

# 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 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：广发银行股份有限公司

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。

集合计划托管人广发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 .....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	15
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 .....	15
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	15
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 .....	15
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 .....	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 .....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	18
6.4 报表附注 .....	19
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>46</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	46
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 .....	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	57

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 .....	57
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 .....	57
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 .....	57
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 .....	57
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	58
7.12 市场中性策略执行情况 .....	58
7.13 投资组合报告附注 .....	58
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>59</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	61
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 .....	61
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>61</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>62</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	62
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 .....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
10.4 基金投资策略的改变 .....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	62
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 .....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	62
10.8 其他重大事件 .....	63
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>64</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 .....	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	64
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>64</b>
12.1 备查文件目录 .....	64
12.2 存放地点 .....	64
12.3 查阅方式 .....	64

## § 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	1,207,161,415.98 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	5,853,288.85 份	48,924,373.71 份	1,152,383,753.42 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	王葭芳
	联系电话	021-32068300	010-65169958
	电子邮箱	zhuyi1@ebscn.com	wangjiayang@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	北京市西城区菜市口大街 1 号院 2 号楼信托大厦	
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	《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	104,052.19	1,102,138.25	21,188,737.27
本期利润	78,359.72	886,372.94	13,593,367.09
加权平均基金份额本期利润	0.0118	0.0152	0.0085
本期加权平均净值利润率	1.08%	1.43%	0.80%
本期基金份额净值增长率	0.77%	1.02%	0.83%
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	493,075.46	3,311,121.23	72,207,848.38
期末可供分配基金份额利润	0.0842	0.0677	0.0627
期末基金资产净值	6,346,364.31	52,235,494.94	1,224,591,601.80
期末基金份额净值	1.0842	1.0677	1.0627
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	6.08%	6.77%	6.27%

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	1.14%	0.23%	0.21%	0.01%	0.93%	0.22%
过去三个月	-0.13%	0.22%	0.63%	0.01%	-0.76%	0.21%
过去六个月	0.77%	0.28%	1.25%	0.01%	-0.48%	0.27%

过去一年	3.82%	0.30%	2.53%	0.01%	1.29%	0.29%
自基金合同生效起至今	6.08%	0.27%	3.22%	0.01%	2.86%	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	1.18%	0.23%	0.21%	0.01%	0.97%	0.22%
过去三个月	0.00%	0.22%	0.63%	0.01%	-0.63%	0.21%
过去六个月	1.02%	0.28%	1.25%	0.01%	-0.23%	0.27%
过去一年	4.35%	0.30%	2.53%	0.01%	1.82%	0.29%
自基金合同生效起至今	6.77%	0.27%	3.22%	0.01%	3.55%	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	1.15%	0.23%	0.21%	0.01%	0.94%	0.22%
过去三个月	-0.10%	0.22%	0.63%	0.01%	-0.73%	0.21%
过去六个月	0.83%	0.28%	1.25%	0.01%	-0.42%	0.27%
过去一年	3.95%	0.30%	2.53%	0.01%	1.42%	0.29%

自基金合同生效起 至今	6.27%	0.27%	3.22%	0.01%	3.05%	0.26%
----------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

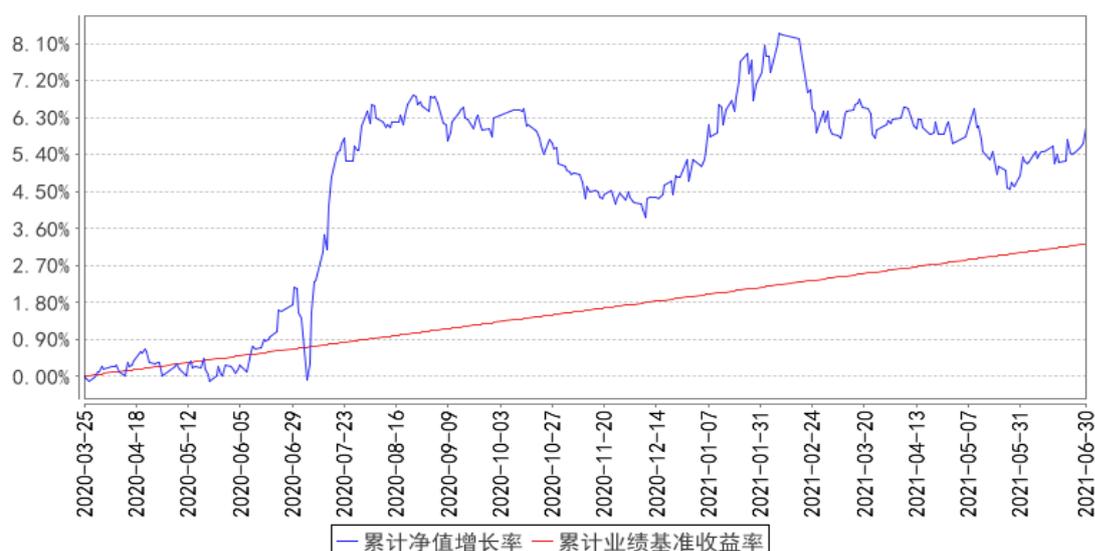
注：(1)自基金合同生效日起至今指2020年3月25日-2021年6月30日；

(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类份额设立日为2020年3月25日,C类份额设立日为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

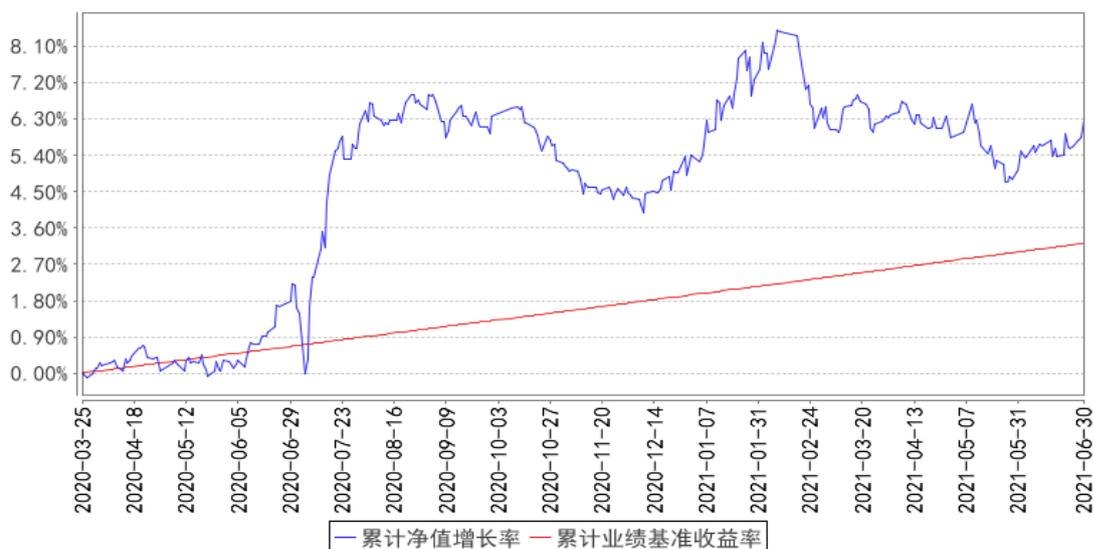
光大阳光对冲6个月持有混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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 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		
李聚华	总经理助理兼量化	2020 年 03 月 25	-	16	李聚华先生，美国哥伦比亚大学统计学硕士，CFA。曾任美国对冲基金

