

# 光大阳光混合型集合资产管理计划 2021 年中期报告

2021 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：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2021 年 08 月 31 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。

集合计划托管人中国光大银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2021 年 8 月 25 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。

本公司承诺以诚实信用、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，也不保证最低收益。投资需谨慎，敬请投资者注意投资风险。投资者欲了解本集合计划的详细情况，请于投资集合计划前认真阅读集合计划的产品合同、更新的招募说明书等法律文件以及相关业务公告。敬请投资者关注适当性管理相关规定，提前做好风险测评，并根据自身的风险承受能力购买风险等级相匹配的产品。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 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	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50

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 .....	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 .....	50
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 .....	50
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 .....	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	51
7.12 投资组合报告附注 .....	51
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	53
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 .....	53
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>53</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>54</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	54
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 .....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
10.4 基金投资策略的改变 .....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	54
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 .....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
10.8 其他重大事件 .....	55
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>55</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 .....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	56
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>56</b>
12.1 备查文件目录 .....	56
12.2 存放地点 .....	56
12.3 查阅方式 .....	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	光大阳光混合型集合资产管理计划		
基金简称	光大阳光混合		
基金主代码	860001		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2020年6月23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	中国光大银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	323,935,554.00份		
基金合同存续期	3年		
下属分级基金的基金简称	光大阳光混合 A	光大阳光混合 B	光大阳光混合 C
下属分级基金的交易代码	860001	860036	860037
报告期末下属分级基金的份额总额	321,923,802.06份	1,878,701.49份	133,050.45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	在控制和分散投资组合风险的前提下,实现组合资产长期稳健增值。
投资策略	<p>(一) 资产配置策略</p> <p>本集合计划通过定性与定量研究相结合的方法,确定投资组合中权益类资产和固定收益类资产的配置比例。本集合计划通过动态跟踪海内外主要经济体的 GDP、CPI、利率等宏观经济指标,以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等市场指标,确定未来市场变动趋势。本集合计划通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势,对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。根据上述定性和定量指标的分析结果,运用资产配置优化模型,在目标收益条件下,追求风险最小化目标,最终确定大类资产投资权重,实现资产合理配置。</p> <p>(二) 权益类品种的投资策略</p> <p>本集合计划以投资符合中国产业转型升级方向的新兴成长行业为主,比如由人口老龄化驱动的医疗行业、符合消费升级方向的消费品行业、技术创新驱动的科技行业等;同时把传统行业的价值策略作为辅助策略。通过分析跟踪各行业整体的收入增速、利润增速、毛利率变动幅度、ROIC 变动情况等,依此来判断各行业的景气度,再根据行业整体的估值情况、市场的预期、目前机构配置的比例来综合考虑各行业在组合中的配置比例。</p> <p>(三) 固定收益类品种投资策略</p> <p>在债券投资方面,本计划可投资于国债、金融债、企业债和可转换</p>

	<p>债券等债券品种。本计划将根据对利率走势的预测、债券等级、债券的期限结构、风险结构、不同品种流动性的高低等因素，构造债券组合。</p> <p>（四）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> <p>（五）衍生品投资策略</p> <p>1、股指期货投资策略</p> <p>管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本集合计划的投资目标。本集合计划在股指期货投资中将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，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。</p> <p>2、国债期货的投资策略</p> <p>本集合计划投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。管理人通过动态管理国债期货合约数量，以获取相应债券组合的超额收益。</p>
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×20%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%。
风险收益特征	<p>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。</p> <p>本集合计划可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本集合计划还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。</p>

### 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	中国光大银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	朱轶	石立平
	联系电话	021-32068300	010-63639180
	电子邮箱	zhuyil@ebscn.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		95525	95595
传真		021-32068585	010-63639132
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	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
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	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码		200127	100033

法定代表人	熊国兵	李晓鹏
-------	-----	-----

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)		
	光大阳光混合 A	光大阳光混合 B	光大阳光混合 C
本期已实现收益	80,855,299.95	338,647.51	21,588.45
本期利润	51,751,231.33	383,831.58	14,633.47
加权平均基金份额本期利润	0.1545	0.2990	0.2132
本期加权平均净值利润率	3.90%	7.56%	5.41%
本期基金份额净值增长率	3.72%	3.73%	3.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)		

期末可供分配利润	980,921,617.21	5,726,540.62	402,301.25
期末可供分配基金份额利润	3.0471	3.0481	3.0237
期末基金资产净值	1,302,845,419.27	7,605,242.11	535,351.70
期末基金份额净值	4.0471	4.0481	4.0237
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)		
基金份额累计净值增长率	31.23%	28.88%	28.10%

注：1、表中的“期末”均指报告期最后一日，即 2021 年 6 月 30 日；“本期”指 2021 年 1 月 1 日-2021 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，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	3.05%	0.89%	-0.86%	0.57%	3.91%	0.32%
过去三个月	6.12%	1.05%	3.06%	0.66%	3.06%	0.39%
过去六个月	3.72%	1.43%	2.46%	0.93%	1.26%	0.50%



过去一年	24.85%	1.38%	17.54%	0.95%	7.31%	0.43%
自基金合同生效起至今	31.23%	1.38%	18.57%	0.94%	12.66%	0.44%

光大阳光混合 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	3.05%	0.89%	-0.86%	0.57%	3.91%	0.32%
过去三个月	6.12%	1.05%	3.06%	0.66%	3.06%	0.39%
过去六个月	3.73%	1.43%	2.46%	0.93%	1.27%	0.50%
过去一年	24.88%	1.38%	17.54%	0.95%	7.34%	0.43%
自基金合同生效起至今	28.88%	1.38%	17.92%	0.94%	10.96%	0.44%

光大阳光混合 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	2.98%	0.89%	-0.86%	0.57%	3.84%	0.32%
过去三个月	5.91%	1.05%	3.06%	0.66%	2.85%	0.39%
过去六个月	3.32%	1.43%	2.46%	0.93%	0.86%	0.50%
过去一年	24.13%	1.38%	17.54%	0.95%	6.59%	0.43%

自基金合同生效起 至今	28.10%	1.38%	17.92%	0.94%	10.18%	0.44%
----------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

