

# 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 2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 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：2025 年 8 月 29 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。本中期报告已经三分之二以上董事签字同意，并由董事长签发。

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 2025 年 8 月 28 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。

集合计划管理人承诺以诚实信用、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。

集合计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本集合计划的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
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	11
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 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	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55

7.6 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 .....	55
7.7 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 .....	55
7.8 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 .....	55
7.9 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 .....	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	56
7.12 市场中性策略执行情况 .....	56
7.13 投资组合报告附注 .....	56
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>58</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	58
8.3 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 .....	59
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>59</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>60</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	60
10.2 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 .....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	60
10.4 基金投资策略的改变 .....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	60
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	60
10.8 其他重大事件 .....	61
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>62</b>
11.1 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 .....	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	62
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>62</b>
12.1 备查文件目录 .....	62
12.2 存放地点 .....	62
12.3 查阅方式 .....	62

## § 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	98,536,057.93 份		
基金合同存续期	存续期至 2025 年 11 月 30 日，本集合计划自 2025 年 11 月 30 日后，按照中国证监会的有关规定执行		
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	1,735,960.73 份	6,603,602.70 份	90,196,494.50 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</p>

	<p>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。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, 可以寻找到行业、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	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	顾洪峰
	联系电话	021-32068300	010-65169885
	电子邮箱	zhuyil@ebscn.com	guhongfeng@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	北京市西城区金融大街十五号鑫茂大厦北楼 4 层
邮政编码		200127	100053
法定代表人		熊国兵	王凯

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ebscn-am.com
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期(2025年1月1日-2025年6月30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	41,764.18	171,350.06	2,255,240.74
本期利润	20,987.25	91,753.44	1,095,662.04
加权平均基金份额本期利润	0.0121	0.0137	0.0107
本期加权平均净值利润率	1.10%	1.24%	0.99%
本期基金份额净值增长率	1.10%	1.26%	1.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025年6月30日)		
期末可供分配利润	189,682.26	747,908.74	8,152,093.83

期末可供分配基金份额利润	0.1093	0.1133	0.0904
期末基金资产净值	1,925,642.99	7,351,511.44	98,348,588.33
期末基金份额净值	1.1093	1.1133	1.0904
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025年6月30日)		
基金份额累计净值增长率	8.53%	11.33%	9.04%

注：1、表中的“期末”均指报告期最后一日，即 2025 年 6 月 30 日；“本期”指 2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 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。

4、期末可供分配利润，采用期末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）。

### 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
过去一个月	0.60%	0.12%	0.21%	0.01%	0.39%	0.11%
过去三个月	0.77%	0.21%	0.63%	0.01%	0.14%	0.20%
过去六个月	1.10%	0.20%	1.25%	0.01%	-0.15%	0.19%
过去一年	1.02%	0.34%	2.53%	0.01%	-1.51%	0.33%
过去三年	5.56%	0.28%	7.80%	0.01%	-2.24%	0.27%
自基金合同生效起至今	8.53%	0.27%	14.08%	0.01%	-5.55%	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
过去一个月	0.62%	0.12%	0.21%	0.01%	0.41%	0.11%
过去三个月	0.82%	0.21%	0.63%	0.01%	0.19%	0.20%
过去六个月	1.26%	0.21%	1.25%	0.01%	0.01%	0.20%
过去一年	1.42%	0.34%	2.53%	0.01%	-1.11%	0.33%
过去三年	7.05%	0.28%	7.80%	0.01%	-0.75%	0.27%
自基金合同生效起至今	11.33%	0.27%	14.08%	0.01%	-2.75%	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
过去一个月	0.58%	0.12%	0.21%	0.01%	0.37%	0.11%
过去三个月	0.72%	0.21%	0.63%	0.01%	0.09%	0.20%
过去六个月	1.06%	0.20%	1.25%	0.01%	-0.19%	0.19%
过去一年	1.02%	0.34%	2.53%	0.01%	-1.51%	0.33%
过去三年	5.76%	0.28%	7.80%	0.01%	-2.04%	0.27%
自基金合同生效起至今	9.04%	0.27%	14.08%	0.01%	-5.04%	0.26%

注：1、自基金合同生效起至今指 2020 年 3 月 25 日至 2025 年 6 月 30 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%

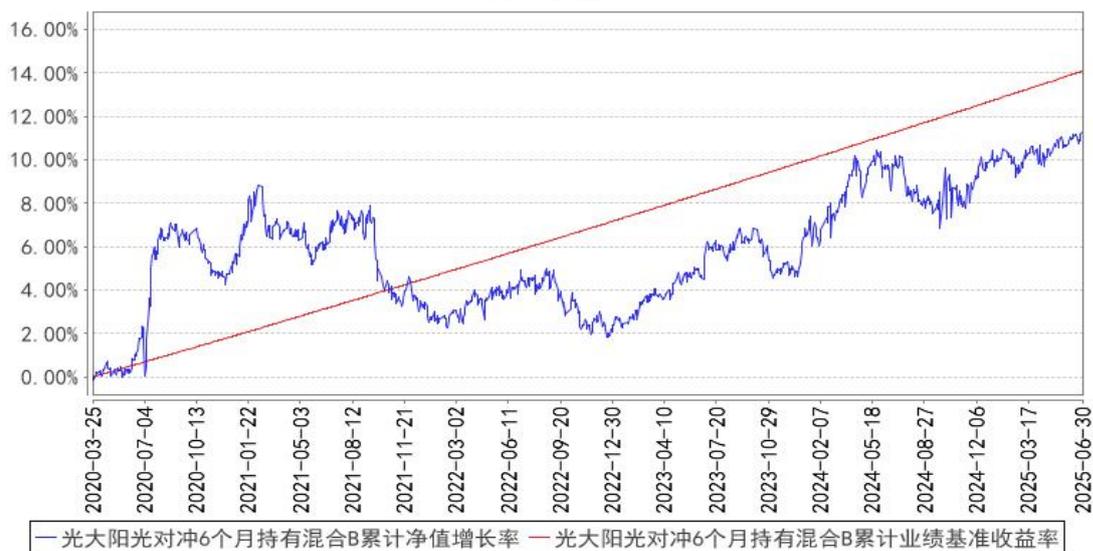
3、B 类、C 类份额设立日均为 2020 年 3 月 25 日。

### 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



### 3.3 其他指标

无。

## § 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，承继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 2025 年 6 月末，本公司共管理 13 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		
陈韵聘	本集合计划投资经	2023 年 3 月 17 日	-	14 年	陈韵聘先生，博士学位，本硕博均毕业于上海交通大学，曾任海通证券研究所分析

	理				师，2015 年加入光证资管，历任研究员、投资经理助理，现任混合资产公募投资部投资经理，担任光大阳光对冲策略 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；

#### 4.1.3 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

本集合计划本报告期末投资经理无兼任私募资产管理计划的情况。

#### 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，上海光大证券资产管理有限公司作为本集合计划管理人，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、计划合同以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用计划资产，为集合计划份额持有人谋求最大利益，无损害集合计划持有人利益的行为，本集合计划投资组合符合有关法规及合同的约定。

#### 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，制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》。

##### 4.3.2 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

在中美关税战的影响下，上半年 A 股市场走出了先抑后扬的行情。在关税战逐步升级的过程中，A 股出现普遍调整，其中成长板块承受较大压力。此后随着中美关税博弈展开，市场对关税影响的负面预期逐渐消化，主要指数陆续修复，创成长紧随其后，转债市场表现相对活跃。整体来看，今年上半年小微盘股表现强劲；成长相对强于价值，高分红板块表现疲软；行业层面。受