	公募投资部总经理	日			Aristeia Capital 高级分析师，光大证券金融市场总部执行董事。现任光证资管总经理助理兼量化公募投资部总经理。
李 禄	量化公募投资部投资经理	2020 年 03 月 25 日	-	5	李禄俊先生，本硕均毕业于北京大学，曾在中金基金管理公司量化投资部任职，2018 年加入光证资管，现任量化公募投资部投资经理。

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“离职日期”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。

3、根据管理人 2021 年 7 月 19 日公告，李聚华已不再担任本集合计划投资经理。

## 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

报告期内未发现本集合计划存在异常交易行为。报告期内，未出现涉及本集合计划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 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

2021 上半年，股市以牛年春节为节点，经历了两段截然不同的行情：春节前，抱团股持续冲高，带动权益型基金净值持续上涨，市场做多情绪高昂，作为正反馈，基金发行量也创下了新高；

牛年春节开市当天，市场短暂冲高以后，抱团股瓦解，市场大幅波动，股市急跌以后开始区间震荡，伴随着成交量的萎缩和换手率的逐渐下降。二季度以来我国宏观经济延续修复但结构分化显著：生产数据较为稳定，出口受益于发达经济体复苏而保持高增，但消费和制造业投资修复节奏十分缓慢，成为内需的薄弱环节。在不均衡修复背景下，国内政策紧缩力度较年初市场预期的温和一些，以“紧信用、宽货币”为主要搭配。二季度通胀问题受到市场较大关注，全球经济复苏、供需失衡的背景下，大宗商品价格大幅攀升，叠加基数原因，PPI 同比逐月抬升至高位；同时非食品价格上涨导致 CPI 同比也有所上行，但受猪肉价格下跌的影响，CPI 同比依然维持在较低位置。五月中起大宗商品价格在政策等引导下有所回落。受益于碳中和带来的供给收缩推动的价格上涨，以及疫情后全球经济复苏带来的需求提振，以钢铁有色为代表的大宗商品价格一路上涨，钢铁板块领涨市场，其它受益于碳中和概念的板块例如公用事业也取得了显著的超额收益。二季度以来，在经济景气复苏、流动性边际收敛的背景下，市场总体震荡，但风格切换活跃，结构性行情较为显著，在商品价格回落、流动性预期好转、人民币升值等因素影响下，成长风格自五月起开始表现出明显的超额收益。后续市场将持续聚焦高景气赛道中盈利持续高增长的优质公司。

国外经济方面，随着全球发达国家疫情总体好转，美国消费继续复苏，通胀走高，就业伴随疫苗接种总体恢复，失业率、制造业 PMI 和服务业 PMI 等经济指标均有所好转，美联储维持利率水平和资产购买规模，后续须密切关注美国就业恢复后美联储可能明确 taper 信号。债市方面，一季度债市触底反弹，利率债各期限到期收益率小幅上行或者不变，信用债全类别收益率均有下跌。一季度债券均衡配置，以中短期利率债为主。二季度债市在降准的利好下，债市迎来积极变化，因此后市将加大债券的整体配置比例。

本基金的投资逻辑是通过量化模型选择盈利优质的上市公司，同时结合估值因子、成长因子等选股模型甄选出胜率较高的个股组合，对冲股指期货以获得绝对收益，再根据风险模型控制个股、行业和风格的整体风险暴露。上半年市场风格的大幅波动对于对冲策略而言是极大的挑战。选股策略始终坚持基本面优质的选股逻辑，但春节后市场整体的风险偏好发生了剧烈的收缩，从而超额收益产生了一定的回撤。随着对市场波动率和资金面的重新校准，策略重新调整了价值风格和成长风格的比例，保持防守型的策略配置方案，同时控制市值、行业的整体暴露，基本达到了市场风格中性的投资结果。

本报告期内操作以稳健为主。春季后蓝筹股快速下跌时，主动降低了多头敞口和选股模型的风险敞口。因子配置上以稳健的估值因子为主体，四月以后随着市场年报的披露进程，选股逐步切换到业绩增长的成长因子和个股业绩超预期因子。选股模型在五月换手充分后，六月策略运行平稳并获得了显著的超额收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 06 月 30 日，光大阳光对冲策略 6 个月持有混合 A 类份额净值为 1.0842 元，本报告期份额净值增长率为 0.77%；光大阳光对冲策略 6 个月持有混合 B 类份额净值为 1.0677 元，本报告期份额净值增长率为 1.02%。光大阳光对冲策略 6 个月持有混合 C 类份额净值为 1.0627 元，本报告期份额净值增长率为 0.83%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，考虑经济增长、通胀、海外三方面因素，预计下半年货币政策将继续保持稳健，将继续运用适当工具保持流动性合理充裕。产业政策进一步支持科技创新以及绿色经济。随着降准的出台，政策可能进一步放松，因此流动性相对宽裕，小盘成长风格预计持续占优。下半年预计市场将延续当前的风格动量，故此选股模型将保持当前的策略配置比例平稳运行。

#### 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：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

		2021年6月30日	2020年12月31日
<b>资产:</b>			
银行存款	6.4.7.1	41,892,310.59	21,871,738.77
结算备付金		58,260,344.33	81,554,644.23
存出保证金		85,960,177.63	148,867,591.34
交易性金融资产	6.4.7.2	1,199,867,739.71	1,879,269,542.24
其中: 股票投资		770,072,058.61	1,291,906,844.29
基金投资		-	-
债券投资		256,295,681.10	373,862,697.95
资产支持证券投资		173,500,000.00	213,500,000.00
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		1,944,483.61	5,716,507.62
应收利息	6.4.7.5	11,858,243.25	7,065,344.14
应收股利		-	-
应收申购款		75.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,399,783,374.12	2,144,345,368.34
<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		836,869.48	1,556,905.78
应付赎回款		14,875,398.18	2,628,833.39
应付管理人报酬		1,105,808.82	1,708,328.30
应付托管费		220,621.31	340,514.48
应付销售服务费		421,713.12	646,069.76
应付交易费用	6.4.7.7	2,791,439.94	1,293,614.11
应交税费		220,871.06	22,407.65
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	96,137,191.16	119,817,200.00
负债合计		116,609,913.07	128,013,873.47
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,207,161,415.98	1,912,644,697.73
未分配利润	6.4.7.10	76,012,045.07	103,686,797.14
所有者权益合计		1,283,173,461.05	2,016,331,494.87

负债和所有者权益总计		1, 399, 783, 374. 12	2, 144, 345, 368. 34
------------	--	----------------------	----------------------