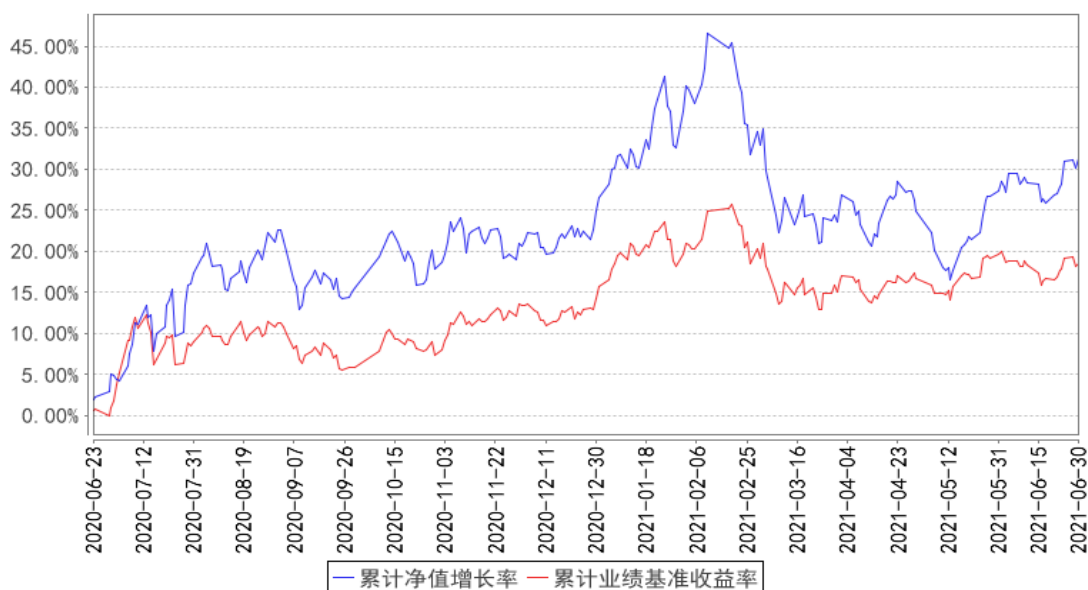
注：1、自基金合同生效日起至今指 2020 年 06 月 23 日-2021 年 06 月 30 日；

2、业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×20%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%。

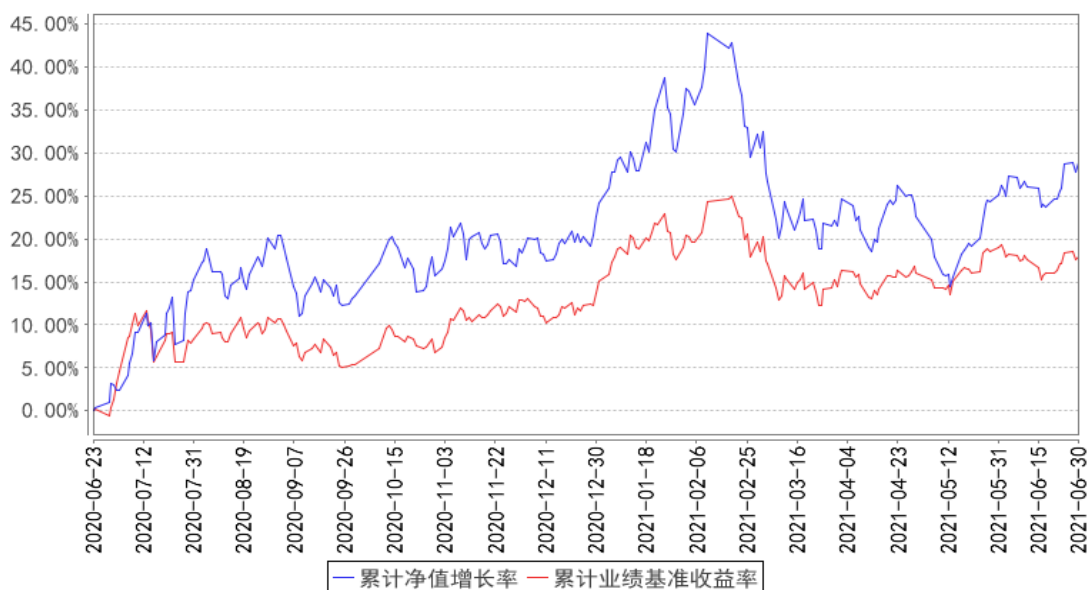
3、B 类份额设立日为 2020 年 6 月 23 日、C 类份额设立日为 2020 年 6 月 23 日。

### 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

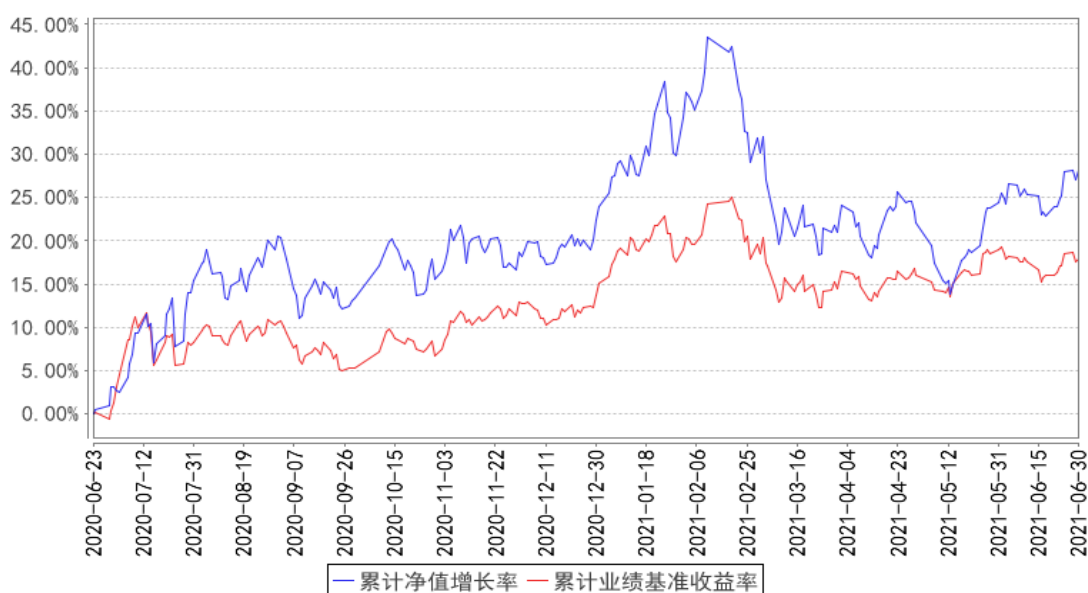
光大阳光混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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2021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		
孟巍	研究部总经理	2020年06月23	-	7	孟巍先生，复旦大学微电子学学士，复旦大学集成电路工程硕士，从事行业研究相

		日			关工作多年，具有较强的复合专业背景。曾任广发证券发展研究中心研究员，上海光大证券资产管理有限公司权益部研究员及权益公募投资部副总经理，现任研究部总经理。
--	--	---	--	--	--

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。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本集合计划管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及集合计划合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作集合计划资产，在严格控制风险的基础上，为集合计划份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本集合计划运作合规，不存在违反集合计划合同和损害集合计划份额持有人利益的行为。

## 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

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《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》，将公司已经管理、未来可能管理的所有公募及私募资产管理产品的投资组合等不同资产组合参与的投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节均纳入公平交易管理，在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动，建立对公平交易的执行、监督及审核流程，严禁在不同投资组合之间进行利益输送。

