光证资管阳光价值发现 3 号集合资产管理计划
2026 年第 3 季度报告

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北京市分行

报告期间：2026 年 07 月 01 日至 2026 年 9 月 30 日

重要提示

本报告由计划管理人上海光大证券资产管理有限公司制作。 管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用产品资产，但不保证产品一定盈利。产品的过往业绩并不代表其未来表现。 本报告中的内容由管理人负责解释。本报告中财务资料未经审计。

一、产品概况

1.产品名称	光证资管阳光价值发现 3 号集合资产管理计划
2.合同生效日	2019 年 7 月 4 日
3.计划管理人	上海光大证券资产管理有限公司
4.计划托管人	中国工商银行股份有限公司北京市分行

二、投资表现

单位：元

主要财务指标	报告期（2026 年 7 月 1 日至 2026 年 9 月 30 日）
1.本期利润	-12,840.16
2.期末计划资产净值	2,804,513.10
3.期末计划份额净值	1.1379
4.本报告期计划净值增长率	-0.45%

三、管理人履职报告

（一）投资主办简介

曹斌佳先生，美国圣约瑟夫大学金融硕士，历任西部利得基金专户交易员、研究员和投资经理，2020 年 12 月加入上海光大证券资产管理有限公司。已取得基金从业资格，具备三年以上投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验，最近三年未出现被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚等事项。

（二）管理人履职报告

1、计划运作合规性声明

本报告期内，计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《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计划资产，在严格控制风险的基础上为委托人谋求最大利益，运作合法合规，无损害委托人利益的行为。

2、风险控制报告

计划管理人设立合规管理部门与风险管理部门作为内部控制监督管理部门，通过流程控制、系统监控等措施，对资产管理计划运作过程中的各类风险进行监督、检查和评价。事前，通过交易系统中设置的各类风控指标与阈值实现交易事前控制，确保计划运作的合法合规；事后，通过每日风险监控就发现的可能的风险状况，及时提醒投资主办人或责任部门采取相应措施，以规避风险事件发生。

本报告期内，计划管理人自觉接受托管人、委托人以及相关监管机构、自律组织的监督。

本报告期内，计划管理人按照有关法律法规、公司内部制度和本计划合同的要求对计划进行投资管理。本计划的投资决策、投资交易、会计核算等行为均合法合规进行，未出现异常交易、违反公平交易的现象。

四、托管人履职报告

托管人履职情况详见：光证资管阳光价值发现 3 号集合资产管理计划托管报告。

五、投资组合报告

1、报告期末计划资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占总资产的比例(%)
1	股票投资	491,496.97	17.41
	其中：港股投资	-	-
2	固定收益投资	436,406.96	15.46
	其中：债券	436,406.96	15.46
	资产支持证券	-	-
3	基金投资	1,885,872.80	66.80
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	9,183.06	0.33
7	其他资产	80.04	0.00
8	合计	2,823,039.83	100.00

2、报告期末期货投资情况

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(人民币元)	公允价值变动（人民币元）	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（人民币元）					-
期货投资本期收益（人民币元）					-
期货投资本期公允价值变动（人民币元）					-

注：本报告期末未持有期货投资。

3、报告期末计划持仓前十大证券情况

序号	证券代码	证券名称	数量	公允价值（元）	占计划资产净值比例（%）
1	511360	海富通中证短融 ETF	6,100.00	695,454.90	24.80
2	159649	国开债 ETF	4,000.00	442,176.00	15.77
3	511060	海富通上证 5 年期地方政府债 ETF	3,500.00	380,800.00	13.58
4	511270	海富通上证 10 年期地方政府债 ETF	2,400.00	291,715.20	10.40
5	127102	浙建转债	1,830.00	219,014.90	7.81
6	123133	佩蒂转债	1,700.00	217,392.06	7.75
7	601318	中国平安	1,500.00	79,935.00	2.85
8	159650	国开 ETF	700.00	75,726.70	2.70
9	002568	百润股份	2,200.00	42,878.00	1.53
10	601601	中国太保	1,300.00	40,378.00	1.44