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，本集合计划份额总额为 1, 207, 161, 415. 98 份，其中光大阳光对冲 6 个月持有混合 A 集合计划份额总额为 5, 853, 288. 85 份，集合计划份额净值 1. 0842 元；光大阳光对冲 6 个月持有混合 B 集合计划份额总额为 48, 924, 373. 71 份，集合计划份额净值 1. 0677 元；光大阳光对冲 6 个月持有混合 C 集合计划份额总额为 1, 152, 383, 753. 42 份，集合计划份额净值 1. 0627 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：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 3 月 25 日（基金合 同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		44, 445, 587. 51	9, 913, 377. 20
1. 利息收入		10, 601, 065. 01	774, 448. 74
其中：存款利息收入	6. 4. 7. 11	1, 230, 205. 25	109, 576. 55
债券利息收入		3, 087, 210. 17	272, 947. 96
资产支持证券利息收 入		4, 919, 032. 05	-
买入返售金融资产收 入		1, 364, 617. 54	391, 924. 23
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填 列）		41, 681, 350. 46	5, 696, 790. 11
其中：股票投资收益	6. 4. 7. 12	131, 374, 665. 44	10, 030, 037. 40
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6. 4. 7. 13	1, 065, 719. 21	-112, 447. 52
资产支持证券投资收 益	6. 4. 7. 13. 5	525, 782. 20	-
贵金属投资收益	6. 4. 7. 14	-	-
衍生工具收益	6. 4. 7. 15	-98, 393, 842. 05	-5, 473, 875. 39
股利收益	6. 4. 7. 16	7, 109, 025. 66	1, 253, 075. 62
3. 公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6. 4. 7. 17	-7, 836, 827. 96	3, 441, 387. 87
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	-	750. 48

减：二、费用		29,887,487.76	2,475,751.45
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,849,820.44	861,857.60
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,766,371.95	162,857.67
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3,394,684.73	54,888.64
4. 交易费用	6.4.7.19	14,329,417.67	1,199,425.43
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1,392,369.45	146,189.13
7. 其他费用	6.4.7.20	154,823.52	50,532.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,558,099.75	7,437,625.75
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,558,099.75	7,437,625.75

### 6.3 所有者权益（基金净值）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：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）	1,912,644,697.73	103,686,797.14	2,016,331,494.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,558,099.75	14,558,099.75
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）	-705,483,281.75	-42,232,851.82	-747,716,133.57
其中：1. 基金申购款	623,779,197.77	43,291,679.87	667,070,877.64
2. 基金赎回款	-1,329,262,479.52	-85,524,531.69	-1,414,787,011.21
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）	-	-	-

列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	1,207,161,415.98	76,012,045.07	1,283,173,461.05
项目	上年度可比期间 2020年3月25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)	38,874,579.27	861,058.70	39,735,637.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	7,437,625.75	7,437,625.75
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)	310,749,009.32	241,672.36	310,990,681.68
其中:1.基金申购款	325,690,911.45	735,728.79	326,426,640.24
2.基金赎回款	-14,941,902.13	-494,056.43	-15,435,958.56
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)	349,623,588.59	8,540,356.81	358,163,945.40

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:

汪沛

詹朋

杨薇

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。本集合计划自资产管理合同变更生效之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》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	41,892,310.59
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	41,892,310.59
----	---------------

## 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	751,361,877.15	770,072,058.61	18,710,181.46
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	6,464,681.10	128,681.10
	银行间市场	249,831,000.00	1,314,200.00
	合计	256,295,681.10	1,442,881.10
资产支持证券	173,500,000.00	173,500,000.00	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,179,714,677.15	1,199,867,739.71	20,153,062.56

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021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	-696,129,428.60	-	-	
其中：股指期货投资	-696,129,428.60	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-696,129,428.60	-	-	

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。

#### 6.4.7.4 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	8,568.53
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	3,167.37
应收债券利息	5,717,372.62
应收资产支持证券利息	6,128,416.44
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	718.29
合计	11,858,243.25

#### 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	2,791,439.94
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,791,439.94

#### 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	0.00
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-

预提费用	94,343.16
其他	96,042,848.00
合计	96,137,191.16

#### 6.4.7.9 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 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	9,395,579.84	9,395,579.84
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-3,542,290.99	-3,542,290.99
-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	5,853,288.85	5,853,288.85

光大阳光对冲 6 个月持有混合 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	77,046,282.80	77,046,282.80
本期申购	1,597,593.14	1,597,593.14
本期赎回（以“-”号填列）	-29,719,502.23	-29,719,502.23
-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	48,924,373.71	48,924,373.71

光大阳光对冲 6 个月持有混合 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	1,826,202,835.09	1,826,202,835.09
本期申购	622,181,604.63	622,181,604.63
本期赎回（以“-”号填列）	-1,296,000,686.30	-1,296,000,686.30
-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	1,152,383,753.42	1,152,383,753.42

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	1,851,597.85	-1,138,119.87	713,477.98
本期利润	104,052.19	-25,692.47	78,359.72
本期基金份额交易产生的变动数	-719,473.94	420,711.70	-298,762.24
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-719,473.94	420,711.70	-298,762.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,236,176.10	-743,100.64	493,075.46

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	4,457,526.71	-76,686.24	4,380,840.47
本期利润	1,102,138.25	-215,765.31	886,372.94
本期基金份额交易产生的变动数	-1,919,239.36	-36,852.82	-1,956,092.18
其中：基金申购款	108,213.92	5,958.27	114,172.19
基金赎回款	-2,027,453.28	-42,811.09	-2,070,264.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,640,425.60	-329,304.37	3,311,121.23

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	100,564,972.35	-1,972,493.66	98,592,478.69
本期利润	21,188,737.27	-7,595,370.18	13,593,367.09
本期基金份额交易产生的变动数	-41,725,396.00	1,747,398.60	-39,977,997.40
其中：基金申购款	42,930,425.91	247,081.77	43,177,507.68
基金赎回款	-84,655,821.91	1,500,316.83	-83,155,505.08

本期已分配利润	-	-	-
本期末	80,028,313.62	-7,820,465.24	72,207,848.38

#### 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		286,243.80
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		928,846.00
其他		15,115.45
合计		1,230,205.25

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	131,374,665.44
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	131,374,665.44

##### 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	5,544,501,747.79
减：卖出股票成本总额	5,413,127,082.35
买卖股票差价收入	131,374,665.44

##### 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

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,065,719.21
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	1,065,719.21

## 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	127,582,459.77
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	124,954,104.14
减：应收利息总额	1,562,636.42
买卖债券差价收入	1,065,719.21

## 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

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	41,814,946.58
减：卖出资产支持证券成本总额	40,000,000.00
减：应收利息总额	1,289,164.38
资产支持证券投资收益	525,782.20

#### 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

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年1月1日至2021年6月30日
股指期货投资收益	-98,393,842.05

#### 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	7,109,025.66
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	7,109,025.66

#### 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	-41,061,419.72
股票投资	-41,665,607.01
债券投资	604,187.29
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	33,445,462.05
权证投资	-
期货	33,445,462.05
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	220,870.29
合计	-7,836,827.96

#### 6.4.7.18 其他收入

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	14,329,417.67
银行间市场交易费用	-
合计	14,329,417.67

#### 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	0.00
银行费用	1,200.00
账户维护费	18,600.00
其他费用	55,680.36
合计	154,823.52

#### 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
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

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3月25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 （%）
光大证券股份有限公司	10,472,585,328.61	100.00	947,487,777.87	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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年3月25日（基金合同生效日）至 2020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 （%）
光大证券股份有限公司	141,241,558.09	100.00	56,899,856.87	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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年3月25日（基金合同生效日） 至2020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 （%）
光大证券股份有限公司	15,139,000,000.00	100.00	4,899,000,000.00	100.00