### 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

A 股今年的运行再次证明了短期市场的不可预期性，也证明“标签化”投资的不可取。无论是年初市场参与者对于风格切换的讨论还是一季度对美债收益率快速上行的担忧，A 股市场则仍然保持自己的运行规律，继续呈现出精彩的结构行情，以半导体和新能源汽车为代表的新兴产业依然表现强势，而过去几年一些“核心资产”标签的所谓白马股则接连出现掉队，部分过去几年的强势板块也出现大幅回调，“茅指数”风光不再，“宁组合”成为市场焦点。

我们坚持认为“阳光下没有新鲜事”，无论是“茅指数”还是“宁组合”，离开深入研究的标签化投资风险依然很大，面对更加极端化的机构性行情，过去的一个报告期我们坚持有所为有所不为，对于交易过度拥挤的赛道我们始终保持谨慎态度，坚持基于基本面和估值权衡下的价值投资，同时对市场关注低的板块加大研究和投资的布局，因为极端的机构性行情使得部分板块和个股的价格十分有吸引力，选股上更有余地，我们对权益市场较年初则更为乐观，依然保持较高的仓位和集中度。板块上我们对于制造业、硬科技板块深入研究和布局，同时积极关注新兴消费等投资机遇。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 06 月 30 日，光大阳光混合 A 类份额净值为 4.0471 元，本报告期份额净值增长率为 3.72%；光大阳光混合 B 类份额净值为 4.0481 元，本报告期份额净值增长率为 3.73%；光大阳光混合 C 类份额净值为 4.0237 元，本报告期份额净值增长率为 3.32%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年中国经济仍然表现出较强韧性，疫情虽有局部反复，但生产活动受限可控，消费恢复虽然低预期，但强劲的出口仍对经济有很好的拉动作用。展望下半年，我们判断经济出口可能会有回落，但绝对值仍将维持高位，同时国内财政和货币政策的空间仍然较大，宏观经济预计仍将平稳。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

###### (1) 日常估值流程

集合计划的估值由集合计划会计负责，集合计划会计对公司所管理的集合计划以集合计划为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同产品之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。

集合计划会计核算独立于公司会计核算。集合计划会计核算采用专用的财务核算软件系统进行产品核算及账务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行集合计划估值。集合计划会计核算采用集合计划管理人与托管行双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就集合计划的会计核算、集合计划估值等与托管银行进行核对；每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。集合计划会计除设有专职集合计划会计核算岗外，还设有集合计划会计复核岗位，负责集合计划会计核算的日常事后复核工作，确保集合计划净值核算无误。

配备的集合计划会计具备会计资格和基金从业资格，在集合计划核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验，熟悉及了解集合计划估值法规、政策和方法。

## (2) 特殊业务估值流程

根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》的相关规定，本公司成立有估值委员会，成员由投资与研究部门、运营保障部、合规监察部、风险与绩效管理部与营销管理部相关人员组成。

### 2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与或决定基金日常估值。

基金经理参与估值小组对停牌股票估值的讨论，发表相关意见和建议，与估值小组成员共同商定估值原则和政策。

3、本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4、定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

## 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内集合计划未进行利润分配。

## 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，中国光大银行股份有限公司在光大阳光混合型集合资产管理计划（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

### 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，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用

开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

### 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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《光大阳光混合型集合资产管理计划 2021 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

## § 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：光大阳光混合型集合资产管理计划

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	161,867,748.09	98,660,252.72
结算备付金		387,406.91	1,250,078.91
存出保证金		257,786.81	401,077.37
交易性金融资产	6.4.7.2	1,175,634,143.53	1,330,086,982.91
其中：股票投资		1,175,634,143.53	1,330,086,982.91
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		40,992,373.59	-
应收利息	6.4.7.5	55,848.26	37,085.21
应收股利		-	42,325.51
应收申购款		3,159.92	1,970.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,379,198,467.11	1,430,479,773.07
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 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		-	-
应付证券清算款		55,316,252.97	101.81
应付赎回款		1,074,166.16	1,575,022.38
应付管理人报酬		1,593,987.62	1,762,419.13
应付托管费		212,531.69	234,989.24
应付销售服务费		400.60	81.97
应付交易费用	6.4.7.7	377,847.14	923,195.89
应交税费		9,272,913.47	11,578,651.31
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	364,354.38	405,000.00
负债合计		68,212,454.03	16,479,461.73
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	323,935,554.00	362,389,008.83
未分配利润	6.4.7.10	987,050,459.08	1,051,611,302.51
所有者权益合计		1,310,986,013.08	1,414,000,311.34
负债和所有者权益总计		1,379,198,467.11	1,430,479,773.07

注：报告截至日 2021 年 06 月 30 日，集合计划份额总额 323,935,554.00 份，光大阳光混合 A 类份额总额为 321,923,802.06 份，集合计划份额净值 4.0471 元；光大阳光混合 B 类份额总额为 1,878,701.49 份，光大阳光混合 B 类份额净值为 4.0481 元；光大阳光混合 C 类份额总额为 133,050.45 份，光大阳光混合 C 类份额净值为 4.0237 元。

## 6.2 利润表

会计主体：光大阳光混合型集合资产管理计划

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 6 月 23 日（基金合 同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		67,969,889.64	73,094,554.77
1. 利息收入		739,414.93	62,395.44
其中：存款利息收入	6.4.7.11	739,414.93	62,395.44
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		-	-



证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		96,288,377.82	15,849,271.61
其中：股票投资收益	6.4.7.12	89,517,086.38	15,528,009.86
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	6,771,291.44	321,261.75
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-29,065,839.53	57,180,496.62
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	7,936.42	2,391.10
减：二、费用		15,820,193.26	1,333,694.85
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,969,541.28	470,408.22
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,329,272.12	62,721.09
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,068.94	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,502,198.75	288,255.71
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		2,920,169.01	506,544.79
7. 其他费用	6.4.7.20	97,943.16	5,765.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		52,149,696.38	71,760,859.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		52,149,696.38	71,760,859.92

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：光大阳光混合型集合资产管理计划

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	362,389,008.83	1,051,611,302.51	1,414,000,311.34

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	52,149,696.38	52,149,696.38
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-38,453,454.83	-116,710,539.81	-155,163,994.64
其中：1. 基金申购款	1,251,554.59	3,565,216.93	4,816,771.52
2. 基金赎回款	-39,705,009.42	-120,275,756.74	-159,980,766.16
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	323,935,554.00	987,050,459.08	1,310,986,013.08
项目	上年度可比期间 2020年6月23日（基金合同生效日）至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	457,787,745.93	954,028,528.97	1,411,816,274.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	71,760,859.92	71,760,859.92
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-2,589,879.18	-5,469,778.26	-8,059,657.44
其中：1. 基金申购款	64,948.12	135,351.88	200,300.00
2. 基金赎回款	-2,654,827.30	-5,605,130.14	-8,259,957.44
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填	-	-	-

列)			
五、期末所有者 权益(基金净值)	455,197,866.75	1,020,319,610.63	1,475,517,477.38

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>汪沛</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