益于政策支持及景气度改善的领域表现相对突出，而受宏观经济影响较大的板块则走势相对平淡。

本产品由于使用股指期货套保账户进行对冲操作，有效降低市场本身波动对产品净值影响；同时选股策略使用成分股选股。上半年对策略超额收益影响较大的是市场风险偏好相比去年有大幅提升，价值类策略表现低于预期而价量类策略表现高于预期。策略表现的分化给策略管理带来一定的难度，但总体上还是保持了较好的风险调整后收益表现。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 6 月 30 日，光大阳光对冲策略 6 个月持有混合 A 类份额净值为 1.1093 元，本报告期份额净值增长率为 1.10%；光大阳光对冲策略 6 个月持有混合 B 类份额净值为 1.1133 元，本报告期份额净值增长率为 1.26%；光大阳光对冲策略 6 个月持有混合 C 类份额净值为 1.0904 元，本报告期份额净值增长率为 1.06%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，上半年我国经济面对外部环境承压实现 5.3% 增长，显著超出预期，7 月底政治局会议判断我国主要经济指标表现良好，展现较强的活力与韧性。随后公布的 7 月官方制造业 PMI 回落至 49.3%，供需同步走弱，需求下行更多，内需弱于外需，小型企业景气度下行较为明显。当前宏观经济数据不弱，但存量政策仍或需要积极发力，下半年相对宽松的流动性环境和偏向积极的宏观政策应当仍会维持。

今年 A 股日均成交活跃，即使在关税战最激烈的阶段，A 股成交也维持在万亿以上。从历史规律来看，A 股的风险偏好呈现周期轮动特征。下半年成长风格可能继续维持，我们会始终紧跟市场变化，坚持长期投资理念的同时，灵活应对短期市场波动。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本集合计划管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和集合计划合同的约定，对集合计划所持有的投资品种进行估值，本集合计划托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。集合计划份额净值由集合计划管理人完成估值后，经集合计划托管人复核无误后由集合计划管理人对外公布。本集合计划管理人对投资品种进行估值时原则上应保持估值程序和技术的一致性，对旗下管理的不同产品持有的具有相同特征的同一投资品种的估值调整原则、程序及技术应当一致（中国证监会规定的特殊品种除外）。为了保障集合计划能真实、准确地反映投资品种的公允价值，本集合计划管理人授权估值委员会负责建立健全估值决策体系，估值委员会成员的任命和调整由总经理办公会审议决定。运营部是估值委员会的日常办事机构，负责关注相关投资品种的动态，确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种，

并提交估值委员会审议。运营部的估值人员均具有专业会计学习经历，具有基金从业人员资格。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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“本基金”）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、基金合同和托管协议的有关规定，不存在任何损害基金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、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作方面进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 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：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	3,287,330.21	6,506,129.20
结算备付金		4,581,401.09	6,920,644.42
存出保证金		8,141,414.21	10,363,163.67

交易性金融资产	6.4.7.2	90,359,623.72	116,260,331.60
其中：股票投资		72,377,186.24	91,800,469.28
基金投资		-	-
债券投资		17,982,437.48	24,459,862.32
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	3,000,000.00	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		1,704,377.60	233,724.73
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		111,074,146.83	140,283,993.62
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025年6月30日</b>	<b>上年度末 2024年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		2,143,118.06	71,225.26
应付赎回款		197,882.15	899,198.68
应付管理人报酬		89,962.07	121,419.51
应付托管费		17,929.27	24,123.17
应付销售服务费		32,815.39	44,927.91
应付投资顾问费		-	-
应交税费		22,645.17	568.90
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	944,051.96	674,439.36
负债合计		3,448,404.07	1,835,902.79
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	98,536,057.93	128,140,332.47
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	9,089,684.83	10,307,758.36
净资产合计		107,625,742.76	138,448,090.83

负债和净资产总计		111,074,146.83	140,283,993.62
----------	--	----------------	----------------

注：报告截止日2025年6月30日，集合计划份额总额98,536,057.93份。光大阳光对冲6个月持有A集合计划份额净值1.1093元，集合计划份额1,735,960.73份，集合计划资产净值1,925,642.99元。光大阳光对冲6个月持有B集合计划份额净值1.1133元，集合计划份额6,603,602.70份，集合计划资产净值7,351,511.44元。光大阳光对冲6个月持有C集合计划份额净值1.0904元，集合计划份额90,196,494.50份，集合计划资产净值98,348,588.33元。

## 6.2 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：2025年1月1日至2025年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年1月1日至2025 年6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 6月30日
<b>一、营业总收入</b>		2,276,375.52	9,889,744.41
1. 利息收入		95,742.67	229,725.97
其中：存款利息收入	6.4.7.13	50,584.30	93,269.62
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		45,158.37	136,456.35
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,440,585.10	10,587,737.43
其中：股票投资收益	6.4.7.14	473,773.79	878,101.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	390,432.35	-300,885.06
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	1,672,721.61	8,550,820.77
股利收益	6.4.7.19	903,657.35	1,459,700.41
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-1,259,952.25	-927,718.99
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 21	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		1,067,972.79	1,664,922.58
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	597,987.85	979,396.77
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	119,027.73	194,656.34
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	219,642.11	351,158.83
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		11,331.34	45,526.04
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	119,983.76	94,184.60
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,208,402.73	8,224,821.83
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,208,402.73	8,224,821.83
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		1,208,402.73	8,224,821.83

### 6.3 净资产变动表

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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	128,140,332.47	-	10,307,758.36	138,448,090.83
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	128,140,332.47	-	10,307,758.36	138,448,090.83
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-29,604,274.54	-	-1,218,073.53	-30,822,348.07
（一）、综合收益	-	-	1,208,402.73	1,208,402.73

总额				
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-29,604,274.54	-	-2,426,476.26	-32,030,750.80
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-29,604,274.54	-	-2,426,476.26	-32,030,750.80
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	98,536,057.93	-	9,089,684.83	107,625,742.76
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	224,324,222.60	-	8,850,579.06	233,174,801.66
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	224,324,222.60	-	8,850,579.06	233,174,801.66
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-56,054,086.59	-	4,697,062.90	-51,357,023.69
(一)、综合收益总额	-	-	8,224,821.83	8,224,821.83
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-56,054,086.59	-	-3,527,758.93	-59,581,845.52

其中：1. 基金申购款	24,388,575.41	-	1,942,648.63	26,331,224.04
2. 基金赎回款	-80,442,662.00	-	-5,470,407.56	-85,913,069.56
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	168,270,136.01	-	13,547,641.96	181,817,777.97

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>乔震</u>	<u>詹朋</u>	<u>杨薇</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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。存续期至 2025 年 11 月 30 日，本集合计划自 2025 年 11 月 30 日后，按照中国证监会的有关规定执行。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%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本集合资产管理计划财务报表以持续经营为基础编制。本集合资产管理计划财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合资产管理计划财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本集合资

产管理计划 2025 年 6 月 30 日的财务状况、2025 半年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本集合计划本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本集合资产管理计划在本报告期内未发生重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合资产管理计划在本报告期内未发生重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本集合资产管理计划在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

如 6.4.1 集合资产管理计划基本情况所述，本集合资产管理计划已遵照公开募集证券投资基金相关法律、行政法规及中国证监会的规定管理运作。本集合资产管理计划目前比照证券投资基金的相关税务法规进行税务处理。如果日后涉及本集合资产管理计划的有关税收法规颁布，本集合资产管理计划的税务处理可能会根据日后出台的相关税务法规而作出调整。根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《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 号文《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 号文《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》、中投信〔2021〕20 号《关于香港联合交易所有限公司上调

股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告2019年第93号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部税务总局公告2023年第2号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部税务总局中国证监会公告2023年第23号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税〔2014〕81号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税〔2023〕39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本集合资产管理计划适用的主要税项列示如下：

a) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

集合资产管理计划管理人运用集合资产管理计划买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对投资者从集合资产管理计划分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对集合资产管理计划从中国内地证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、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。

c) 对集合资产管理计划从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。对集合资产管理计划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。