#### 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（%）
光大证券股份有限公司	7,661,254.20	100.00	2,791,439.94	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2020年3月25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（%）
光大证券股份有限公司	692,763.15	100.00	827,477.75	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 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年3月25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	8,849,820.44	861,857.60

其中：支付销售机构的客户维护费	4,379,825.22	401,137.02
-----------------	--------------	------------

注：1、本集合计划 A 类份额的管理费按前一日集合计划 A 类份额资产净值的 1.5% 的年费率计提。

A 类份额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 A 类份额管理费

E 为前一日的集合计划 A 类份额的资产净值，A 类份额管理费每日计算，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、本集合计划 B 类份额的管理费按前一日集合计划 B 类份额资产净值的 1% 的年费率计提。B 类份额管理费的计算方法如下： $H=E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的集合计划 B 类份额管理费

E 为前一日的集合计划 B 类份额的资产净值，B 类份额管理费每日计算，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。

3、本集合计划 C 类份额的管理费按前一日集合计划 C 类份额资产净值的 1% 的年费率计提。C 类份额管理费的计算方法如下： $H=E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的集合计划 C 类份额管理费

E 为前一日的集合计划 C 类份额的资产净值，C 类份额管理费每日计算，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。

4、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 3 月 25 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	1,766,371.95	162,857.67

注：本集合计划的托管费按前一日集合资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$

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	-	-	33,779.11	33,779.11
光证资管	-	-	277.47	277.47
合计	-	-	34,056.58	34,056.58
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2020 年 3 月 25 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	-	-	54,887.80	54,887.80
光证资管	-	-	0.83	0.83
合计	-	-	54,888.63	54,888.63

注：1、销售服务费仅对 C 类份额收取。

2、销售服务费按前一日 C 类份额资产净值 0.4% 的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划销售服务费

E 为前一日的集合计划 C 类份额的资产净值。销售服务费逐日累计至每月月末，按月支付给各销售机构。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自有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用自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

本报告期末除管理人之外的其他关联方未持有本集合计划份额。

#### 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3月25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
广发银行股份有限公司	41,892,310.59	286,243.80	25,628,422.92	82,781.44

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

本集合计划支付给光大期货的股指期货交易手续费参考市场价格经本集合的管理人与对方协商确定，以包括中国金融期货交易所收取的上交手续费的全额列示。于2021年6月30日，本集合无应付交易手续费余额。于2021年1月1日-2021年6月30日期间，本集合期间当期交易手续费支出为175,982.28元。

本集合用于期货交易结算的资金分别存放于光大期货的结算账户和保证金账户中，结算备付金按银行同业利率计息，由光大期货进行结息处理，存出保证金不计息。于2021年6月30日，本集合的结算备付金余额为50,439,621.39元，存出保证金余额为84,186,453.60元。

#### 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)	期末成本总额	期末估值总额	备注

							位:股)			
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	-
300930	屹通新材	2021年1月13日	2021年7月21日	新股锁定	13.11	24.48	144	1,887.84	3,525.12	-
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9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10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10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	134	1,157.00	3,674.28	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	-
300952	恒辉 安防	2021年 3月3 日	2021年 9月13 日	新股锁 定	11.72	27.08	172	2,015.84	4,657.76	-
300955	嘉亨 家化	2021年 3月16 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29 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29 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	-
300966	共同 药业	2021年 3月31 日	2021年 10月 11日	新股锁 定	8.24	31.54	124	1,021.76	3,910.96	-
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	-
300978	东箭 科技	2021年 4月15 日	2021年 10月 26日	新股锁 定	8.42	13.60	217	1,827.14	2,951.20	-
300979	华利 集团	2021年 4月15 日	2021年 10月	新股锁 定	33.22	87.50	900	29,898.00	78,750.00	-

		日	26日							
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定	15.83	45.29	168	2,659.44	7,608.72	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新股锁定	24.90	24.81	170	4,233.00	4,217.70	-
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	-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	新股锁定	4.94	13.05	556	2,746.64	7,255.80	-
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	2021年	2021年	新股锁	8.05	24.26	83	668.15	2,013.58	-

	科技	6月15日	12月22日	定						
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	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	6.42	6.42	1,305	8,378.10	8,378.10	-
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	-

## 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021年6月17日	2021年7月1日	新债未上市	100.00	100.00	3,780	378,000.00	378,000.00	-

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	-------	------	--------	-----------	--------	--------	----

				价						
688368	晶丰明源	2021 年 06 月 18 日	重大事项	335.26	2021 年 7 月 5 日	402.31	600	177,701.13	201,156.00	-

### 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广发银行股份有限公司，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。

#### 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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	1,463,181.10	3,951,976.60
AAA 以下	-	6,769,104.65
未评级	-	-
合计	1,463,181.10	10,721,081.25

注：不包括国债、政策性金融债、央行票据及地方政府债券。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	173,500,000.00	213,500,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	173,500,000.00	213,500,000.00

#### 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	41,892,310.59	-	-	-	41,892,310.59
结算备付金	58,260,344.33	-	-	-	58,260,344.33

存出保证金	85,960,177.63	-	-	-	85,960,177.63
交易性金融资产	106,480,681.10	323,315,000.00	-	770,072,058.61	1,199,867,739.71
应收利息	-	-	-	11,858,243.25	11,858,243.25
应收申购款	-	-	-	75.00	75.00
应收证券清算款	-	-	-	1,944,483.61	1,944,483.61
资产总计	292,593,513.65	323,315,000.00	-	783,874,860.47	1,399,783,374.12
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	14,875,398.18	14,875,398.18
应付管理人报酬	-	-	-	1,105,808.82	1,105,808.82
应付托管费	-	-	-	220,621.31	220,621.31
应付证券清算款	-	-	-	836,869.48	836,869.48
应付销售服务费	-	-	-	421,713.12	421,713.12
应付交易费用	-	-	-	2,791,439.94	2,791,439.94
应交税费	-	-	-	220,871.06	220,871.06
其他负债	-	-	-	96,137,191.16	96,137,191.16
负债总计	-	-	-	116,609,913.07	116,609,913.07
利率敏感度缺口	292,593,513.65	323,315,000.00	-	667,264,947.40	1,283,173,461.05
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	21,871,738.77	-	-	-	21,871,738.77
结算备付金	81,554,644.23	-	-	-	81,554,644.23
存出保证金	148,867,591.34	-	-	-	148,867,591.34
交易性金融资产	224,597,697.95	362,765,000.00	-	1,291,906,844.29	1,879,269,542.24
应收利息	-	-	-	7,065,344.14	7,065,344.14
应收证券清算款	-	-	-	5,716,507.62	5,716,507.62
资产总计	476,891,672.29	362,765,000.00	-	1,304,688,696.05	2,144,345,368.34
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	2,628,833.39	2,628,833.39
应付管理人报酬	-	-	-	1,708,328.30	1,708,328.30
应付托管费	-	-	-	340,514.48	340,514.48
应付证券清算款	-	-	-	1,556,905.78	1,556,905.78
应付销售服务费	-	-	-	646,069.76	646,069.76
应付交易费用	-	-	-	1,293,614.11	1,293,614.11
应交税费	-	-	-	22,407.65	22,407.65
其他负债	-	-	-	119,817,200.00	119,817,200.00
负债总计	-	-	-	128,013,873.47	128,013,873.47
利率敏感度缺口	476,891,672.29	362,765,000.00	-	1,176,674,822.58	2,016,331,494.87