光大阳光混合型集合资产管理计划是由光大阳光集合资产管理计划转型而来。本集合计划的管理人上海光大证券资产管理有限公司于 2020 年 6 月 9 日发布《光大阳光集合资产管理计划合同变更公告》。根据公告，光大阳光集合资产管理计划名称变更为“光大阳光混合型集合资产管理计划”，光大阳光集合资产管理计划份额转换为光大阳光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 6 月 23 日起《光大阳光混合型集合资产管理计划资产管理合同》、《光大阳光混合型集合资产管理计划托管协议》生效。本集合计划自资产管理合同变更生效日起存续期不得超过 3 年。本集合计划管理人为上海光大证券资产管理有限公司，托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《光大阳光混合型集合资产管理计划资产管理合同》的有关规定，本集合计划投资范围为：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（含创业板、中小板及其他经中国证监会允许集合计划投资的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。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 60%~95%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%）；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债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。本集合计划的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×20%+中证港股通综合指数(人民币)

收益率×20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《光大阳光混合型集合资产管理计划资产管理合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 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会计报表采用的会计政策、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

本集合计划报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2016]36 号《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《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《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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。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，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市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。对基金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。

(4) 基金卖出股票按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。

(5) 本集合计划的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
活期存款	161,867,748.09
定期存款	-
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	-
合计	161,867,748.09

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	917,574,118.06	1,175,634,143.53	258,060,025.47
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	917,574,118.06	1,175,634,143.53	258,060,025.47

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本集合计划本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 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

本集合计划本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 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任何买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	55,576.48
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	156.87
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-

应收申购款利息	10.51
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	104.40
合计	55,848.26

#### 6.4.7.6 其他资产

本集合计划本报告期末未持有其他应收款、待摊费用等其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	377,847.14
银行间市场应付交易费用	-
合计	377,847.14

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	11.22
应付证券出借违约金	-
预提费用	114,343.16
其他	250,000.00
合计	364,354.38

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

##### 光大阳光混合 A

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	361,338,293.08	361,338,293.08
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-39,414,491.02	-39,414,491.02
-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	321,923,802.06	321,923,802.06

##### 光大阳光混合 B

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
----	----------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,017,045.46	1,017,045.46
本期申购	1,063,932.45	1,063,932.45
本期赎回（以“-”号填列）	-202,276.42	-202,276.42
-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	1,878,701.49	1,878,701.49

光大阳光混合 C

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	33,670.29	33,670.29
本期申购	187,622.14	187,622.14
本期赎回（以“-”号填列）	-88,241.98	-88,241.98
-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	133,050.45	133,050.45

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

光大阳光混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,029,544,079.86	19,017,557.15	1,048,561,637.01
本期利润	80,855,299.95	-29,104,068.62	51,751,231.33
本期基金份额交易产生的变动数	-114,692,434.14	-4,698,816.99	-119,391,251.13
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-114,692,434.14	-4,698,816.99	-119,391,251.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	995,706,945.67	-14,785,328.46	980,921,617.21

光大阳光混合 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------



上年度末	3,034,082.54	-81,870.03	2,952,212.51
本期利润	338,647.51	45,184.07	383,831.58
本期基金份额交易产生的变动数	2,690,235.86	-299,739.33	2,390,496.53
其中：基金申购款	3,317,878.75	-300,712.86	3,017,165.89
基金赎回款	-627,642.89	973.53	-626,669.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,062,965.91	-336,425.29	5,726,540.62

光大阳光混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	104,019.64	-6,566.65	97,452.99
本期利润	21,588.45	-6,954.98	14,633.47
本期基金份额交易产生的变动数	315,695.51	-25,480.72	290,214.79
其中：基金申购款	601,077.72	-53,026.68	548,051.04
基金赎回款	-285,382.21	27,545.96	-257,836.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	441,303.60	-39,002.35	402,301.25

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	726,268.81
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	9,249.42
其他	3,896.70
合计	739,414.93

注：其他为交易所结算保证金、直销申购款利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	89,517,086.38
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	89,517,086.38

#### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	549,727,574.81
减：卖出股票成本总额	460,210,488.43
买卖股票差价收入	89,517,086.38

#### 6.4.7.12.3 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。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本集合计划本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本集合计划本报告期无买卖债券差价收入。

##### 6.4.7.13.3 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。

##### 6.4.7.13.4 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。

##### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本集合计划本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本集合计划本报告期末进行贵金属投资。

##### 6.4.7.14.2 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。

##### 6.4.7.14.3 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。

##### 6.4.7.14.4 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。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 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。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本集合计划本报告期无衍生工具收益-其他投资收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	6,771,291.44
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	6,771,291.44

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-30,045,980.24
股票投资	-30,045,980.24
债券投资	-

资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-980,140.71
合计	-29,065,839.53

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	7,936.42
合计	7,936.42

注：本集合计划本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	1,502,198.75
银行间市场交易费用	-
合计	1,502,198.75

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
合计	97,943.16

#### 6.4.7.21 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	集合计划管理人、集合计划销售机构
中国光大银行股份有限公司	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

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年6月23日（基金合同生效日） 至2020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	882,042,377.57	100.00	151,744,855.12	100.00

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本集合计划本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本集合计划本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本集合计划本报告期内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 2021年1月1日至2021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	804,845.95	100.00	377,847.14	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2020年6月23日(基金合同生效日)至2020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	128,797.67	100.00	1,324,824.34	100.00

#### 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 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年6月23日(基金合 同生效日)至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	9,969,541.28	470,408.22
其中：支付销售机构的客户维护费	3,249,997.32	63,899.02

注：1、本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 1.50% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、实际支付销售机构的客户维护费以本集合计划管理人和各销售机构对账确认的金额为准。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年6月23日(基金合 同生效日)至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,329,272.12	62,721.09

注：本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	光大阳光混合 A	光大阳光混合 B	光大阳光混合 C	合计
上海光大证券资产管理 有限公司	-	-	743.04	743.04
合计	-	-	743.04	743.04
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2020 年 6 月 23 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	光大阳光混合 A	光大阳光混合 B	光大阳光混合 C	合计
-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

注：本集合计划 C 类份额的销售服务费率按前一日 C 类集合计划资产净值的 0.8% 的年费率计提。

C 类集合计划份额的销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times R\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日 C 类集合计划份额应计提的集合计划销售服务费

E 为前一日 C 类集合计划份额的集合计划资产净值

R% 为该日适用销售服务费率

集合计划销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 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内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内未与关联方进行转融通证券出借业务。

##### 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内未与关联方进行转融通证券出借业务。

#### 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

本报告期内基金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

份额单位：份

光大阳光混合 A

关联方名称	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
光大证券股份有限公司	51,599,675.91	15.93	-	-

##### 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年6月23日（基金合同生效日）至2020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
中国光大银行股份有限公司	161,867,748.09	726,268.81	143,638,356.99	58,619.78

注：本集合计划的银行存款由托管人中国光大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内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内没有需作说明的其他关联交易事项。