对集合资产管理计划取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向集合资产管理计划支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得

税。对内地集合资产管理计划通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过集合资产管理计划互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

d) 集合资产管理计划卖出股票按 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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。对于集合资产管理计划通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

e) 对集合资产管理计划运营过程中缴纳的增值税，分别按照集合资产管理计划管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	3,287,330.21
等于：本金	3,286,824.31
加：应计利息	505.90
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	3,287,330.21

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	70,965,764.88	-	72,377,186.24	1,411,421.36

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	17,479,071.57	94,507.52	17,982,437.48
	银行间市场	-	-	-
	合计	17,479,071.57	94,507.52	17,982,437.48
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	88,444,836.45	94,507.52	90,359,623.72	1,820,279.75

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日			备注
	合同/名义 金额	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	-65,190,975.22	-	-	-
其中：股指期货投资	-65,190,975.22	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-65,190,975.22	-	-	-

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。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2507	IC2507	-2.00	-2,346,960.00	-21,200.00
IF2509	IF2509	-51.00	-59,471,100.00	-1,580,444.78
IM2507	IM2507	-4.00	-5,031,520.00	-56,960.00
合计				-1,658,604.78

减：可抵销期货 暂收款				-1,658,604.78
净额				-

### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本集合计划本报告期末未持有黄金衍生品。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	3,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	3,000,000.00	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本集合计划本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。
----

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

本集合计划本报告期末未持有债权投资。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本集合计划本报告期末未持有债权投资。

### 6.4.7.6 其他债权投资

#### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本集合计划本报告期末未持有其他债权投资。

#### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本集合计划本报告期末未持有其他债权投资。

### 6.4.7.7 其他权益工具投资

#### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本集合计划本报告期末未持有其他权益工具投资。

#### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本集合计划本报告期末未持有其他权益工具投资。

#### 6.4.7.8 其他资产

本集合计划本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	869,668.20
其中：交易所市场	869,668.20
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	74,383.76
合计	944,051.96

#### 6.4.7.10 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,735,960.73	1,735,960.73
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	1,735,960.73	1,735,960.73

光大阳光对冲 6 个月持有混合 B

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,215,497.98	7,215,497.98
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-611,895.28	-611,895.28
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	6,603,602.70	6,603,602.70

光大阳光对冲 6 个月持有混合 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	119,188,873.76	119,188,873.76
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-28,992,379.26	-28,992,379.26
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	90,196,494.50	90,196,494.50

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

本集合计划本报告期无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 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
上年度末	610,508.08	-441,813.07	168,695.01
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	610,508.08	-441,813.07	168,695.01
本期利润	41,764.18	-20,776.93	20,987.25
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	652,272.26	-462,590.00	189,682.26

##### 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
上年度末	1,186,499.98	-468,691.46	717,808.52
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,186,499.98	-468,691.46	717,808.52
本期利润	171,350.06	-79,596.62	91,753.44
本期基金份额交易产生的变动数	-64,038.85	2,385.63	-61,653.22
其中：基金申购款	-	-	-

基金赎回款	-64,038.85	2,385.63	-61,653.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,293,811.19	-545,902.45	747,908.74

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
上年度末	11,040,428.86	-1,619,174.03	9,421,254.83
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	11,040,428.86	-1,619,174.03	9,421,254.83
本期利润	2,255,240.74	-1,159,578.70	1,095,662.04
本期基金份额交易产生的变动数	-2,823,720.03	458,896.99	-2,364,823.04
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-2,823,720.03	458,896.99	-2,364,823.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,471,949.57	-2,319,855.74	8,152,093.83

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	20,485.07
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	29,837.17
其他	262.06
合计	50,584.30

注：其他为交易所结算保证金利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	473,773.79
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	473,773.79

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	509,917,594.23
减：卖出股票成本总额	508,779,757.60
减：交易费用	664,062.84
买卖股票差价收入	473,773.79

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

#### 6.4.7.14.3 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。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	201,481.89
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	188,950.46
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	390,432.35

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	116,851,979.23
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	115,832,892.75
减：应计利息总额	821,613.77
减：交易费用	8,522.25
买卖债券差价收入	188,950.46

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

##### 6.4.7.15.3 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。

##### 6.4.7.15.4 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。

**6.4.7.16 资产支持证券投资收益**

**6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本集合计划本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

本集合计划本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

**6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

本集合计划本报告期无资产支持证券赎回差价收入。

**6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

本集合计划本报告期无资产支持证券申购差价收入。

**6.4.7.17 贵金属投资收益**

**6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

本集合计划本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本集合计划本报告期无买卖贵金属差价收入。

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本集合计划本报告期无贵金属赎回差价收入。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本集合计划本报告期无贵金属申购差价收入。

**6.4.7.18 衍生工具收益**

**6.4.7.18.1 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。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	1,723,410.58

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	903,657.35
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	903,657.35
----	------------

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,952,944.35
股票投资	1,678,562.62
债券投资	274,381.73
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-3,207,622.56
权证投资	-
期货投资	-3,207,622.56
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	5,274.04
合计	-1,259,952.25

#### 6.4.7.21 其他收入

本集合计划本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

本集合计划本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	15,600.00
律师费	30,000.00
合计	119,983.76

#### 6.4.7.24 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 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。

#### 6.4.8.2 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。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期本集合计划存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、集合计划代销机构
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	集合计划销售机构、集合计划管理人的股东
光大期货有限公司（“光大期货”）	受本集合资产管理计划管理人股东控制的公司

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
光大证券	997,595,506.17	100.00	1,795,208,230.13	100.00

###### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)
光大证券	216,311,077.14	100.00	471,002,153.50	100.00

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日

	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例 (%)
光大证券	727,000,000.00	100.00	1,408,800,000.00	100.00

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本集合计划本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30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	345,228.84	100.00	869,668.20	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30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	621,088.41	100.00	1,000,327.25	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。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6 月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	597,987.85
其中：应支付销售机构的客户维护 费	297,120.06	478,744.62
应支付基金管理人的净管理费	300,867.79	500,652.15

注：1. 支付集合资产管理计划管理人光证资管集合资产管理计划管理费按前一日集合资产管理计划资产净值一定比例的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

光大阳光对冲 6 个月持有混合 A 日集合资产管理计划管理费=前一日光大阳光对冲 6 个月持有混合 A 集合资产管理计划资产净值×1.20%/当年天数。

光大阳光对冲 6 个月持有混合 B 日集合资产管理计划管理费=前一日光大阳光对冲 6 个月持有混合 B 集合资产管理计划资产净值×1.00%/当年天数。

光大阳光对冲 6 个月持有混合 C 日集合资产管理计划管理费=前一日光大阳光对冲 6 个月持有混合 C 集合资产管理计划资产净值×1.00%/当年天数。

2. 本集合资产管理计划的业绩报酬按照合同约定的费率和计算方法进行确认。

根据 2025 年 6 月 30 日的业绩表现和约定的业绩报酬计算方法，如果假设于 2025 年 6 月 30 日支付管理人业绩报酬，其暂估业绩报酬金额为 0.00 元，但由于本集合资产管理计划主要投资于股票，业绩波动较大，该暂估金额仅供参考，与实际需要产品持有人承担的业绩报酬可能存在差异，且该金额并未反映在本年度损益中。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	119,027.73	194,656.34

注：支付集合资产管理计划托管人广发银行的集合资产管理计划托管费按前一日集合资产管理计划资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日集合资产管理计划托管费=前一日集合资产管理计划资产净值×0.20%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 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			
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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
光大证券	-	-	404.33	404.33
光证资管	-	-	1.80	1.80
合计	-	-	406.13	406.13
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间			
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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

