证监会关于光大证券股份有限公司“光大阳光新兴产业集合资产管理计划”设立的批复

(二) “光大阳光新兴产业集合资产管理计划”验资报告，立信会师报字（2011）第 10310 号

(三) 关于“光大阳光新兴产业集合资产管理计划”成立的公告

- (四) “光大阳光新兴产业集合资产管理计划” 计划说明书
- (五) “光大阳光新兴产业集合资产管理计划” 计划合同
- (六) 管理人业务资格批件、营业执照

上海光大证券资产管理有限公司

2021 年 04 月 30 日