### 6.4.11 利润分配情况

本集合计划本报告期内未进行利润分配。

### 6.4.12 期末(2021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	可流通日	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
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股锁定	9.19	40.38	158	1,452.02	6,380.04	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月7日	新股锁定	10.76	22.20	181	1,947.56	4,018.20	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股锁定	13.39	30.10	100	1,339.00	3,010.00	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年7月20日	新股锁定	13.87	29.55	90	1,248.30	2,659.50	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	新股锁定	4.31	13.11	218	939.58	2,857.98	-
300932	三友联众	2021年1月15日	2021年7月22日	新股锁定	24.69	31.71	201	4,962.69	6,373.71	-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	新股锁定	3.37	10.44	606	2,042.22	6,326.64	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新股锁定	12.25	53.71	92	1,127.00	4,941.32	-
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	新股锁定	12.76	43.38	139	1,773.64	6,029.82	-
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	新股锁定	5.31	28.52	243	1,290.33	6,930.36	-
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	新股锁定	9.79	23.01	151	1,478.29	3,474.51	-

300945	曼卡龙	2021年 2月3日	2021年 8月10 日	新股锁 定	4.56	18.88	218	994.08	4,115.84	-
300948	冠中生 态	2021年 2月18 日	2021年 8月25 日	新股锁 定	8.63	27.42	89	1,157.00	2,440.38	2021年6 月4日每 10股转增 5股。
300950	德固特	2021年 2月24 日	2021年 9月3 日	新股锁 定	8.41	39.13	103	866.23	4,030.39	-
300955	嘉亨家 化	2021年 3月24 日	2021年 9月24 日	新股锁 定	16.53	46.07	113	1,867.89	5,205.91	-
300958	建工修 复	2021年 3月18 日	2021年 9月29 日	新股锁 定	8.53	27.22	153	1,305.09	4,164.66	-
300960	通业科 技	2021年 3月22 日	2021年 9月29 日	新股锁 定	12.08	23.06	126	1,522.08	2,905.56	-
300961	深水海 纳	2021年 3月23 日	2021年 9月30 日	新股锁 定	8.48	22.07	222	1,882.56	4,899.54	-
300962	中金辐 照	2021年 3月29 日	2021年 10月11 日	新股锁 定	3.40	16.37	290	986.00	4,747.30	-
300963	中洲特 材	2021年 3月30 日	2021年 10月11 日	新股锁 定	12.13	22.49	138	1,673.94	3,103.62	-
300967	晓鸣股 份	2021年 4月2日	2021年 10月13 日	新股锁 定	4.54	11.54	230	1,044.20	2,654.20	-
300972	万辰生 物	2021年 4月8日	2021年 10月19 日	新股锁 定	7.19	12.65	119	855.61	1,505.35	-
300973	立高食 品	2021年 4月8日	2021年 10月15 日	新股锁 定	28.28	115.71	234	6,617.52	27,076.14	-
300975	商络电 子	2021年 4月14 日	2021年 10月21 日	新股锁 定	5.48	13.03	241	1,320.68	3,140.23	-
300979	华利集 团	2021年 4月15 日	2021年 10月26 日	新股锁 定	33.22	87.50	900	29,898.00	78,750.00	-
300985	致远新	2021年	2021年	新股锁	24.90	24.81	170	4,233.00	4,217.70	-

	能	4月21日	10月29日	定							
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股锁定	14.79	30.57	135	1,996.65	4,126.95		-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	新股锁定	6.79	26.81	147	998.13	3,941.07		-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股锁定	13.06	26.51	119	1,554.14	3,154.69		-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股锁定	9.36	20.32	91	851.76	1,849.12		-
300996	普联软件	2021年5月26日	2021年12月3日	新股锁定	20.81	42.23	103	2,143.43	4,349.69		-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新股锁定	6.02	21.32	100	602.00	2,132.00		-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股锁定	18.71	57.62	96	1,796.16	5,531.52		-
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	新股锁定	5.29	14.44	147	777.63	2,122.68		-
301009	可靠股份	2021年6月8日	2021年12月17日	新股锁定	12.54	27.89	334	4,188.36	9,315.26		-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	新股锁定	7.83	17.61	100	783.00	1,761.00		-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股锁定	14.20	33.84	78	1,107.60	2,639.52		-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股锁定	8.05	24.26	83	668.15	2,013.58		-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	新股锁定	7.64	38.83	199	1,520.36	7,727.17		-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	新股锁定	13.75	32.98	108	1,485.00	3,561.84		-

605162	新中港	2021年 6月29 日	2021年 7月7 日	新股未 上市	6.07	6.07	330	2,003.10	2,003.10	-
301017	漱玉平民	2021年 6月23 日	2021年 7月5 日	新股未 上市	8.86	8.86	3,654	32,374.44	32,374.44	-
301018	申菱环境	2021年 6月28 日	2021年 7月7 日	新股未 上市	8.29	8.29	2,672	22,150.88	22,150.88	-
301020	密封科技	2021年 6月28 日	2021年 7月6 日	新股未 上市	10.64	10.64	1,474	15,683.36	15,683.36	-
688087	英科再生	2021年 6月30 日	2021年 7月9 日	新股未 上市	21.96	21.96	1,189	26,110.44	26,110.44	-
688239	航宇科技	2021年 6月25 日	2021年 7月5 日	新股未 上市	11.48	11.48	1,233	14,154.84	14,154.84	-
688499	利元亨	2021年 6月23 日	2021年 7月1 日	新股未 上市	38.85	38.85	951	36,946.35	36,946.35	-

#### 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

本集合计划在日常经营活动中涉及的风险主要包括市场风险、流动性风险及信用风险。管理人制定了相应的政策和程序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。

本集合计划管理人建立了由风险管理部、合规部等部门组成的各风险管理职能部门，独立开展对业务和相关操作的风险评价。各风险管理职能部门互相配合，建立信息沟通机制，从事前、事中、事后全面进行业务风险监控。此外，业务部门也建立了自身的内部控制机制，主要由授权体系和业务后台部门信息监控机制组成。

#### **6.4.13.2 信用风险**

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

本集合计划的银行存款存放在本集合计划的托管行中国光大银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本集合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。

本集合计划债券投资的信用评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

于 2021 年 6 月 30 日，本集合计划持有的债券占集合计划资产净值的比例为 0.00%（2020 年 12 月 31 日：0.00%）。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

无余额。

##### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

无余额。

##### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

无余额。

##### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

无余额。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

#### 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。

本集合计划所持有的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(2021 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券”，本报告期内本集合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。