六、运用杠杆情况

报告期末计划资产运用杠杆情况：

杠杆率：100.66%

七、收益分配情况

本期收益分配情况：

收益分配日期	收益分配金额（元）	备注
-	-	-

八、管理费、托管费、业绩报酬（如有）的计提基准、计提方式和支付方式

1、托管费

本集合计划自成立之日起计提托管费。本集合计划的托管费按前一日计划资产净值 0.03%的年费率计算，计算方法如下：

H＝E×0.03%÷当年天数

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每季末，按季支付。经管理人与托管人核对一致后，由托管人于次季度初第 5 个工作日自动从集合计划资产一次性支付给托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

2、管理费

本集合计划自成立之日起计提固定管理费。本集合计划的固定管理费按前一日集合计划资产净值的 0.6%年费率计提，计算方法如下：

G＝E×年管理费率÷当年天数

G 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日集合计划资产净值

集合计划管理费每日计提，逐日累计至每个季度末，按季支付。经管理人与托管人核对一致后，由托管人于次季度初第 5 个工作日自动从集合计划资产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

3、业绩报酬

业绩报酬计提原则：①按委托人参与的计划单位份额分别计算业绩比较基准并计提业绩报酬。②在符合业绩报酬计提条件时，在集合计划分红日、委托人退出日和集合计划终止日计提业绩报酬。③业绩报酬计提日是指实际发生业绩报酬计提的日期。④在委托人退出和集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬按委托人退出份额或集合计划终止时持有份额计算，从退出资金中扣除。

业绩报酬计提的方法：

管理人计算上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（如上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日不存在，募集期参与的为集合计划成立日，存续期参与的为参与当天，下同）到本次业绩报酬计提日的年化收益率，若业绩比较基准小于或等于当期业绩报酬计提基准，则管理人不提取业绩报酬；若业绩比较基准大于当期业绩报酬计提基准，则管理人对超出部分按一定的比例累进提取业绩报酬。业绩比较基准的计算公式如下：

R=（P1*-P0*）*365/（P0*D）

R 为业绩比较基准；　　P1*为业绩报酬计提日的单位累计净值；P0*为上一业绩报酬计提日的单位累计净值；P0 为上一业绩报酬计提日的份额净值；　D 为上一业绩报酬计提日到

本次业绩报酬计提日的天数。

管理人业绩报酬计提公式如下：

年化收益率（R） 计提比例 业绩报酬（I）

R≤B 0 0

R＞B 40% I=（R-B%）×40%×P0×F×D／365

其中：①I 为管理人应提的业绩报酬；②F 为委托人持有本集合计划的份额数，管理人计提的业绩报酬为按委托人的每笔份额明细计算的业绩报酬加总（委托人退出时计提业绩报酬的，为该笔推出申请的份额数）；③业绩报酬计提基准为 B，本资产管理计划业绩报酬的标准为 5.5%/年。

业绩报酬的支付：管理人于每个业绩报酬提取日计提业绩报酬，由托管人于业绩报酬提取日后 5 个工作日内按照管理人指令从集合计划资产中一次性支付给管理人，对于集合计划分红、委托人退出和集合计划终止时提取业绩报酬的，从分红资金、退出资金或清算资金中扣除。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。管理人的业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成，托管人不承担复核责任。当发生业绩报酬计算错误时，由管理人负责处理。由此给集合计划委托人和集合计划造成损失的，托管人不承担任何责任。

九、非标准化债权类资产投资情况

序号	非标债权类资产名称	融资客户	剩余金额	非标债权类资产分类	起始日期	到期日期	风险情况
-	-	-	-	-	-	-	-

十、影响投资者权益的重大事项

（一）本报告期内本计划从事关联交易的情况。

交易日期	证券简称	交易方式	数量	金额（元）	关联交易类型
-	-	-	-	-	-

注：本报告期内本计划未从事关联交易

（二）本报告期内本计划管理人自有资金、管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本计划的情况：

项 目	持有计划份额总数量的数量区间(万份)
管理人自有资金	-
管理人的董事、监事、从业人员及其配偶	-
管理人的控股股东、实际控制人或者其他关联方	-

注：上表的其他关联方范围由管理人按重要性原则确定。区间划分：（0,50]、（50,100]、（100,500]、（500,1000]、1000 以上，如无则为-。

（三）本报告期内本计划未发生其他设计投资者权益的重大事项

如有疑问，可通过以下途径向管理人上海光大证券资产管理有限公司咨询：

网址：www.ebscn-am.com

上海光大证券资产管理有限公司
2026 年 10 月 30 日