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

假设	除市场利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	市场利率上升25个基点	-588,560.36	-1,084,386.80
	市场利率下降25个基点	588,560.36	1,084,386.80

#### 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。本集合计划的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 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	770,072,058.61	60.01	1,291,906,844.29	64.07
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	770,072,058.61	60.01	1,291,906,844.29	64.07

#### 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%	98,804,356.50	94,767,580.26
	业绩比较基准下降 5%	-98,804,356.50	-94,767,580.26

#### 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 769,421,772.65 元，属于第二层次的余额为 430,445,967.06 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	770,072,058.61	55.01
	其中：股票	770,072,058.61	55.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	429,795,681.10	30.70
	其中：债券	256,295,681.10	18.31
	资产支持证券	173,500,000.00	12.39
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	100,152,654.92	7.15
8	其他各项资产	99,762,979.49	7.13
9	合计	1,399,783,374.12	100.00

### 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	28,301.15	0.00
B	采矿业	19,414,655.89	1.51
C	制造业	426,060,199.09	33.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,300,617.70	0.26
E	建筑业	3,720,704.72	0.29

F	批发和零售业	23,361,226.16	1.82
G	交通运输、仓储和邮政业	20,793,806.00	1.62
H	住宿和餐饮业	216,410.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,791,528.36	1.93
J	金融业	152,437,699.44	11.88
K	房地产业	4,390,576.25	0.34
L	租赁和商务服务业	25,452,462.05	1.98
M	科学研究和技术服务业	17,340,776.60	1.35
N	水利、环境和公共设施管理业	10,752,235.02	0.84
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	17,005,454.18	1.33
R	文化、体育和娱乐业	20,737,822.00	1.62
S	综合	267,584.00	0.02
	合计	770,072,058.61	60.01

### 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港股通投资股票组合。

### 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	10,819	22,251,437.30	1.73
2	000725	京东方A	3,338,800	20,834,112.00	1.62
3	300059	东方财富	587,869	19,276,224.51	1.50
4	600809	山西汾酒	42,949	19,241,152.00	1.50
5	601919	中远海控	617,800	18,867,612.00	1.47
6	000001	平安银行	798,500	18,062,070.00	1.41
7	603501	韦尔股份	55,804	17,968,888.00	1.40
8	600031	三一重工	600,820	17,465,837.40	1.36
9	603259	药明康德	110,740	17,340,776.60	1.35
10	600309	万华化学	157,476	17,136,538.32	1.34
11	000100	TCL 科技	2,186,000	16,722,900.00	1.30
12	600019	宝钢股份	2,178,819	16,646,177.16	1.30
13	600919	江苏银行	2,307,000	16,379,700.00	1.28
14	603882	金域医学	98,200	15,689,414.00	1.22
15	002027	分众传媒	1,647,725	15,505,092.25	1.21
16	002078	太阳纸业	1,159,397	15,477,949.95	1.21
17	601336	新华保险	322,800	14,819,748.00	1.15
18	600176	中国巨石	904,289	14,025,522.39	1.09

19	600584	长电科技	361,375	13,616,610.00	1.06
20	300463	迈克生物	301,000	12,669,090.00	0.99
21	000157	中联重科	1,349,300	12,467,532.00	0.97
22	601211	国泰君安	723,700	12,404,218.00	0.97
23	601319	中国人保	2,070,100	12,275,693.00	0.96
24	300413	芒果超媒	162,800	11,168,080.00	0.87
25	601607	上海医药	523,500	11,061,555.00	0.86
26	601658	邮储银行	2,202,711	11,057,609.22	0.86
27	000063	中兴通讯	327,637	10,887,377.51	0.85
28	600845	宝信软件	210,970	10,738,373.00	0.84
29	601827	三峰环境	1,133,100	10,730,457.00	0.84
30	601166	兴业银行	484,457	9,955,591.35	0.78
31	603345	安井食品	37,962	9,643,107.24	0.75
32	601928	凤凰传媒	1,340,300	9,569,742.00	0.75
33	601888	中国中免	31,038	9,314,503.80	0.73
34	000661	长春高新	23,851	9,230,337.00	0.72
35	300783	三只松鼠	183,700	8,700,032.00	0.68
36	600036	招商银行	157,409	8,529,993.71	0.66
37	601898	中煤能源	1,191,200	8,517,080.00	0.66
38	600426	华鲁恒升	252,030	7,800,328.50	0.61
39	600089	特变电工	562,100	7,222,985.00	0.56
40	601233	桐昆股份	284,400	6,851,196.00	0.53
41	601318	中国平安	105,313	6,769,519.64	0.53
42	601012	隆基股份	64,120	5,696,420.80	0.44
43	603444	吉比特	10,400	5,512,000.00	0.43
44	002064	华峰化学	367,800	5,222,760.00	0.41
45	601899	紫金矿业	503,987	4,883,634.03	0.38
46	600438	通威股份	112,306	4,859,480.62	0.38
47	600966	博汇纸业	370,500	4,835,025.00	0.38
48	688111	金山办公	12,000	4,737,600.00	0.37
49	002304	洋河股份	22,600	4,682,720.00	0.36
50	603806	福斯特	44,160	4,642,540.80	0.36
51	002129	中环股份	119,100	4,597,260.00	0.36
52	300529	健帆生物	52,741	4,554,712.76	0.35
53	300124	汇川技术	58,602	4,351,784.52	0.34
54	002179	中航光电	54,700	4,322,394.00	0.34
55	603799	华友钴业	37,000	4,225,400.00	0.33
56	600901	江苏租赁	798,700	4,153,240.00	0.32
57	002812	恩捷股份	16,700	3,909,470.00	0.30
58	002601	龙佰集团	110,400	3,817,632.00	0.30
59	688981	中芯国际	61,159	3,780,849.38	0.29
60	000858	五粮液	12,289	3,660,770.21	0.29

61	002920	德赛西威	32,418	3,568,573.44	0.28
62	601636	旗滨集团	187,800	3,485,568.00	0.27
63	601865	福莱特	84,500	3,340,285.00	0.26
64	601100	恒立液压	38,331	3,293,399.52	0.26
65	603517	绝味食品	34,700	2,924,863.00	0.23
66	300782	卓胜微	5,300	2,848,750.00	0.22
67	601633	长城汽车	61,800	2,693,862.00	0.21
68	000830	鲁西化工	140,300	2,627,819.00	0.20
69	601398	工商银行	506,300	2,617,571.00	0.20
70	002727	一心堂	75,400	2,496,494.00	0.19
71	600612	老凤祥	43,700	2,314,789.00	0.18
72	601699	潞安环能	192,470	2,273,070.70	0.18
73	603369	今世缘	40,600	2,198,896.00	0.17
74	600011	华能国际	511,200	2,157,264.00	0.17
75	688526	科前生物	57,934	2,098,369.48	0.16
76	600779	水井坊	16,500	2,084,775.00	0.16
77	000786	北新建材	47,000	1,844,750.00	0.14
78	601328	交通银行	369,000	1,808,100.00	0.14
79	600028	中国石化	409,931	1,787,299.16	0.14
80	300750	宁德时代	3,200	1,711,360.00	0.13
81	600016	民生银行	385,500	1,700,055.00	0.13
82	601288	农业银行	540,600	1,638,018.00	0.13
83	601169	北京银行	321,000	1,563,270.00	0.12
84	603659	璞泰来	11,300	1,543,580.00	0.12
85	002876	三利谱	23,800	1,539,860.00	0.12
86	603486	科沃斯	6,200	1,414,096.00	0.11
87	002511	中顺洁柔	50,700	1,396,785.00	0.11
88	603267	鸿远电子	10,700	1,368,744.00	0.11
89	601988	中国银行	441,000	1,358,280.00	0.11
90	601390	中国中铁	257,200	1,347,728.00	0.11
91	300327	中颖电子	15,800	1,346,634.00	0.10
92	600600	青岛啤酒	11,500	1,329,975.00	0.10
93	601009	南京银行	126,200	1,327,624.00	0.10
94	601006	大秦铁路	200,300	1,317,974.00	0.10
95	300015	爱尔眼科	18,541	1,316,040.18	0.10
96	601838	成都银行	103,600	1,309,504.00	0.10
97	002847	盐津铺子	13,100	1,306,332.00	0.10
98	601998	中信银行	252,800	1,289,280.00	0.10
99	002648	卫星石化	32,600	1,277,594.00	0.10
100	603156	养元饮品	44,332	1,267,008.56	0.10
101	601088	中国神华	61,700	1,204,384.00	0.09
102	300639	凯普生物	35,811	1,182,121.11	0.09