光大证券	-	-	515.13	515.13
光证资管	-	-	1.82	1.82
合计	-	-	516.95	516.95

注：光大阳光对冲 6 个月持有混合 A 和光大阳光对冲 6 个月持有混合 B 不收取销售服务费，光大阳光对冲 6 个月持有混合 C 支付销售机构的集合资产管理计划销售服务费按前一日光大阳光对冲 6 个月持有混合 C 集合资产管理计划资产净值的一定比例计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：光大阳光对冲 6 个月持有混合 C 日集合资产管理计划销售服务费=前一日光大阳光对冲 6 个月持有混合 C 份额集合资产管理计划资产净值×0.40%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本集合计划本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 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

##### 6.4.10.4.1 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

本集合计划本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 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

本集合计划本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间管理人未运用固有资金投资本集合计划。

##### 6.4.10.5.2 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

本报告期末及上年度末除管理人之外的其他关联方未投资本集合计划。

#### 6.4.10.6 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发银行股份有限公司	3,287,330.21	20,485.07	3,664,825.51	23,602.68

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

**6.4.10.7 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及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本集合计划本报告期无其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

本集合计划本报告期末未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2025年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
603072	天和磁材	2024年12月24日	6个月	新股流通受限	12.30	54.45	103	1,266.90	5,608.35	-

注：1、集合资产管理计划可使用以集合资产管理计划名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中集合资产管理计划参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；集合资产管理计划参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、集合资产管理计划参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。

3、集合资产管理计划通过询价转让受让的科创板股份，在受让后6个月内不得转让。

**6.4.12.2 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。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本集合计划本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本集合计划本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

**6.4.12.4 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未持有参与转融通证券出借业务的证券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合资产管理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。

本集合资产管理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，根据本集合资产管理计划的投资目标，结合集合资产管理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。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指集合资产管理计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者集合资产管理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，导致集合资产管理计划资产损失和收益变化的风险。

本集合资产管理计划的管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本集合资产管理计划的货币资金存放在本集合资产管理计划的托管人开立的托管账户或其他大中型商业银行开立的存款账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。

本集合资产管理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。

本集合资产管理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。

本集合资产管理计划债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	7,030,851.78	-
合计	7,030,851.78	-

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。未评级中包含国债。

#### 6.4.13.2.2 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及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 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及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
AAA	4,276,561.89	2,644,798.11
AAA 以下	6,675,023.81	11,606,721.74
未评级	-	10,208,342.47
合计	10,951,585.70	24,459,862.32

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 6.4.13.2.5 按长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及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 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及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指集合资产管理计划管理人未能以合理价格及时变现集合资产管理计划资产以支付投资者赎回款项的风险。本集合资产管理计划的流动性风险一方面来自于集合资产管理计划

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。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合资产管理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资产管理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。

本集合资产管理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 6.4.12“期末本基金持有的流通受限证券”，本报告期内本集合资产管理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。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指集合资产管理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。

##### 6.4.13.4.1 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。

本集合资产管理计划的管理人定期对本集合资产管理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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,287,330.21	-	-	-	3,287,330.21
结算备付金	4,581,401.09	-	-	-	4,581,401.09
存出保证金	8,141,414.21	-	-	-	8,141,414.21

交易性金融资产	9,754,374.28	8,228,063.20	-	72,377,186.24	90,359,623.72
买入返售金融资产	3,000,000.00	-	-	-	3,000,000.00
应收清算款	-	-	-	1,704,377.60	1,704,377.60
资产总计	28,764,519.79	8,228,063.20	-	74,081,563.84	111,074,146.83
负债					
应付赎回款	-	-	-	197,882.15	197,882.15
应付管理人报酬	-	-	-	89,962.07	89,962.07
应付托管费	-	-	-	17,929.27	17,929.27
应付清算款	-	-	-	2,143,118.06	2,143,118.06
应付销售服务费	-	-	-	32,815.39	32,815.39
应交税费	-	-	-	22,645.17	22,645.17
其他负债	-	-	-	944,051.96	944,051.96
负债总计	-	-	-	3,448,404.07	3,448,404.07
利率敏感度缺口	28,764,519.79	8,228,063.20	-	70,633,159.77	107,625,742.76
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	6,506,129.20	-	-	-	6,506,129.20
结算备付金	6,920,644.42	-	-	-	6,920,644.42
存出保证金	10,363,163.67	-	-	-	10,363,163.67
交易性金融资产	11,873,842.18	12,586,020.14	-	91,800,469.28	116,260,331.60
应收清算款	-	-	-	233,724.73	233,724.73
资产总计	35,663,779.47	12,586,020.14	-	92,034,194.01	140,283,993.62
负债					
应付赎回款	-	-	-	899,198.68	899,198.68
应付管理人报酬	-	-	-	121,419.51	121,419.51
应付托管费	-	-	-	24,123.17	24,123.17
应付清算款	-	-	-	71,225.26	71,225.26
应付销售服务费	-	-	-	44,927.91	44,927.91
应交税费	-	-	-	568.90	568.90
其他负债	-	-	-	674,439.36	674,439.36
负债总计	-	-	-	1,835,902.79	1,835,902.79
利率敏感度缺口	35,663,779.47	12,586,020.14	-	90,198,291.22	138,448,090.83

注：表中所示为本集合计划资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 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		
分析	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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）

市场利率下降 25 个基点	9,458.25	11,203.66
市场利率上升 25 个基点	-9,458.25	-11,203.66

#### 6.4.13.4.2 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。本集合资产管理计划的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

本集合计划本报告期末及上年度末无外汇风险敞口。

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

本集合计划本报告期末及上年度末不存在外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是集合资产管理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。本集合资产管理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。

本集合资产管理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资产管理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资产管理计划进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日		上年度末 2024年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	72,377,186.24	67.25	91,800,469.28	66.31
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	72,377,186.24	67.25	91,800,469.28	66.31

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	3,980,024.32	4,730,560.58
沪深 300 指数下降 5%	-3,980,024.32	-4,730,560.58	

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本集合计划本报告期末及上年度无采用风险价值法管理的风险。

### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	82,310,707.56	104,908,948.02
第二层次	8,043,307.81	11,342,957.10
第三层次	5,608.35	8,426.48

合计	90,359,623.72	116,260,331.60
----	---------------	----------------

#### 6.4.14.2.2 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。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本集合计划不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本集合计划本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本集合计划持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	72,377,186.24	65.16
	其中：股票	72,377,186.24	65.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	17,982,437.48	16.19
	其中：债券	17,982,437.48	16.19
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	3,000,000.00	2.70
	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	7,868,731.30	7.08
8	其他各项资产	9,845,791.81	8.86
9	合计	111,074,146.83	100.00

注：本集合计划本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 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	209,949.00	0.20
B	采矿业	3,711,384.50	3.45
C	制造业	37,499,835.20	34.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,495,657.00	3.25
E	建筑业	2,467,751.00	2.29
F	批发和零售业	1,320,607.00	1.23
G	交通运输、仓储和邮政业	2,961,737.00	2.75
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,254,229.08	3.02
J	金融业	14,071,965.19	13.07
K	房地产业	404,968.00	0.38
L	租赁和商务服务业	411,012.00	0.38
M	科学研究和技术服务业	1,389,421.00	1.29
N	水利、环境和公共设施管理业	140,670.00	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	254,512.27	0.24
R	文化、体育和娱乐业	783,488.00	0.73
S	综合	-	-
	合计	72,377,186.24	67.25

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

## 7.3 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	1,819	2,563,916.88	2.38
2	300750	宁德时代	8,089	2,040,207.58	1.90
3	600036	招商银行	41,109	1,888,958.55	1.76
4	601318	中国平安	28,526	1,582,622.48	1.47
5	000333	美的集团	21,400	1,545,080.00	1.44
6	601899	紫金矿业	73,729	1,437,715.50	1.34
7	601166	兴业银行	55,000	1,283,700.00	1.19
8	600900	长江电力	39,900	1,202,586.00	1.12
9	601668	中国建筑	190,500	1,099,185.00	1.02