本集合计划的管理人定期对本集合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 2021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	161,867,748.09	-	-	-	161,867,748.09
结算备付金	387,406.91	-	-	-	387,406.91
存出保证金	257,786.81	-	-	-	257,786.81
交易性金融资产	-	-	-	1,175,634,143.53	1,175,634,143.53
应收利息	-	-	-	55,848.26	55,848.26
应收申购款	-	-	-	3,159.92	3,159.92
应收证券清算款	-	-	-	40,992,373.59	40,992,373.59
资产总计	162,512,941.81	-	-	1,216,685,525.30	1,379,198,467.11
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,074,166.16	1,074,166.16
应付管理人报酬	-	-	-	1,593,987.62	1,593,987.62
应付托管费	-	-	-	212,531.69	212,531.69
应付证券清算款	-	-	-	55,316,252.97	55,316,252.97
应付销售服务费	-	-	-	400.60	400.60
应付交易费用	-	-	-	377,847.14	377,847.14
应交税费	-	-	-	9,272,913.47	9,272,913.47
其他负债	-	-	-	364,354.38	364,354.38
负债总计	-	-	-	68,212,454.03	68,212,454.03
利率敏感度缺口	162,512,941.81	-	-	-1,148,473,071.27	1,310,986,013.08
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	98,660,252.72	-	-	-	98,660,252.72
结算备付金	1,250,078.91	-	-	-	1,250,078.91
存出保证金	401,077.37	-	-	-	401,077.37
交易性金融资产	-	-	-	1,330,086,982.91	1,330,086,982.91
应收利息	-	-	-	37,085.21	37,085.21
应收股利	-	-	-	42,325.51	42,325.51
应收申购款	-	-	-	1,970.44	1,970.44
资产总计	100,311,409.00	-	-	1,330,168,364.07	1,430,479,773.07
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,575,022.38	1,575,022.38
应付管理人报酬	-	-	-	1,762,419.13	1,762,419.13
应付托管费	-	-	-	234,989.24	234,989.24
应付证券清算款	-	-	-	101.81	101.81

应付销售服务费	-	-	-	81.97	81.97
应付交易费用	-	-	-	923,195.89	923,195.89
应交税费	-	-	-	11,578,651.31	11,578,651.31
其他负债	-	-	-	405,000.00	405,000.00
负债总计	-	-	-	16,479,461.73	16,479,461.73
利率敏感度缺口	100,311,409.00	-	-	-1,313,688,902.34	1,414,000,311.34

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予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本集合计划本报告期末未持有交易性债券投资（2020 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本集合计划资产净值无重大影响（2020 年 12 月 31 日：同）。

#### 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。本集合计划持有以非记账本位币人民币计价的资产与负债，因此存在相应的外汇风险。本集合计划管理人每日对本集合计划的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	219,886,999.90	-	219,886,999.90
资产合计	-	219,886,999.90	-	219,886,999.90
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	219,886,999.90	-	219,886,999.90
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计



	币元			
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	241,127,494.31	-	241,127,494.31
资产合计	-	241,127,494.31	-	241,127,494.31
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	241,127,494.31	-	241,127,494.31

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
	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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	港币相对人民币升值 5%	10,994,350.00	12,056,374.72
	港币相对人民币贬值 5%	-10,994,350.00	-12,056,374.72

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是集合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 2021年6月30日	上年度末 2020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	1,175,634,143.53	89.68	1,330,086,982.91	94.07
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	1,175,634,143.53	89.68	1,330,086,982.91	94.07

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	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 (2021 年 6 月 30 日)	上年度末 (2020 年 12 月 31 日)
分析	业绩比较基准上升 5%	81,936,625.82	77,770,017.12
	业绩比较基准下降 5%	-81,936,625.82	-77,770,017.12

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由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决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 06 月 30 日，本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 1,175,224,535.13 元，属于第二层次的余额为 409,608.4 元，无属于第

三层次的余额。

(ii) 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。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，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股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 06 月 30 日，本集合计划未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本集合计划无需要说明的其他重要事项。

## § 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	1,175,634,143.53	85.24
	其中：股票	1,175,634,143.53	85.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	-	-
	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	162,255,155.00	11.76
8	其他各项资产	41,309,168.58	3.00
9	合计	1,379,198,467.11	100.00

注：本集合计划本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为：219,886,999.90 元人民

币，占期末集合计划资产净值比例 16.77%。

## 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	71,594.67	0.01
B	采矿业	29,139.77	0.00
C	制造业	845,795,307.47	64.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,763.97	0.00
E	建筑业	5,896.11	0.00
F	批发和零售业	293,081.47	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	23,607.42	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	69,220,475.15	5.28
J	金融业	27,721,098.24	2.11
K	房地产业	12,220,194.36	0.93
L	租赁和商务服务业	5,433.18	0.00
M	科学研究和技术服务业	86,205.98	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	228,173.78	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	11,172.06	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	955,747,143.63	72.90

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	-	-
消费者非必需品	87,988,715.64	6.71
消费者常用品	31,321,155.36	2.39
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	16,458.29	0.00
工业	-	-
信息技术	-	-
电信服务	87,662,623.49	6.69
公用事业	-	-
房地产	12,898,047.12	0.98

合计	219,886,999.90	16.77
----	----------------	-------

注：以上行业分类采用港交所二级分类标准。

### 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	603906	龙蟠科技	3,787,926	132,577,410.00	10.11
2	300408	三环集团	2,474,704	104,976,943.68	8.01
3	00700	腾讯控股	180,400	87,662,623.49	6.69
4	600309	万华化学	722,550	78,627,891.00	6.00
5	688099	晶晨股份	614,789	68,979,325.80	5.26
6	03690	美团-W	223,200	59,504,770.02	4.54
7	603043	广州酒家	2,123,895	54,626,579.40	4.17
8	000858	五粮液	178,300	53,113,787.00	4.05
9	000301	东方盛虹	1,960,200	40,968,180.00	3.12
10	002507	涪陵榨菜	1,072,101	40,375,323.66	3.08
11	603596	伯特利	1,095,200	39,153,400.00	2.99
12	600519	贵州茅台	18,870	38,809,929.00	2.96
13	002475	立讯精密	776,051	35,698,346.00	2.72
14	002643	万润股份	1,990,600	35,392,868.00	2.70
15	002415	海康威视	534,300	34,462,350.00	2.63
16	000333	美的集团	468,101	33,408,368.37	2.55
17	603337	杰克股份	1,126,082	30,100,171.86	2.30
18	01765	希望教育	18,306,000	28,483,945.62	2.17
19	601318	中国平安	430,000	27,640,400.00	2.11
20	600426	华鲁恒升	830,190	25,694,380.50	1.96
21	600486	扬农化工	225,400	25,192,958.00	1.92
22	00168	青岛啤酒股份	230,000	15,999,234.24	1.22
23	00291	华润啤酒	264,000	15,321,921.12	1.17
24	600132	重庆啤酒	74,216	14,691,057.20	1.12
25	600690	海尔智家	523,800	13,571,658.00	1.04
26	02202	万科企业	637,900	12,898,047.12	0.98
27	000002	万科A	511,500	12,178,815.00	0.93
28	000636	风华高科	227,800	6,884,116.00	0.53
29	002541	鸿路钢构	72,491	4,229,849.85	0.32
30	300979	华利集团	9,000	1,001,340.00	0.08
31	688161	威高骨科	1,729	183,360.45	0.01
32	301009	可靠股份	3,331	110,254.22	0.01
33	301015	百洋医药	1,985	108,028.93	0.01
34	300614	百川畅银	1,575	84,768.48	0.01

