光证资管悦享 88 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：中国银行股份有限公司

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	光证资管悦享 88 号集合资产管理计划
2.合同生效日	2024 年 12 月 3 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	中国银行股份有限公司

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	4,183,151.99
2.期末计划资产净值	749,503,931.05
3.期末计划份额净值	1.0549
4.本报告期计划净值增长率	0.46%

三、管理人履职报告

（一）投资主办简介

闫小飞先生，天津大学硕士，先后在天津银行、中国国际金融股份有限公司工作，2018 年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：光证资管悦享 88 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	-	-
	其中：港股投资	-	-
2	固定收益投资	825,957,679.11	99.40
	其中：债券	777,438,252.04	93.56
	资产支持证券	48,519,427.07	5.84
3	基金投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,924,903.32	0.59
7	其他资产	35,277.95	0.00
8	合计	830,917,860.38	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）					-774,663.53
期货投资本期公允价值变动（人民币元）					90,000.00

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	282102	26 信地 01	600,000.00	61,167,287.67	8.16
2	138834	23 中置 01	520,000.00	53,256,975.34	7.11
3	102484830	24 悦达 MTN005	400,000.00	41,319,101.37	5.51
4	102382876	23 大足发展 MTN003	400,000.00	40,955,506.85	5.46
5	252886	23 巴中 03	300,000.00	32,223,657.53	4.30
6	148534	23 电建 04	300,000.00	31,185,205.48	4.16
7	102484846	24 宝城投 MTN003A	300,000.00	31,120,808.22	4.15
8	265883	信担 5 优	300,000.00	30,325,808.22	4.05
9	270013	23 渝投 01	300,000.00	25,808,457.53	3.44
10	270033	23 盐城 01	200,000.00	21,403,561.64	2.86

六、运用杠杆情况

报告期末计划资产运用杠杆情况：
杠杆率：110.86%

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

本集合计划自成立后第二日起计提本集合计划应给付托管人托管费。托管费按集合计划资产前一日的资产净值的【0.025】%的年费率计提，计算方法如下：

计算方式：

H＝E×【0.025】%/年÷当年天数

H 为每日应计提的托管费；

E 为前一日集合计划资产净值。

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每个季季末，按季支付。经集合计划管理人与集合计划托管人核对一致后，由集合计划托管人于次季首日起第5个工作日从集合计划资产一次性支付给集合计划托管人。

账户名称（接收托管费）：券商资管计划托管费收入

账　　号：9061445681001

开户银行：中国银行上海市分行中银大厦支行

指令备注写明：支付托管费

2、管理费

本集合计划自成立后第二日起计提管理费。管理人按集合计划资产前一日净值的【0.1】%年费率计提集合计划管理费。计算方法如下：

计算方式：

H＝E×【0.1】%/年÷当年天数

H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，逐日累计至每个季季末，按季支付。经集合计划管理人与集合计划托管人核对一致后，由集合计划托管人于次季首日起第5个工作日从集合计划资产中一次性支付给集合计划管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。支付方式：

账户名称（接收管理费）：上海光大证券资产管理有限公司

账　　号：36510188000562328

开户银行：光大银行上海分行营业部

3、业绩报酬

本集合计划不收取业绩报酬。

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
2026/7/31	21 中国银行二级 03	逆回购	74,000.00	7,400,000.00	逆回购质押券为托管人及其关联方发行的证券

（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