103	002139	拓邦股份	64,800	1,165,752.00	0.09
104	002142	宁波银行	28,665	1,117,075.05	0.09
105	600887	伊利股份	29,700	1,093,851.00	0.09
106	002156	通富微电	45,100	1,084,204.00	0.08
107	300377	赢时胜	96,400	1,073,896.00	0.08
108	600039	四川路桥	170,600	1,069,662.00	0.08
109	002258	利尔化学	40,700	1,050,060.00	0.08
110	688188	柏楚电子	2,400	1,046,400.00	0.08
111	601939	建设银行	156,000	1,037,400.00	0.08
112	002429	兆驰股份	170,200	1,033,114.00	0.08
113	600132	重庆啤酒	5,200	1,029,340.00	0.08
114	600741	华域汽车	37,200	977,244.00	0.08
115	000799	酒鬼酒	3,700	945,720.00	0.07
116	600066	宇通客车	73,100	913,019.00	0.07
117	603877	太平鸟	17,100	912,798.00	0.07
118	600177	雅戈尔	136,121	897,037.39	0.07
119	002311	海大集团	10,900	889,440.00	0.07
120	600590	泰豪科技	120,400	860,860.00	0.07
121	688396	华润微	9,338	849,944.76	0.07
122	600606	绿地控股	154,865	844,014.25	0.07
123	601339	百隆东方	154,900	834,911.00	0.07
124	000656	金科股份	138,300	800,757.00	0.06
125	600585	海螺水泥	19,200	788,160.00	0.06
126	603456	九洲药业	15,300	743,274.00	0.06
127	000488	晨鸣纸业	88,800	722,832.00	0.06
128	601689	拓普集团	18,900	707,427.00	0.06
129	603678	火炬电子	10,200	688,500.00	0.05
130	000807	云铝股份	57,300	681,870.00	0.05
131	600104	上汽集团	29,800	654,706.00	0.05
132	600660	福耀玻璃	11,600	647,860.00	0.05
133	688139	海尔生物	5,700	599,070.00	0.05
134	000596	古井贡酒	2,500	598,750.00	0.05
135	600000	浦发银行	58,200	582,000.00	0.05
136	002709	天赐材料	5,200	554,216.00	0.04
137	600383	金地集团	53,700	549,888.00	0.04
138	002636	金安国纪	33,200	538,504.00	0.04
139	600048	保利地产	43,800	527,352.00	0.04
140	300454	深信服	2,000	518,960.00	0.04
141	002677	浙江美大	26,800	489,904.00	0.04
142	605111	新洁能	2,700	486,729.00	0.04
143	300408	三环集团	10,900	462,378.00	0.04
144	300280	紫天科技	12,600	460,026.00	0.04

145	002460	赣锋锂业	3,700	448,033.00	0.03
146	300223	北京君正	4,400	444,048.00	0.03
147	600022	山东钢铁	238,600	410,392.00	0.03
148	601668	中国建筑	84,900	394,785.00	0.03
149	000338	潍柴动力	21,800	389,566.00	0.03
150	600664	哈药股份	125,400	362,406.00	0.03
151	600900	长江电力	16,975	350,364.00	0.03
152	600586	金晶科技	37,300	347,263.00	0.03
153	600795	国电电力	138,900	337,527.00	0.03
154	000069	华侨城A	43,300	322,152.00	0.03
155	000425	徐工机械	50,400	321,048.00	0.03
156	300146	汤臣倍健	9,700	319,130.00	0.02
157	002966	苏州银行	42,000	308,700.00	0.02
158	000651	格力电器	5,700	296,970.00	0.02
159	000895	双汇发展	9,300	295,740.00	0.02
160	600803	新奥股份	17,900	295,529.00	0.02
161	600105	永鼎股份	72,000	275,040.00	0.02
162	002528	英飞拓	70,800	272,580.00	0.02
163	000833	粤桂股份	59,200	267,584.00	0.02
164	600582	天地科技	68,200	265,980.00	0.02
165	600219	南山铝业	73,700	265,320.00	0.02
166	002408	齐翔腾达	21,100	262,062.00	0.02
167	601857	中国石油	49,200	260,268.00	0.02
168	600490	鹏欣资源	67,600	260,260.00	0.02
169	600839	四川长虹	88,100	256,371.00	0.02
170	600512	腾达建设	82,900	252,016.00	0.02
171	002146	荣盛发展	42,800	241,392.00	0.02
172	002541	鸿路钢构	4,100	239,235.00	0.02
173	600602	云赛智联	39,900	236,607.00	0.02
174	002131	利欧股份	99,400	232,596.00	0.02
175	600684	珠江股份	62,600	228,490.00	0.02
176	002516	旷达科技	41,900	222,070.00	0.02
177	300241	瑞丰光电	29,600	218,152.00	0.02
178	600754	锦江酒店	3,800	216,410.00	0.02
179	300122	智飞生物	1,100	205,403.00	0.02
180	688368	晶丰明源	600	201,156.00	0.02
181	600691	阳煤化工	58,300	199,386.00	0.02
182	002085	万丰奥威	35,500	198,800.00	0.02
183	002421	达实智能	51,000	195,840.00	0.02
184	600837	海通证券	17,000	195,500.00	0.02
185	600968	海油发展	74,400	192,696.00	0.02
186	600800	渤海化学	43,900	190,087.00	0.01