35	300925	法本信息	2,945	77,424.05	0.01
36	301002	崧盛股份	952	75,637.92	0.01
37	300962	中金辐照	2,891	67,171.30	0.01
38	300932	三友联众	2,008	64,468.76	0.00
39	301006	迈拓股份	2,021	61,640.50	0.00
40	300940	南极光	1,382	61,467.62	0.00
41	300996	普联软件	1,025	56,341.27	0.00
42	300955	嘉亨家化	1,122	56,180.59	0.00
43	688621	阳光诺和	623	55,322.40	0.00
44	300987	川网传媒	1,465	55,290.35	0.00
45	300961	深水海纳	2,211	53,749.38	0.00
46	300986	志特新材	1,345	52,853.65	0.00
47	300922	天秦装备	1,516	52,802.28	0.00
48	688345	博力威	717	52,735.35	0.00
49	688314	康拓医疗	490	51,763.60	0.00
50	300937	药易购	913	50,112.74	0.00
51	300985	致远新能	1,691	48,159.39	0.00
52	300920	润阳科技	1,398	47,084.64	0.00
53	301016	雷尔伟	1,077	45,364.50	0.00
54	300958	建工修复	1,523	44,141.26	0.00
55	300975	商络电子	2,409	43,183.19	0.00
56	300945	曼卡龙	2,171	42,648.53	0.00
57	300950	德固特	1,029	42,051.95	0.00
58	300991	创益通	1,185	41,701.25	0.00
59	300963	中洲特材	1,376	41,481.62	0.00
60	300917	特发服务	1,496	41,379.36	0.00
61	688113	联测科技	601	39,545.80	0.00
62	300948	冠中生态	1,322	38,086.41	0.00
63	300967	晓鸣股份	2,298	37,086.40	0.00
64	688499	利元亨	951	36,946.35	0.00
65	300943	春晖智控	1,507	35,543.91	0.00
66	301011	华立科技	775	35,189.42	0.00
67	688662	富信科技	957	35,141.04	0.00
68	600906	财达证券	2,081	35,127.28	0.00
69	688685	迈信林	1,314	34,098.30	0.00
70	301017	漱玉平民	3,654	32,374.44	0.00
71	688191	智洋创新	1,498	32,356.80	0.00
72	605499	东鹏饮料	129	32,353.20	0.00
73	688117	圣诺生物	660	31,944.00	0.00
74	003035	南网能源	3,107	30,883.58	0.00
75	300960	通业科技	1,260	30,801.96	0.00
76	300927	江天化学	1,000	30,343.00	0.00

77	300998	宁波方正	999	29,965.04	0.00
78	688260	昀冢科技	1,390	29,801.60	0.00
79	301007	德迈仕	1,465	29,233.94	0.00
80	301012	扬电科技	824	27,770.74	0.00
81	300973	立高食品	234	27,076.14	0.00
82	001203	大中矿业	1,306	26,315.90	0.00
83	688087	英科再生	1,189	26,110.44	0.00
84	300992	泰福泵业	908	25,370.55	0.00
85	688359	三孚新科	710	25,205.00	0.00
86	301010	晶雪节能	992	23,053.04	0.00
87	301018	申菱环境	2,672	22,150.88	0.00
88	300910	瑞丰新材	208	21,746.40	0.00
89	688597	煜邦电力	1,714	21,630.68	0.00
90	688655	迅捷兴	1,029	20,991.60	0.00
91	601963	重庆银行	1,920	20,870.40	0.00
92	688395	正弦电气	746	20,388.18	0.00
93	300972	万辰生物	1,190	19,798.03	0.00
94	688517	金冠电气	1,392	19,780.32	0.00
95	000786	北新建材	500	19,625.00	0.00
96	688067	爱威科技	565	17,735.35	0.00
97	601156	东航物流	726	17,184.42	0.00
98	601665	齐鲁银行	1,772	16,479.60	0.00
99	02269	药明生物	139	16,458.29	0.00
100	301020	密封科技	1,474	15,683.36	0.00
101	688681	科汇股份	806	14,814.28	0.00
102	003026	中晶科技	152	14,304.72	0.00
103	688239	航宇科技	1,233	14,154.84	0.00
104	605337	李子园	230	13,685.00	0.00
105	600032	浙江新能	1,059	12,877.44	0.00
106	605090	九丰能源	363	11,764.83	0.00
107	300890	翔丰华	215	11,739.00	0.00
108	300911	亿田智能	168	11,639.04	0.00
109	605339	南侨食品	254	10,967.72	0.00
110	003021	兆威机电	179	10,933.32	0.00
111	300892	品渥食品	223	10,231.24	0.00
112	605077	华康股份	221	10,082.02	0.00
113	300891	惠云钛业	562	9,773.18	0.00
114	300895	铜牛信息	280	9,522.80	0.00
115	605089	味知香	108	9,398.16	0.00
116	003031	中瓷电子	154	8,423.80	0.00
117	300907	康平科技	283	8,325.86	0.00
118	300908	仲景食品	139	8,283.01	0.00

119	601528	瑞丰银行	528	8,220.96	0.00
120	603759	海天股份	382	7,831.00	0.00
121	605296	神农集团	159	7,504.80	0.00
122	001206	依依股份	116	7,368.32	0.00
123	001201	东瑞股份	176	7,205.44	0.00
124	300893	松原股份	318	7,097.76	0.00
125	300942	易瑞生物	243	6,930.36	0.00
126	300913	兆龙互连	259	6,785.80	0.00
127	605122	四方新材	250	6,675.00	0.00
128	003020	立方制药	127	6,502.40	0.00
129	300933	中辰股份	606	6,326.64	0.00
130	605098	行动教育	108	6,077.16	0.00
131	001207	联科科技	174	5,761.14	0.00
132	300889	爱克股份	237	5,759.10	0.00
133	605305	中际联合	107	5,630.34	0.00
134	605080	浙江自然	88	5,526.40	0.00
135	603836	海程邦达	249	5,433.18	0.00
136	605016	百龙创园	166	5,305.36	0.00
137	603511	爱慕股份	158	5,214.00	0.00
138	003032	传智教育	162	5,094.90	0.00
139	605377	华旺科技	321	4,956.24	0.00
140	605389	长龄液压	84	4,929.12	0.00
141	003025	思进智能	159	4,825.65	0.00
142	003027	同兴环保	175	4,768.75	0.00
143	003029	吉大正元	177	4,219.68	0.00
144	605196	华通线缆	302	4,143.44	0.00
145	300926	博俊科技	181	4,018.20	0.00
146	605055	迎丰股份	422	4,017.44	0.00
147	003038	鑫铂股份	142	3,879.44	0.00
148	605180	华生科技	102	3,774.00	0.00
149	003041	真爱美家	133	3,763.90	0.00
150	003037	三和管桩	279	3,671.64	0.00
151	003030	祖名股份	129	3,632.64	0.00
152	605189	富春染织	150	3,613.50	0.00
153	605319	无锡振华	195	3,498.30	0.00
154	603324	盛剑环境	96	3,492.48	0.00
155	001202	炬申股份	174	3,417.36	0.00
156	003023	彩虹集团	112	3,393.60	0.00
157	003036	泰坦股份	215	3,313.15	0.00
158	605286	同力日升	159	3,251.55	0.00
159	605228	神通科技	345	3,249.90	0.00
160	003004	声迅股份	112	3,152.80	0.00