10	603259	药明康德	12,700	883,285.00	0.82
11	601211	国泰海通	45,176	865,572.16	0.80
12	688041	海光信息	5,800	819,482.00	0.76
13	601398	工商银行	105,700	802,263.00	0.75
14	002594	比亚迪	2,400	796,584.00	0.74
15	601919	中远海控	51,600	776,064.00	0.72
16	601766	中国中车	108,500	763,840.00	0.71
17	601138	工业富联	34,862	745,349.56	0.69
18	000001	平安银行	58,900	710,923.00	0.66
19	002475	立讯精密	19,800	686,862.00	0.64
20	600000	浦发银行	48,500	673,180.00	0.63
21	601857	中国石油	75,100	642,105.00	0.60
22	600031	三一重工	33,900	608,505.00	0.57
23	300274	阳光电源	8,400	569,268.00	0.53
24	600219	南山铝业	146,000	559,180.00	0.52
25	601186	中国铁建	66,000	528,660.00	0.49
26	600030	中信证券	18,500	510,970.00	0.47
27	600018	上港集团	85,900	490,489.00	0.46
28	600104	上汽集团	29,900	479,895.00	0.45
29	002241	歌尔股份	20,300	473,396.00	0.44
30	601288	农业银行	80,200	471,576.00	0.44
31	002701	奥瑞金	77,300	459,935.00	0.43
32	600690	海尔智家	18,400	455,952.00	0.42
33	600660	福耀玻璃	7,400	421,874.00	0.39
34	601618	中国中冶	141,100	420,478.00	0.39
35	002215	诺普信	39,800	411,134.00	0.38
36	300442	润泽科技	8,300	411,099.00	0.38
37	600015	华夏银行	51,500	407,365.00	0.38
38	601319	中国人保	46,700	406,757.00	0.38
39	000975	山金国际	21,400	405,316.00	0.38
40	601658	邮储银行	73,300	400,951.00	0.37
41	601061	中信金属	50,600	400,246.00	0.37
42	300433	蓝思科技	17,700	394,710.00	0.37
43	002517	恺英网络	20,200	390,062.00	0.36
44	601816	京沪高铁	66,900	384,675.00	0.36
45	300476	胜宏科技	2,800	376,264.00	0.35
46	000651	格力电器	8,300	372,836.00	0.35
47	601066	中信建投	15,500	372,775.00	0.35
48	603288	海天味业	9,400	365,754.00	0.34
49	300999	金龙鱼	12,200	360,266.00	0.33
50	300059	东方财富	15,100	349,263.00	0.32
51	000030	富奥股份	59,100	348,099.00	0.32
52	600085	同仁堂	9,600	346,176.00	0.32

53	600166	福田汽车	126,800	343,628.00	0.32
54	300124	汇川技术	5,300	342,221.00	0.32
55	600578	京能电力	75,800	340,342.00	0.32
56	600025	华能水电	35,200	336,160.00	0.31
57	688172	燕东微	17,000	334,220.00	0.31
58	600016	民生银行	69,300	329,175.00	0.31
59	600011	华能国际	45,900	327,726.00	0.30
60	300140	节能环境	52,300	322,691.00	0.30
61	600020	中原高速	67,200	321,216.00	0.30
62	600866	星湖科技	46,200	319,242.00	0.30
63	601991	大唐发电	99,700	316,049.00	0.29
64	301376	致欧科技	17,000	310,250.00	0.29
65	600887	伊利股份	11,100	309,468.00	0.29
66	300502	新易盛	2,400	304,848.00	0.28
67	600398	海澜之家	43,600	303,456.00	0.28
68	600919	江苏银行	24,900	297,306.00	0.28
69	002142	宁波银行	10,700	292,752.00	0.27
70	600295	鄂尔多斯	33,100	288,301.00	0.27
71	601728	中国电信	36,200	280,550.00	0.26
72	300119	瑞普生物	14,300	277,706.00	0.26
73	000858	五粮液	2,300	273,470.00	0.25
74	600941	中国移动	2,400	270,120.00	0.25
75	002050	三花智控	10,200	269,076.00	0.25
76	601916	浙商银行	76,400	258,996.00	0.24
77	600905	三峡能源	60,100	256,026.00	0.24
78	600089	特变电工	21,400	255,302.00	0.24
79	300015	爱尔眼科	20,200	252,096.00	0.23
80	600028	中国石化	43,700	246,468.00	0.23
81	601988	中国银行	43,800	246,156.00	0.23
82	002352	顺丰控股	4,900	238,924.00	0.22
83	600019	宝钢股份	35,900	236,581.00	0.22
84	600507	方大特钢	54,100	234,794.00	0.22
85	002463	沪电股份	5,500	234,190.00	0.22
86	002004	华邦健康	55,800	232,686.00	0.22
87	002317	众生药业	15,500	232,655.00	0.22
88	601939	建设银行	24,600	232,224.00	0.22
89	600179	安通控股	84,100	232,116.00	0.22
90	600861	北京人力	12,000	231,600.00	0.22
91	300432	富临精工	17,700	231,339.00	0.21
92	000688	国城矿业	17,300	230,263.00	0.21
93	301171	易点天下	8,600	229,878.00	0.21
94	601568	北元集团	55,100	228,665.00	0.21
95	002489	浙江永强	62,400	228,384.00	0.21

96	601169	北京银行	33,400	228,122.00	0.21
97	301297	富乐德	5,500	227,315.00	0.21
98	600739	辽宁成大	20,600	226,600.00	0.21
99	301327	华宝新能	4,400	225,984.00	0.21
100	300768	迪普科技	13,100	224,665.00	0.21
101	300014	亿纬锂能	4,900	224,469.00	0.21
102	601009	南京银行	19,100	221,942.00	0.21
103	002600	领益智造	25,800	221,622.00	0.21
104	688209	英集芯	11,900	219,793.00	0.20
105	600176	中国巨石	19,100	217,740.00	0.20
106	601801	皖新传媒	31,800	217,194.00	0.20
107	601600	中国铝业	30,500	214,720.00	0.20
108	603327	福蓉科技	22,910	211,917.50	0.20
109	601311	骆驼股份	22,900	206,787.00	0.19
110	000708	中信特钢	17,300	203,448.00	0.19
111	301165	锐捷网络	3,300	202,818.00	0.19
112	300496	中科创达	3,500	200,270.00	0.19
113	600938	中国海油	7,500	195,825.00	0.18
114	300393	中来股份	33,500	192,960.00	0.18
115	301526	国际复材	51,900	188,916.00	0.18
116	300251	光线传媒	9,200	186,484.00	0.17
117	600338	西藏珠峰	16,700	185,203.00	0.17
118	002048	宁波华翔	10,000	184,100.00	0.17
119	601126	四方股份	11,300	183,851.00	0.17
120	301377	鼎泰高科	5,100	183,396.00	0.17
121	600664	哈药股份	49,700	182,896.00	0.17
122	002079	苏州固锟	18,700	182,325.00	0.17
123	603612	索通发展	9,900	181,962.00	0.17
124	600531	豫光金铅	23,500	181,890.00	0.17
125	000657	中钨高新	15,300	181,458.00	0.17
126	002516	旷达科技	35,200	181,280.00	0.17
127	603993	洛阳钼业	21,500	181,030.00	0.17
128	600073	光明肉业	24,500	180,810.00	0.17
129	002913	奥士康	6,100	179,401.00	0.17
130	601619	嘉泽新能	49,900	178,642.00	0.17
131	688728	格科微	11,500	177,100.00	0.16
132	301215	中汽股份	28,500	176,700.00	0.16
133	600012	皖通高速	10,400	176,592.00	0.16
134	600276	恒瑞医药	3,400	176,460.00	0.16
135	300738	奥飞数据	8,400	175,812.00	0.16
136	601881	中国银河	10,200	174,930.00	0.16
137	600009	上海机场	5,500	174,735.00	0.16
138	002624	完美世界	11,400	172,938.00	0.16