187	601669	中国电建	48,200	186,534.00	0.01
188	601688	华泰证券	11,800	186,440.00	0.01
189	000002	万科A	7,800	185,718.00	0.01
190	600035	楚天高速	60,700	182,100.00	0.01
191	601003	柳钢股份	30,800	181,720.00	0.01
192	600688	上海石化	48,100	180,856.00	0.01
193	002206	海利得	29,100	180,711.00	0.01
194	002093	国脉科技	28,100	176,187.00	0.01
195	600496	精工钢构	43,000	175,440.00	0.01
196	600307	酒钢宏兴	74,800	173,536.00	0.01
197	603569	长久物流	23,200	172,840.00	0.01
198	002713	东易日盛	24,300	169,371.00	0.01
199	002001	新和成	5,900	169,212.00	0.01
200	600107	美尔雅	24,600	168,510.00	0.01
201	000720	新能泰山	41,500	168,490.00	0.01
202	002061	浙江交科	31,700	168,010.00	0.01
203	000528	柳工	20,400	167,280.00	0.01
204	600183	生益科技	7,133	166,983.53	0.01
205	002522	浙江众成	26,500	165,890.00	0.01
206	000568	泸州老窖	700	165,158.00	0.01
207	600012	皖通高速	25,200	162,792.00	0.01
208	603660	苏州科达	23,200	161,472.00	0.01
209	603939	益丰药房	2,860	160,417.40	0.01
210	600711	盛屯矿业	22,400	159,712.00	0.01
211	000776	广发证券	10,500	158,970.00	0.01
212	600531	豫光金铅	30,100	158,928.00	0.01
213	000006	深振业A	31,600	158,316.00	0.01
214	000553	安道麦A	16,900	156,663.00	0.01
215	600886	国投电力	16,300	156,643.00	0.01
216	600708	光明地产	62,800	151,976.00	0.01
217	300373	扬杰科技	2,500	151,350.00	0.01
218	601601	中国太保	5,200	150,644.00	0.01
219	603392	万泰生物	580	150,324.40	0.01
220	300033	同花顺	1,300	146,614.00	0.01
221	603355	莱克电气	2,300	143,129.00	0.01
222	603589	口子窖	2,100	142,149.00	0.01
223	000932	华菱钢铁	21,500	141,900.00	0.01
224	601005	重庆钢铁	51,900	138,573.00	0.01
225	603186	华正新材	3,800	138,548.00	0.01
226	600315	上海家化	2,300	138,322.00	0.01
227	600368	五洲交通	39,600	137,016.00	0.01
228	600155	华创阳安	12,800	136,960.00	0.01

229	601666	平煤股份	19,200	136,512.00	0.01
230	002390	信邦制药	12,700	133,096.00	0.01
231	688068	热景生物	700	132,300.00	0.01
232	000898	鞍钢股份	29,590	131,675.50	0.01
233	002840	华统股份	14,600	131,546.00	0.01
234	603868	飞科电器	3,100	130,386.00	0.01
235	600180	瑞茂通	22,000	129,800.00	0.01
236	002303	美盈森	36,600	128,466.00	0.01
237	600439	瑞贝卡	41,800	127,072.00	0.01
238	600694	大商股份	6,100	126,636.00	0.01
239	600897	厦门空港	7,600	126,312.00	0.01
240	601231	环旭电子	7,500	126,075.00	0.01
241	601886	江河集团	14,500	124,990.00	0.01
242	002430	杭氧股份	3,600	124,524.00	0.01
243	603900	莱绅通灵	16,400	123,984.00	0.01
244	600351	亚宝药业	21,800	123,388.00	0.01
245	603737	三棵树	700	123,200.00	0.01
246	600827	百联股份	6,100	122,915.00	0.01
247	000501	鄂武商 A	10,500	122,850.00	0.01
248	000012	南玻 A	11,900	121,856.00	0.01
249	002022	科华生物	6,800	121,788.00	0.01
250	603113	金能科技	6,700	121,002.00	0.01
251	600729	重庆百货	4,400	120,780.00	0.01
252	603328	依顿电子	15,800	117,710.00	0.01
253	603738	泰晶科技	3,400	117,368.00	0.01
254	000639	西王食品	19,800	116,226.00	0.01
255	002271	东方雨虹	2,097	116,006.04	0.01
256	600388	龙净环保	13,572	115,633.44	0.01
257	002807	江阴银行	28,900	113,866.00	0.01
258	002841	视源股份	909	112,979.61	0.01
259	300659	中孚信息	3,300	110,781.00	0.01
260	300740	水羊股份	5,300	110,664.00	0.01
261	300737	科顺股份	3,500	110,040.00	0.01
262	002900	哈三联	3,300	109,791.00	0.01
263	000059	华锦股份	13,400	109,344.00	0.01
264	002314	南山控股	32,500	108,225.00	0.01
265	002097	山河智能	12,500	107,250.00	0.01
266	600273	嘉化能源	12,300	107,010.00	0.01
267	600201	生物股份	6,100	106,445.00	0.01
268	601015	陕西黑猫	11,800	105,610.00	0.01
269	002372	伟星新材	5,100	105,417.00	0.01
270	600648	外高桥	7,100	104,938.00	0.01

271	600266	城建发展	21,900	103,806.00	0.01
272	600876	洛阳玻璃	5,400	103,086.00	0.01
273	002688	金河生物	14,200	101,104.00	0.01
274	002092	中泰化学	8,800	90,376.00	0.01
275	002169	智光电气	7,200	86,976.00	0.01
276	300979	华利集团	900	78,750.00	0.01
277	603260	合盛硅业	900	69,219.00	0.01
278	688161	威高骨科	629	66,705.45	0.01
279	301015	百洋医药	885	46,252.93	0.00
280	688499	利元亨	951	36,946.35	0.00
281	301017	漱玉平民	3,654	32,374.44	0.00
282	300973	立高食品	234	27,076.14	0.00
283	688087	英科再生	1,189	26,110.44	0.00
284	300498	温氏股份	1,680	24,141.60	0.00
285	301018	申菱环境	2,672	22,150.88	0.00
286	301020	密封科技	1,474	15,683.36	0.00
287	688239	航宇科技	1,233	14,154.84	0.00
288	600460	士兰微	200	11,270.00	0.00
289	301009	可靠股份	334	9,315.26	0.00
290	688226	威腾电气	1,305	8,378.10	0.00
291	601528	瑞丰银行	528	8,220.96	0.00
292	300982	苏文电能	168	7,608.72	0.00
293	002568	百润股份	80	7,583.20	0.00
294	300997	欢乐家	556	7,255.80	0.00
295	300942	易瑞生物	243	6,930.36	0.00
296	688122	西部超导	100	6,487.00	0.00
297	300614	百川畅银	158	6,380.04	0.00
298	300932	三友联众	201	6,373.71	0.00
299	300933	中辰股份	606	6,326.64	0.00
300	300940	南极光	139	6,029.82	0.00
301	001207	联科科技	174	5,761.14	0.00
302	301002	崧盛股份	96	5,531.52	0.00
303	300955	嘉亨家化	113	5,205.91	0.00
304	300937	药易购	92	4,941.32	0.00
305	300961	深水海纳	222	4,899.54	0.00
306	300962	中金辐照	290	4,747.30	0.00
307	300952	恒辉安防	172	4,657.76	0.00
308	300996	普联软件	103	4,349.69	0.00
309	300985	致远新能	170	4,217.70	0.00
310	001208	华菱线缆	545	4,212.85	0.00
311	300958	建工修复	153	4,164.66	0.00
312	300986	志特新材	135	4,126.95	0.00

