光证资管汇福周周享 11 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：上海浦东发展银行股份有限公司

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	光证资管汇福周周享 11 号集合资产管理计划
2.合同生效日	2025 年 6 月 11 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	上海浦东发展银行股份有限公司

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	177,114.87
2.期末计划资产净值	60,696,377.73
3.期末计划份额净值	1.0209
4.本报告期计划净值增长率	0.27%

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。

沈宇亮先生，中国人民大学经济学学士、新加坡国立大学经济学硕士，曾就职于易方达基金，2021 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：光证资管汇福周周享 11 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	34,906,714.94	57.40
	其中：债券	28,744,825.90	47.27
	资产支持证券	6,161,889.04	10.13
3	基金投资	10,787,553.44	17.74
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	666,564.26	1.10
7	其他资产	14,448,708.95	23.76
8	合计	60,809,541.59	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	LB0527	华安财保资管安源 5 号	13,095,780.02	14,435,478.32	23.78
2	LB0457	民生通惠汇通 7 号	8,967,209.84	10,787,553.44	17.77
3	019846	26 国债 14	95,000.00	9,511,272.47	15.67
4	253019	23 成阿债	50,000.00	5,324,623.29	8.77
5	500243	25 盛业 2A	50,000.00	5,147,832.88	8.48
6	134164	25 中交 01	50,000.00	5,145,349.32	8.48
7	133965	25 中交 02	50,000.00	5,136,876.71	8.46
8	102581362	25 京科技园 MTN002	20,000.00	2,034,797.26	3.35
9	253184	23 潍创 02	15,000.00	1,591,906.85	2.62
10	265653	信担 4 优	10,000.00	1,014,056.16	1.67

六、运用杠杆情况

报告期末计划资产运用杠杆情况：

杠杆率：100.19%

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、管理费

本集合计划自成立之日起计提管理费。本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的【0.50%】年费率计提，计算方法如下：

G ＝ E×年管理费率÷当年实际天数

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，成立日首日按照成立规模计算。

集合计划管理费自本集合计划成立日（含）起，每日计提，逐日累计至每个季度末，按季支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在每季初的第 5 个工作日按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。若因战争、自然灾害等不可抗力或计划资产无法变现致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。集合计划终止后，依据清算程序支付尚未支付的管理费。

2、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【0.01%】的年费率计算，计算方法如下：

H ＝ E ×年托管费率 ÷ 当年实际天数

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，成立日首日按照成立规模计算。

集合计划托管费自本集合计划成立日（含）起，每日计提，逐日累计至每季末，按季支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在每季初的第 5 个工作日按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。若因战争、自然灾害等不可抗力或计划资产无法变现致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。集合计划终止后，依据清算程序支付尚未支付的托管费。

托管费收费账户信息如下

账户名：证券公司客户资产托管业务收入

账号：98490142110000077

开户行：上海浦东发展银行长宁支行

大额支付行号：310290000072

3、业绩报酬

（1）业绩报酬计提原则：

①按投资者参与的计划份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬。

②管理人可以在投资者退出日、集合计划分红日、集合计划终止日计提业绩报酬。

投资者退出日，对于退出份额计算业绩报酬。符合业绩报酬计提条件的份额，业绩报酬从退出资金中扣除。

集合计划分红日，对于全体份额计算业绩报酬。符合业绩报酬计提条件的份额，业绩报酬从分红资金中扣除。

集合计划终止日，对于全体份额计算业绩报酬。符合业绩报酬计提条件的份额，业绩报酬从清算资金中扣除。

（2）业绩报酬计提的方法：

①年化收益率的计算方法：

管理人计算本次计提对应的每笔份额的业绩报酬计提起始日适用净值（即该笔份额最近一次分红计提业绩报酬对应的净值，如该分红业绩报酬计提日不存在，募集期认购的份额适用集合计划面值，即 1.0000 元，存续期参与的份额适用参与申请对应的净值，下同）到本次业绩报酬计提日适用净值（退出集合计划适用退出申请对应的净值，集合计划分红适用本次分红对应的净值，集合计划终止适用终止清算日的净值，下同）的年化收益率，若年化收益率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；若年化收益率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提取业绩报酬。年化收益率的计算公式如下：