139	002736	国信证券	14,700	169,344.00	0.16
140	002714	牧原股份	3,900	163,839.00	0.15
141	000895	双汇发展	6,700	163,547.00	0.15
142	000630	铜陵有色	48,600	162,324.00	0.15
143	600780	通宝能源	27,300	161,889.00	0.15
144	600362	江西铜业	6,900	161,667.00	0.15
145	600027	华电国际	28,900	158,083.00	0.15
146	300628	亿联网络	4,500	156,420.00	0.15
147	688009	中国通号	29,700	152,658.00	0.14
148	600050	中国联通	28,100	150,054.00	0.14
149	601669	中国电建	30,700	149,509.00	0.14
150	300363	博腾股份	8,700	148,596.00	0.14
151	000623	吉林敖东	8,700	147,465.00	0.14
152	002314	南山控股	55,700	146,491.00	0.14
153	603236	移远通信	1,700	145,860.00	0.14
154	601216	君正集团	26,400	145,728.00	0.14
155	000729	燕京啤酒	11,100	143,523.00	0.13
156	600582	天地科技	23,800	142,562.00	0.13
157	600925	苏能股份	27,200	142,256.00	0.13
158	688007	光峰科技	9,800	141,708.00	0.13
159	688432	有研硅	12,800	141,312.00	0.13
160	300183	东软载波	8,400	141,204.00	0.13
161	600499	科达制造	14,400	141,120.00	0.13
162	601997	贵阳银行	22,600	141,024.00	0.13
163	600663	陆家嘴	15,900	140,874.00	0.13
164	600475	华光环能	13,500	140,670.00	0.13
165	600096	云天化	6,400	140,608.00	0.13
166	002851	麦格米特	2,800	140,392.00	0.13
167	600320	振华重工	31,500	137,655.00	0.13
168	601128	常熟银行	18,500	136,345.00	0.13
169	300232	洲明科技	18,400	133,216.00	0.12
170	002668	TCL智家	13,600	132,872.00	0.12
171	600517	国网英大	26,000	132,600.00	0.12
172	002739	万达电影	11,600	132,588.00	0.12
173	600502	安徽建工	28,200	132,540.00	0.12
174	600063	皖维高新	28,800	131,904.00	0.12
175	002706	良信股份	14,800	131,868.00	0.12
176	300308	中际旭创	900	131,274.00	0.12
177	000157	中联重科	17,700	127,971.00	0.12
178	603636	南威软件	9,900	125,136.00	0.12
179	688981	中芯国际	1,400	123,438.00	0.11
180	601328	交通银行	14,500	116,000.00	0.11
181	002001	新和成	5,400	114,858.00	0.11

182	300627	华测导航	3,280	114,800.00	0.11
183	300760	迈瑞医疗	500	112,375.00	0.10
184	603766	隆鑫通用	8,200	104,632.00	0.10
185	688608	恒玄科技	300	104,394.00	0.10
186	002174	游族网络	8,400	101,892.00	0.09
187	601678	滨化股份	24,400	101,016.00	0.09
188	601900	南方传媒	6,300	98,532.00	0.09
189	600704	物产中大	18,400	96,968.00	0.09
190	600163	中闽能源	18,400	94,208.00	0.09
191	603019	中科曙光	1,300	91,520.00	0.09
192	000063	中兴通讯	2,800	90,972.00	0.08
193	002649	博彦科技	6,000	87,180.00	0.08
194	000977	浪潮信息	1,700	86,496.00	0.08
195	600057	厦门象屿	12,000	84,360.00	0.08
196	600757	长江传媒	9,000	83,520.00	0.08
197	000100	TCL科技	19,000	82,270.00	0.08
198	600998	九州通	14,800	76,072.00	0.07
199	002745	木林森	9,600	75,648.00	0.07
200	601555	东吴证券	8,600	75,250.00	0.07
201	688008	澜起科技	900	73,800.00	0.07
202	000902	新洋丰	5,300	73,299.00	0.07
203	000600	建投能源	10,600	73,246.00	0.07
204	002597	金禾实业	3,000	70,650.00	0.07
205	002249	大洋电机	10,700	70,406.00	0.07
206	002311	海大集团	1,200	70,308.00	0.07
207	000528	柳工	7,300	70,153.00	0.07
208	601717	中创智领	4,200	69,804.00	0.06
209	000938	紫光股份	2,900	69,571.00	0.06
210	000928	中钢国际	11,000	69,080.00	0.06
211	002761	浙江建投	7,700	68,299.00	0.06
212	300548	长芯博创	1,000	66,770.00	0.06
213	600873	梅花生物	6,200	66,278.00	0.06
214	603368	柳药集团	3,900	65,949.00	0.06
215	000725	京东方A	16,500	65,835.00	0.06
216	002487	大金重工	2,000	65,800.00	0.06
217	600867	通化东宝	7,900	64,780.00	0.06
218	300115	长盈精密	3,000	64,200.00	0.06
219	002466	天齐锂业	2,000	64,080.00	0.06
220	000768	中航西飞	2,300	62,882.00	0.06
221	001696	宗申动力	2,800	62,860.00	0.06
222	601877	正泰电器	2,600	58,942.00	0.05
223	301580	爱迪特	1,408	58,333.44	0.05
224	600332	白云山	2,200	57,992.00	0.05

225	600061	国投资本	7,600	57,152.00	0.05
226	600875	东方电气	3,400	56,916.00	0.05
227	603072	天和磁材	1,024	56,143.62	0.05
228	603806	福斯特	4,300	55,728.00	0.05
229	688100	威胜信息	1,500	55,575.00	0.05
230	688208	道通科技	1,800	55,080.00	0.05
231	600999	招商证券	3,100	54,529.00	0.05
232	600595	中孚实业	12,300	53,874.00	0.05
233	301511	德福科技	2,600	53,820.00	0.05
234	002154	报喜鸟	14,300	53,768.00	0.05
235	688131	皓元医药	1,100	53,185.00	0.05
236	688088	虹软科技	1,100	53,075.00	0.05
237	300031	宝通科技	2,100	52,563.00	0.05
238	600771	广誉远	2,600	52,416.00	0.05
239	601963	重庆银行	4,800	52,128.00	0.05
240	600267	海正药业	5,600	51,800.00	0.05
241	600216	浙江医药	3,500	51,765.00	0.05
242	300685	艾德生物	2,400	51,672.00	0.05
243	300456	赛微电子	3,000	51,570.00	0.05
244	300634	彩讯股份	1,900	51,490.00	0.05
245	300026	红日药业	13,900	51,291.00	0.05
246	688522	纳睿雷达	1,000	51,220.00	0.05
247	688270	臻镭科技	1,100	51,216.00	0.05
248	600729	重庆百货	1,700	50,711.00	0.05
249	600635	大众公用	13,000	50,700.00	0.05
250	688690	纳微科技	2,200	50,226.00	0.05
251	605376	博迁新材	1,300	49,829.00	0.05
252	601636	旗滨集团	9,900	49,599.00	0.05
253	688150	莱特光电	2,000	49,440.00	0.05
254	600869	远东股份	9,700	49,276.00	0.05
255	688289	圣湘生物	2,400	49,152.00	0.05
256	603025	大豪科技	3,500	49,070.00	0.05
257	603328	依顿电子	5,000	49,050.00	0.05
258	600675	中华企业	17,000	48,960.00	0.05
259	600033	福建高速	13,800	48,852.00	0.05
260	300702	天宇股份	2,100	48,846.00	0.05
261	688403	汇成股份	4,700	48,833.00	0.05
262	603229	奥翔药业	5,600	48,832.00	0.05
263	300602	飞荣达	2,300	48,783.00	0.05
264	605020	永和股份	2,100	48,384.00	0.04
265	688586	江航装备	4,300	48,375.00	0.04
266	601089	福元医药	2,900	48,372.00	0.04
267	601609	金田股份	6,900	48,369.00	0.04