313	300945	曼卡龙	218	4,115.84	0.00
314	300950	德固特	103	4,030.39	0.00
315	300926	博俊科技	181	4,018.20	0.00
316	300987	川网传媒	147	3,941.07	0.00
317	300966	共同药业	124	3,910.96	0.00
318	300948	冠中生态	134	3,674.28	0.00
319	301016	雷尔伟	108	3,561.84	0.00
320	300930	屹通新材	144	3,525.12	0.00
321	300943	春晖智控	151	3,474.51	0.00
322	300991	创益通	119	3,154.69	0.00
323	300975	商络电子	241	3,140.23	0.00
324	300963	中洲特材	138	3,103.62	0.00
325	300927	江天化学	100	3,010.00	0.00
326	300978	东箭科技	217	2,951.20	0.00
327	300960	通业科技	126	2,905.56	0.00
328	300931	通用电梯	218	2,857.98	0.00
329	603171	税友股份	148	2,841.60	0.00
330	300929	华骐环保	90	2,659.50	0.00
331	300967	晓鸣股份	230	2,654.20	0.00
332	301011	华立科技	78	2,639.52	0.00
333	300998	宁波方正	100	2,132.00	0.00
334	301007	德迈仕	147	2,122.68	0.00
335	301012	扬电科技	83	2,013.58	0.00
336	605162	新中港	330	2,003.10	0.00
337	300992	泰福泵业	91	1,849.12	0.00
338	301010	晶雪节能	100	1,761.00	0.00
339	300972	万辰生物	119	1,505.35	0.00
340	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	601318	中国平安	71,638,844.27	3.55
2	600309	万华化学	61,101,092.95	3.03
3	600519	贵州茅台	60,214,167.79	2.99
4	000100	TCL科技	55,293,231.00	2.74
5	600019	宝钢股份	53,310,814.99	2.64
6	603259	药明康德	50,811,061.46	2.52
7	600031	三一重工	50,293,274.67	2.49
8	000725	京东方A	49,156,645.38	2.44
9	600036	招商银行	48,488,256.38	2.40

10	601166	兴业银行	48,453,198.00	2.40
11	601336	新华保险	44,127,374.38	2.19
12	000001	平安银行	40,809,343.80	2.02
13	000661	长春高新	38,729,588.60	1.92
14	603345	安井食品	38,290,950.18	1.90
15	603501	韦尔股份	37,072,538.20	1.84
16	600809	山西汾酒	36,101,410.49	1.79
17	000671	阳光城	35,558,519.32	1.76
18	600584	长电科技	34,626,776.39	1.72
19	601919	中远海控	33,224,335.87	1.65
20	300033	同花顺	32,805,338.18	1.63

#### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	601318	中国平安	88,138,562.96	4.37
2	600519	贵州茅台	84,464,697.43	4.19
3	601166	兴业银行	69,026,968.45	3.42
4	600036	招商银行	56,859,618.10	2.82
5	601888	中国中免	55,738,704.66	2.76
6	600309	万华化学	51,877,524.01	2.57
7	000001	平安银行	49,639,784.57	2.46
8	600031	三一重工	46,838,663.30	2.32
9	300015	爱尔眼科	45,629,690.28	2.26
10	000661	长春高新	44,824,127.23	2.22
11	600019	宝钢股份	43,868,538.24	2.18
12	600584	长电科技	42,952,514.59	2.13
13	603501	韦尔股份	41,762,739.97	2.07
14	000961	中南建设	40,941,589.17	2.03
15	601899	紫金矿业	40,155,726.53	1.99
16	600887	伊利股份	40,096,124.44	1.99
17	601919	中远海控	39,180,666.47	1.94
18	000100	TCL 科技	38,853,857.45	1.93
19	000568	泸州老窖	38,825,689.15	1.93
20	000725	京东方 A	38,823,137.00	1.93

#### 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	4,932,964,493.55
卖出股票收入（成交）总额	5,544,501,747.79

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	154,816,500.00	12.07
2	央行票据	-	-
3	金融债券	100,016,000.00	7.79
	其中：政策性金融债	100,016,000.00	7.79
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）	1,463,181.10	0.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	256,295,681.10	19.97

## 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	200011	20 付息国债 11	1,000,000	100,130,000.00	7.80
2	200406	20 农发 06	600,000	60,000,000.00	4.68
3	200009	20 付息国债 09	500,000	49,685,000.00	3.87
4	200309	20 进出 09	400,000	40,016,000.00	3.12
5	019654	21 国债 06	50,000	5,001,500.00	0.39

## 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	169365	盛安 02A	585,000	58,500,000.00	4.56
2	169255	畅融 3 优	500,000	50,000,000.00	3.90
3	169259	锦河 04A	500,000	50,000,000.00	3.90
4	138935	中和 11A	150,000	15,000,000.00	1.17

## 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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF2112	IF2112	-111	-171,168,660.00	-4,888,054.22	-
IF2107	IF2107	-42	-65,409,120.00	-482,601.00	-
IF2109	IF2109	-300	-464,976,000.00	-53,696.18	-
公允价值变动总额合计(元)					-5,424,351.40
股指期货投资本期收益(元)					-96,179,794.11
股指期货投资本期公允价值变动(元)					33,445,462.05

### 7.10.2 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 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进行国债期货投资。

### 7.11.3 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 770,072,058.61 元，占基金资产净值的比例为 60.01%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 -701,553,780.00 元，占基金资产净值的比例为 -54.67%，空头合约市值占股票资产的比例为 -91.10%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 38,873,180.61 元，公允价值变动损益为 -8,220,144.96 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，本集合计划持有的“畅融3优”的发行主体五矿国际信托有限公司，

因违规接受保险资金投资事务管理类信托计划被中国银行业监督管理委员会青海监管局公开处罚30万元（青银保监罚决字（2020）26号）。

### 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有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	85,960,177.63
2	应收证券清算款	1,944,483.61
3	应收股利	-
4	应收利息	11,858,243.25
5	应收申购款	75.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
-	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	99,762,979.49

### 7.13.4 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。

### 7.13.5 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	40	146,332.22	-	-	5,853,288.85	100.00

对冲 6 个月 持有 混合 A						
光大 阳光 对冲 6 个月 持有 混合 B	383	127,739.88	28,146,931.88	57.530	20,777,441.83	42.470
光大 阳光 对冲 6 个月 持有 混合 C	123,276	9,348.00	49,935.08	0.00	1,152,333,818.34	100.000
合计	123,699	9,758.86	28,196,866.96	2.340	1,178,964,549.02	97.660

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	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	246,554.14	4.210
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	182,027.49	0.370
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C	12,862.40	0.000
	合计	441,444.03	0.040

### 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
	合计	0

## §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	9,395,579.84	77,046,282.80	1,826,202,835.09
本报告期基金总申购份额	-	1,597,593.14	622,181,604.63
减：本报告期基金总赎回份额	3,542,290.99	29,719,502.23	1,296,000,686.30
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	5,853,288.85	48,924,373.71	1,152,383,753.42

注：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。

2021年1月5日，本基金托管人广发银行股份有限公司资产托管部副总经理由梁冰女士变更为胡杰先生。

### 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有改变。

### 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	10,472,585,328.61	100.00%	7,661,254.20	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	141,241,558.09	100.00%	15,139,000,000.00	100.00%	-	-

注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行债券、债券回购、权证（如有）等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。

## 10.8 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	2021 年 02 月 24 日
2	关于旗下光大阳光对冲策略 6 个月持	中国证监会规定的媒介	2021 年 03 月 04 日

	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并开通定期定额投资业务的公告		
3	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	2021 年 05 月 27 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

报告期内无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

2021 年 8 月 31 日