161	605303	园林股份	165	3,040.95	0.00
162	001205	盛航股份	92	3,005.64	0.00
163	605133	嵘泰股份	136	2,948.48	0.00
164	605259	绿田机械	82	2,923.30	0.00
165	605208	永茂泰	133	2,903.39	0.00
166	300931	通用电梯	218	2,857.98	0.00
167	605268	王力安防	207	2,856.60	0.00
168	605289	罗曼股份	99	2,855.16	0.00
169	603171	税友股份	148	2,841.60	0.00
170	605086	龙高股份	119	2,823.87	0.00
171	300929	华骐环保	90	2,659.50	0.00
172	605155	西大门	99	2,177.01	0.00
173	605162	新中港	330	2,003.10	0.00
174	605011	杭州热电	145	1,287.60	0.00

#### 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	603906	龙蟠科技	45,522,989.27	3.22
2	603337	杰克股份	41,367,949.20	2.93
3	000301	东方盛虹	40,749,537.63	2.88
4	300408	三环集团	29,049,803.78	2.05
5	600690	海尔智家	18,059,651.80	1.28
6	00168	青岛啤酒股份	16,192,342.16	1.15
7	02202	万科企业	15,828,160.55	1.12
8	688099	晶晨股份	15,391,498.96	1.09
9	000002	万科A	15,113,482.00	1.07
10	00291	华润啤酒	15,083,435.25	1.07
11	600132	重庆啤酒	12,769,567.52	0.90
12	603596	伯特利	12,375,206.22	0.88
13	002643	万润股份	10,325,962.00	0.73
14	688188	柏楚电子	8,988,330.22	0.64
15	600426	华鲁恒升	6,702,156.20	0.47
16	000636	风华高科	6,498,858.00	0.46
17	300207	欣旺达	4,498,933.00	0.32
18	603444	吉比特	4,490,242.00	0.32
19	002507	涪陵榨菜	3,907,638.00	0.28
20	002541	鸿路钢构	3,833,031.00	0.27

##### 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	603906	龙蟠科技	39,351,072.99	2.78
2	300529	健帆生物	34,374,923.11	2.43
3	600036	招商银行	34,196,351.84	2.42
4	002352	顺丰控股	33,063,853.00	2.34
5	000423	东阿阿胶	33,063,055.82	2.34
6	603444	吉比特	30,440,820.00	2.15
7	002064	华峰化学	30,170,924.40	2.13
8	002050	三花智控	25,409,812.76	1.80
9	300083	创世纪	25,403,426.00	1.80
10	06862	海底捞	22,995,030.82	1.63
11	002624	完美世界	22,400,612.76	1.58
12	300285	国瓷材料	21,703,021.75	1.53
13	01066	威高股份	21,449,853.30	1.52
14	000100	TCL 科技	18,647,574.00	1.32
15	000725	京东方 A	17,149,426.00	1.21
16	300207	欣旺达	16,149,604.00	1.14
17	600276	恒瑞医药	14,613,460.45	1.03
18	000651	格力电器	14,427,708.00	1.02
19	603043	广州酒家	12,111,274.00	0.86
20	600309	万华化学	10,515,230.00	0.74

#### 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	335,803,629.29
卖出股票收入（成交）总额	549,727,574.81

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

本集合计划本报告期末未持有债券。

#### 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

本集合计划本报告期末未持有债券。

#### 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。

#### 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。

#### 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本集合计划的投资目标。本集合计划在股指期货投资中将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，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

## 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

管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本集合计划的投资目标。本集合计划在股指期货投资中将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，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本集合计划本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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，本集合计划持有的“腾讯控股”因未及时披露公司重大事项，被国家市场监督管理总局公开处罚 50 万元（国市监处【2021】65 号）。

### 7.12.2 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有超出集合计划合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 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	257,786.81
2	应收证券清算款	40,992,373.59
3	应收股利	-
4	应收利息	55,848.26
5	应收申购款	3,159.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

-	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	41,309,168.58

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本集合计划本期末未持有转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 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。

#### 7.12.6 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（%）
光大阳光混合 A	2,040	157,805.79	65,027,151.08	20.20	256,896,650.98	79.8
光大阳光混合 B	127	14,792.93	-	-	1,878,701.49	100
光大阳光混合 C	138	964.13	-	-	133,050.45	100

合计	2,305	140,536.03	65,027,151.08	20.07	258,908,402.92	79.93
----	-------	------------	---------------	-------	----------------	-------

注：分级集合机构/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，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）。

### 8.2 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	光大阳光混合 A	76,599.30	0.02
	光大阳光混合 B	16,550.51	0.88
	光大阳光混合 C	24,207.20	18.19
	合计	117,357.01	0.04

### 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	光大阳光混合 A	0
	光大阳光混合 B	0
	光大阳光混合 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	光大阳光混合 A	0
	光大阳光混合 B	0
	光大阳光混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	光大阳光混合 A	光大阳光混合 B	光大阳光混合 C
基金合同生效日（2020年6月23日）基金份额总额	457,787,745.93	-	-
本报告期期初基金份额总额	361,338,293.08	1,017,045.46	33,670.29
本报告期基金总申购份额	-	1,063,932.45	187,622.14
减：本报告期基金总赎回份	39,414,491.02	202,276.42	88,241.98

额			
本报告期基金 拆分变动份额 (份额减少以 “-”填列)	-	-	-
本报告期期末 基金份额总额	321,923,802.06	1,878,701.49	133,050.45

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

本报告期内，本集合计划未召开份额持有人大会。

### 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，本集合计划管理人未发生重大人事变动。

### 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业务、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

本集合计划本报告期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

本集合计划报告期末改聘会计师事务所。

### 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

本报告期内，集合计划管理人，集合计划托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚情况。

### 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	882,042,377.57	100.00%	804,845.95	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交易而合计支付该券商的佣金合计，不单

指股票交易佣金。

## 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	-	-	-	-	-	-

注：本集合计划本报告期末租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

## 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	关于旗下光大阳光混合型集合资产管理计划 2021 年港股通非交易日暂停公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 01 月 20 日
2	关于旗下光大阳光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	2021 年 01 月 27 日
3	关于旗下光大阳光混合型集合资产管理计划增加代理销售机构并开通定期定额投资业务的公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 02 月 04 日
4	关于旗下光大阳光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	2021 年 04 月 30 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

本报告期内无单一投资者持有本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混合型集合资产管理计划合同变更的函；
- 2、《光大阳光混合型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《光大阳光混合型集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《光大阳光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

2021 年 8 月 31 日