268	300257	开山股份	4,800	48,336.00	0.04
269	301069	凯盛新材	3,000	48,330.00	0.04
270	688147	微导纳米	1,600	48,288.00	0.04
271	002378	章源钨业	6,100	48,251.00	0.04
272	688232	新点软件	1,600	48,064.00	0.04
273	300226	上海钢联	2,100	47,964.00	0.04
274	600058	五矿发展	6,200	47,926.00	0.04
275	603609	禾丰股份	5,800	47,908.00	0.04
276	301031	中熔电气	600	47,790.00	0.04
277	300458	全志科技	1,200	47,628.00	0.04
278	601107	四川成渝	7,900	47,558.00	0.04
279	002242	九阳股份	5,000	47,500.00	0.04
280	688523	航天环宇	2,200	47,322.00	0.04
281	002202	金风科技	4,600	47,150.00	0.04
282	605168	三人行	1,600	47,088.00	0.04
283	688128	中国电研	1,900	46,550.00	0.04
284	605296	神农集团	1,500	46,110.00	0.04
285	301381	赛维时代	2,300	45,885.00	0.04
286	600064	南京高科	5,700	43,947.00	0.04
287	300408	三环集团	1,300	43,420.00	0.04
288	002315	焦点科技	900	41,121.00	0.04
289	601375	中原证券	9,500	39,520.00	0.04
290	600330	天通股份	5,300	38,001.00	0.04
291	603997	继峰股份	2,900	37,816.00	0.04
292	002929	润建股份	800	37,808.00	0.04
293	600989	宝丰能源	2,300	37,122.00	0.03
294	601236	红塔证券	4,300	36,421.00	0.03
295	002252	上海莱士	5,300	36,411.00	0.03
296	002468	申通快递	3,400	36,346.00	0.03
297	002258	利尔化学	3,200	35,328.00	0.03
298	002498	汉缆股份	10,200	34,476.00	0.03
299	603466	风语筑	3,400	34,306.00	0.03
300	000557	西部创业	6,700	34,170.00	0.03
301	300973	立高食品	700	34,139.00	0.03
302	301216	万凯新材	2,700	33,669.00	0.03
303	300885	海昌新材	2,400	33,624.00	0.03
304	688112	鼎阳科技	900	33,273.00	0.03
305	300869	康泰医学	2,300	32,982.00	0.03
306	301112	信邦智能	900	32,670.00	0.03
307	000425	徐工机械	4,200	32,634.00	0.03
308	002959	小熊电器	700	32,508.00	0.03
309	603989	艾华集团	2,100	32,340.00	0.03
310	002835	同为股份	1,700	31,909.00	0.03

311	301119	正强股份	900	31,824.00	0.03
312	688233	神工股份	1,000	31,770.00	0.03
313	301161	唯万密封	1,400	31,766.00	0.03
314	300690	双一科技	1,300	31,473.00	0.03
315	300214	日科化学	4,600	31,234.00	0.03
316	300279	和晶科技	4,500	31,185.00	0.03
317	301221	光庭信息	600	31,182.00	0.03
318	603500	祥和实业	3,400	31,144.00	0.03
319	300549	优德精密	1,700	31,093.00	0.03
320	002763	汇洁股份	4,500	31,050.00	0.03
321	300018	中元股份	3,900	31,005.00	0.03
322	300562	乐心医疗	2,100	30,975.00	0.03
323	301180	万祥科技	2,100	30,933.00	0.03
324	605577	龙版传媒	2,400	30,864.00	0.03
325	300826	测绘股份	1,800	30,816.00	0.03
326	300234	开尔新材	6,200	30,814.00	0.03
327	600489	中金黄金	2,100	30,723.00	0.03
328	301120	新特电气	3,000	30,720.00	0.03
329	001269	欧晶科技	1,200	30,720.00	0.03
330	301199	迈赫股份	1,200	30,624.00	0.03
331	688588	凌志软件	2,100	30,597.00	0.03
332	301020	密封科技	1,400	30,562.00	0.03
333	603798	康普顿	2,800	30,464.00	0.03
334	301318	维海德	900	30,456.00	0.03
335	300812	易天股份	1,300	30,043.00	0.03
336	301106	骏成科技	1,000	29,800.00	0.03
337	600482	中国动力	1,200	27,684.00	0.03
338	600480	凌云股份	2,200	26,774.00	0.02
339	600007	中国国贸	1,200	24,696.00	0.02
340	002595	豪迈科技	400	23,688.00	0.02
341	603678	火炬电子	600	22,818.00	0.02
342	002396	星网锐捷	1,000	22,450.00	0.02
343	600352	浙江龙盛	2,200	22,352.00	0.02
344	002410	广联达	1,600	21,456.00	0.02
345	688213	思特威	200	20,444.00	0.02
346	300395	菲利华	400	20,440.00	0.02
347	301395	仁信新材	1,500	20,235.00	0.02
348	600909	华安证券	3,400	19,822.00	0.02
349	600699	均胜电子	1,100	19,184.00	0.02
350	600535	天士力	1,200	18,780.00	0.02
351	688372	伟测科技	300	18,120.00	0.02
352	601456	国联民生	1,700	17,595.00	0.02
353	688123	聚辰股份	200	16,198.00	0.02

354	000959	首钢股份	4,700	15,980.00	0.01
355	600901	江苏金租	2,600	15,756.00	0.01
356	603456	九洲药业	1,000	15,210.00	0.01
357	688252	天德钰	600	14,628.00	0.01
358	002777	久远银海	800	14,608.00	0.01
359	000935	四川双马	800	14,576.00	0.01
360	001339	智微智能	300	14,499.00	0.01
361	601101	昊华能源	2,000	14,480.00	0.01
362	002611	东方精工	1,200	14,472.00	0.01
363	002045	国光电器	900	14,364.00	0.01
364	603698	航天工程	800	14,096.00	0.01
365	002881	美格智能	300	13,920.00	0.01
366	300101	振芯科技	600	13,578.00	0.01
367	002947	恒铭达	400	13,276.00	0.01
368	601208	东材科技	1,100	10,428.00	0.01
369	002019	亿帆医药	800	10,392.00	0.01
370	300904	威力传动	180	9,774.00	0.01
371	301202	朗威股份	225	9,247.50	0.01
372	600882	妙可蓝多	300	9,159.00	0.01
373	301348	蓝箭电子	335	7,882.55	0.01
374	301510	固高科技	252	7,572.60	0.01
375	603119	浙江荣泰	161	7,444.64	0.01
376	601096	宏盛华源	1,575	6,520.50	0.01
377	688716	中研股份	178	6,336.80	0.01
378	301029	怡合达	200	4,572.00	0.00
379	688651	盛邦安全	116	3,959.08	0.00
380	001306	夏厦精密	33	2,506.02	0.00
381	301293	三博脑科	47	2,416.27	0.00
382	603107	上海汽配	147	2,288.79	0.00
383	301358	湖南裕能	38	1,185.22	0.00

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	5,351,623.00	3.87
2	300750	宁德时代	4,049,000.00	2.92
3	600036	招商银行	3,417,752.00	2.47
4	000333	美的集团	3,282,398.00	2.37
5	601919	中远海控	3,279,587.00	2.37
6	600519	贵州茅台	3,275,841.00	2.37

7	601328	交通银行	3,136,594.00	2.27
8	002594	比亚迪	3,092,721.00	2.23
9	601318	中国平安	2,864,389.00	2.07
10	601288	农业银行	2,791,491.00	2.02
11	601668	中国建筑	2,773,102.00	2.00
12	601899	紫金矿业	2,634,278.00	1.90
13	601211	国泰海通	2,541,323.32	1.84
14	601166	兴业银行	2,459,541.00	1.78
15	601398	工商银行	2,426,448.00	1.75
16	601186	中国铁建	2,423,416.00	1.75
17	600031	三一重工	2,398,290.00	1.73
18	600900	长江电力	2,362,637.00	1.71
19	000651	格力电器	2,341,904.00	1.69
20	002475	立讯精密	2,255,947.00	1.63