R=(P_1^*-P_0^*)/P_0 ×"365" /D

其中：

R 为年化收益率；

P1*为本次业绩报酬计提日适用的份额累计净值；

P0*为业绩报酬计提起始日适用的份额累计净值；

P0 为业绩报酬计提起始日适用的份额净值；

D 为业绩报酬计提起始日（即该笔份额最近一次分红计提业绩报酬的分红确认日，如该分红业绩报酬计提日不存在，募集期认购的份额为集合计划成立日，存续期参与的份额为参与确认日）到本次业绩报酬计提日（退出集合计划为退出申请确认日，集合计划分红为分红确认日，集合计划终止为终止清算日）的天数。

②管理人业绩报酬计提方法：

对于每笔份额来说，管理人业绩报酬计提公式如下：

$$I=\max\left(0,F\times P_0\times\sum_{i=1}^{n}\left\{(R-B_i)\times D_i/365\times C_i\right\}\right)$$

其中：

I 为投资者每笔份额应计提的业绩报酬；

F 为该笔份额的份额数；在投资者退出时，在先进先出的退出确认规则下，因参与时间可能不同，可能存在业绩报酬情形不同的多笔份额，管理人计提的业绩报酬为本次退出对应的每笔份额按上述方法计算的业绩报酬加总；集合计划分红和终止时，管理人计提的业绩报酬为投资者持有的所有份额按上述方法计算的业绩报酬加总；

i=（1,2,3…n）分别对应该笔份额持有期间的第 i 个业绩基准计算周期，如本计划的业绩报酬计提基准或计提比例发生变更，则自变更生效之日起视为下一个业绩基准计算周期。

Bi 为当期业绩报酬计提基准，以本计划募集公告或存续期间相关公告为准；

Ci 为当期业绩报酬计提比例，且不超过 60%，以本计划募集公告或存续期间相关公告为准。

Di 为第 i 个业绩基准计算周期该笔份额持有的天数，其中 D1 的起始日为该笔份额上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日，Dn 的末日为本次业绩报酬计提日。

本计划运作期间，管理人可以视情况调整业绩报酬计提基准或计提比例。每次调整前，管理人应通过指定网站向投资者公告，如管理人采取“调高本计划业绩报酬计提基准”或“调低本计划业绩报酬计提比例”的有利于投资者的业绩报酬收取方式调整，管理人可不设置临时开放期，直接公告调整。除上述情形外调整业绩报酬计提基准或计提比例的，管理人需设置临时开放日保障投资者退出的权利。投资者不同意调整业绩报酬计提基准或计提基准的，可就持有的计划份额在临时开放日提出退出申请；逾期未退出的，根据本合同约定，视同投资者同意。

举例说明：

假设本资产管理合同于 2025 年 7 月 1 日生效，当期业绩报酬计提基准为 9%/年，业绩报酬计提比例为 40%；2025 年 10 月 15 日，本计划将业绩报酬计提基准调整为 10%/年，业绩报酬计提比例不变；2026 年 1 月 19 日，本计划将业绩报酬计提比例调整为 30%，业绩报酬计提基准不变。

且假设一笔份额于本计划募集期认购确认成功，于本计划开放期 2026 年 4 月 20 日申请赎回。

该赎回涉及的业绩报酬计算参数如下：

第一个业绩基准计算周期 D1 为 2025 年 7 月 1 日至 2025 年 10 月 15 日的间隔天数，相

应的 B1=9%，C1=40%；

第二个业绩基准计算周期 D2 为 2025 年 10 月 15 日至 2026 年 1 月 19 日的间隔天数，相应的 B2=10%，C2=40%；

第三个业绩基准计算周期 D3 为 2026 年 1 月 19 日至 2026 年 4 月 20 日（赎回日）的间隔天数，相应的 B3=10%，C3=30%。

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