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。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	5,775,211.00	4.17
2	601919	中远海控	3,643,732.00	2.63
3	300750	宁德时代	3,403,272.00	2.46
4	002594	比亚迪	3,181,867.00	2.30
5	601328	交通银行	3,107,342.00	2.24
6	601318	中国平安	3,043,667.00	2.20
7	601288	农业银行	2,853,624.00	2.06
8	600036	招商银行	2,801,298.00	2.02
9	600295	鄂尔多斯	2,684,803.00	1.94
10	000983	山西焦煤	2,652,314.00	1.92
11	601899	紫金矿业	2,475,519.00	1.79
12	600519	贵州茅台	2,439,831.00	1.76
13	002475	立讯精密	2,420,453.00	1.75
14	601166	兴业银行	2,331,526.00	1.68
15	300059	东方财富	2,236,324.46	1.62
16	600919	江苏银行	2,214,990.00	1.60
17	000333	美的集团	2,196,134.00	1.59
18	601398	工商银行	2,176,122.00	1.57
19	601939	建设银行	2,113,141.00	1.53
20	601211	国泰海通	2,104,022.22	1.52

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。

#### 7.4.3 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	487,677,911.94
卖出股票收入（成交）总额	509,917,594.23

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。

## 7.5 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	7,030,851.78	6.53
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	10,951,585.70	10.18
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	17,982,437.48	16.71

## 7.6 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	019766	25 国债 01	70,000	7,030,851.78	6.53
2	132026	G 三峡 EB2	7,000	1,012,456.03	0.94
3	110059	浦发转债	4,860	547,949.02	0.51
4	110093	神马转债	4,370	543,093.18	0.50
5	127017	万青转债	4,800	542,400.72	0.50

## 7.7 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

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券投资。

## 7.8 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。

## 7.9 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投资。

## 7.10 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 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。

## 7.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 72,377,186.24 元，占基金资产净值的比例为 67.25%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-66,849,580.00 元，占基金资产净值的比例为-62.11%，空头合约市值占股票资产的比例为-92.36%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 2,827,470.22 元，公允价值变动损益为-1,529,059.94 元。

## 7.13 投资组合报告附注

### 7.13.1 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：

1) 本集合计划持有的“招商银行”发行主体因违反相关审慎经营规则，于 2024 年 6 月 24 日被国家金融监督管理总局罚款 350 万元；

2) 本集合计划持有的“兴业银行”发行主体因违反审慎经营相关规则，于 2024 年 7 月 17 日被国家金融监督管理总局福建监管局罚款 190 万元；

该类情形对上述发行主体没有重大影响，该证券的投资决策程序符合相关法律法规以及产品合同的要求。

### 7.13.2 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

本集合计划投资的前十名股票未超出集合计划合同规定的备选股票库。

### 7.13.3 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	8,141,414.21
2	应收清算款	1,704,377.60
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	9,845,791.81

#### 7.13.4 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	132026	G 三峡 EB2	1,012,456.03	0.94
2	110059	浦发转债	547,949.02	0.51
3	110093	神马转债	543,093.18	0.50
4	127017	万青转债	542,400.72	0.50
5	110095	双良转债	541,910.90	0.50
6	123149	通裕转债	539,154.99	0.50
7	128081	海亮转债	276,465.60	0.26
8	110062	烽火转债	276,011.84	0.26
9	127103	东南转债	275,681.03	0.26
10	123064	万孚转债	275,667.89	0.26
11	127015	希望转债	275,523.72	0.26
12	110094	众和转债	275,487.76	0.26
13	127049	希望转 2	275,214.18	0.26
14	113037	紫银转债	274,941.38	0.26
15	113670	金 23 转债	274,389.06	0.25
16	128119	龙大转债	274,246.54	0.25
17	113674	华设转债	274,140.00	0.25
18	123130	设研转债	274,089.50	0.25
19	123210	信服转债	272,070.13	0.25
20	127070	大中转债	272,065.53	0.25
21	113042	上银转债	270,712.09	0.25
22	113062	常银转债	270,025.13	0.25
23	110090	爱迪转债	269,472.72	0.25
24	110082	宏发转债	269,122.87	0.25
25	127025	冀东转债	268,813.68	0.25
26	118031	天 23 转债	268,806.31	0.25
27	128135	洽洽转债	268,583.89	0.25
28	127018	本钢转债	268,483.98	0.25
29	113563	柳药转债	268,416.29	0.25
30	113056	重银转债	268,279.04	0.25
31	113545	金能转债	268,271.33	0.25
32	127030	盛虹转债	204,158.12	0.19
33	110084	贵燃转债	150,251.88	0.14
34	128131	崇达转 2	65,229.37	0.06

#### 7.13.5 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。

### 7.13.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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 个月持有混合 A	13	133,535.44	-	-	1,735,960.73	100.00
光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	150	44,024.02	-	-	6,603,602.70	100.00
光大阳光对冲 6 个月持有混合 C	13,943	6,468.94	-	-	90,196,494.50	100.00
合计	14,106	6,985.40	-	-	98,536,057.93	100.00

注：分级集合计划机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级集合计划，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计划份额的合计数（即期末集合计划份额总额）。

### 8.2 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	-	0.0000
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	47,574.88	0.7204
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C	94,831.21	0.1051
	合计	142,406.09	0.1445

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）。

### 8.3 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	0
	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	0~10
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	0
	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	0~10
	合计	0~10

## § 9 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	-	-
本报告期期初基金份额总额	1,735,960.73	7,215,497.98	119,188,873.76
本报告期基金总申购份额	-	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	-	611,895.28	28,992,379.26
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,735,960.73	6,603,602.70	90,196,494.50

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。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本集合计划未召开集合计划份额持有人大会。

### 10.2 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无重大人事变动。

2025 年 4 月 23 日，本集合计划托管人广发银行股份有限公司因工作调整需要，任命安琦瑜先生为资产托管部总经理助理。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本集合计划投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

2025 年 1 月 24 日，本集合计划会计师事务所由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）改聘为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 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，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	997,595,506.17	100.00	345,228.84	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而合计支付该券商的佣金合计。

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。

## 10.7.2 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	216,311,077.14	100.00	727,000,000.00	100.00	-	-

## 10.8 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	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 2024 年第 4 季度报告	中国证监会规定的媒介	2025 年 01 月 22 日
2	关于旗下参公集合计划改聘会计师事务所的公告	中国证监会规定的媒介	2025 年 01 月 24 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 A 类份额调低管理费率并修改资产管理合同、托管协议的公告	中国证监会规定的媒介	2025 年 03 月 03 日
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资产管理合同、托管协议、招募说明书更新	中国证监会规定的媒介	2025 年 03 月 03 日
5	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 2024 年年度报告	中国证监会规定的媒介	2025 年 03 月 31 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 2025 年第 1 季度报告	中国证监会规定的媒介	2025 年 04 月 22 日
7	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	2025 年 05 月 19 日

8	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延长存续期限并修改资产管理合同、招募说明书的公告	中国证监会规定的媒介	2025 年 06 月 26 日
9	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、招募说明书更新	中国证监会规定的媒介	2025 年 06 月 26 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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

本集合计划本报告期内未出现单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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。

### 12.2 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。

### 12.3 查阅方式

投资者可到集合计划管理人的办公场所免费查阅备查文件，亦可通过公司网站查阅，公司网址为：[www.ebscn-am.com](http://www.ebscn-am.com)

上海光大证券资产管理有限公司

2025 年 8 月 29 日