

光大阳光 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划 2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 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

报告送出日期：2022 年 1 月 21 日

§ 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 01 月 20 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 10 月 01 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	光大阳光 3 个月持有 (FOF)
基金主代码	860022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 7 月 22 日
报告期末基金份额总额	731,434,845.03 份
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、债权类资产等各类资产的配置比例。</p> <p>(二) 基金投资策略</p> <p>本集合计划将通过定量分析和定性调研相结合的方法，通过基金季报、中期报告、年报、净值等公开披露信息进行风险、收益以及风险调整后的收益等指标分析，构建基金数据库和基金经理数据库；在定量分析的基础上，结合定性调研，通过基金公司的管理模式、考核机制等信息对基金经理的行为进行进一步验证，跟踪考察基金经理的投资理念、投资行为的变化，全方位审视基金产品。</p> <p>(三) 股票投资策略</p>

	<p>1、股票组合的构建</p> <p>本集合计划首先通过行业发展前景及竞争格局考察、公司竞争力分析、公司可持续成长潜力评估及投资吸引力评估等四个层面的综合比较初步筛选出投资备选股票。然后，以全球市场为参照，通过对经济发展阶段、行业发展阶段和前景、公司综合竞争能力的逐层分解，形成对公司的相对估值判断。最后，由研究员通过调研、财务分析及量化估值等方法，筛选出质地优良、盈利持续增长、估值具备吸引力和市场预期持续改善的公司构建股票投资组合。</p> <p>2、港股通股票投资策略</p> <p>本集合计划将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者 (QDII) 境外投资额度进行境外投资。本集合计划将关注在港股市场上市、具有行业代表性和核心竞争力的优质公司，关注港股市场在行业结构、估值、AH 股折溢价、股息率等方面具有吸引力的投资标的。</p> <p>(四) 固定收益类品种投资策略</p> <p>在债券投资方面，本集合计划可投资于国债、金融债、企业债和可转换债券等债券品种。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>(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>业绩比较基准</p>	<p>沪深 300 指数收益率×65%+中证全债指数收益率×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本集合计划为混合型 FOF，由于本集合计划主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额，持有基金的预期风险和预期收益间接成为本集合计划的风险和预期收益。理论上，本集合计划预期风险和预期收益高于债券型基金、债券型 FOF、债券型集合计划和货币市场基金、货币型 FOF，低于股票型基金、股票型 FOF、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>
<p>基金管理人</p>	<p>上海光大证券资产管理有限公司</p>

基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	光大阳光 3 个月持有 (FOF) A	光大阳光 3 个月持有 (FOF) C
下属分级基金的交易代码	860022	860063
报告期末下属分级基金的份额总额	445,971,468.51 份	285,463,376.52 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。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2021 年 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日)	
	光大阳光 3 个月持有 (FOF) A	光大阳光 3 个月持有 (FOF) C
1. 本期已实现收益	-4,442,702.68	-1,091,293.87
2. 本期利润	18,892,645.57	-997,794.45
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0494	-0.0117
4. 期末基金资产净值	1,072,621,274.16	287,689,378.78
5. 期末基金份额净值	2.4051	1.0078

注：(1) 本期已实现收益指集合本期利息收入、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；

(2) 上述业绩指标不包括持有人认购或交易集合的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字

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 3 个月持有 (FOF) A

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	2.35%	0.57%	1.10%	0.54%	1.25%	0.03%
自基金合同生效起至今	2.14%	0.77%	-2.57%	0.71%	4.71%	0.06%

光大阳光 3 个月持有 (FOF) C

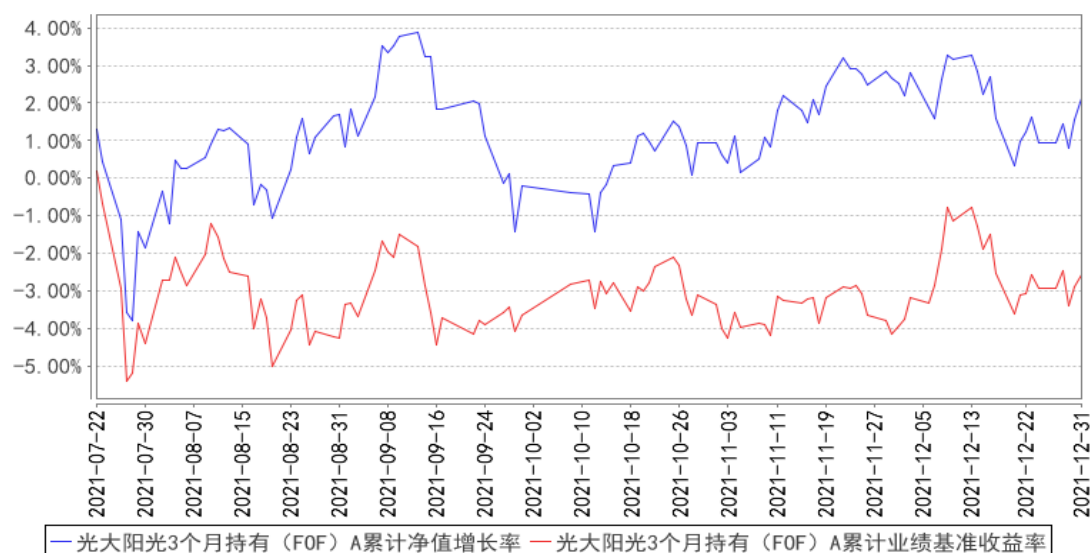
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准	业绩比较基准	①-③	②-④

		准差②	收益率③	收益率标准差 ④		
过去三个月	2.25%	0.57%	1.10%	0.54%	1.15%	0.03%
自基金合同 生效起至今	0.78%	0.76%	-2.57%	0.71%	3.35%	0.05%

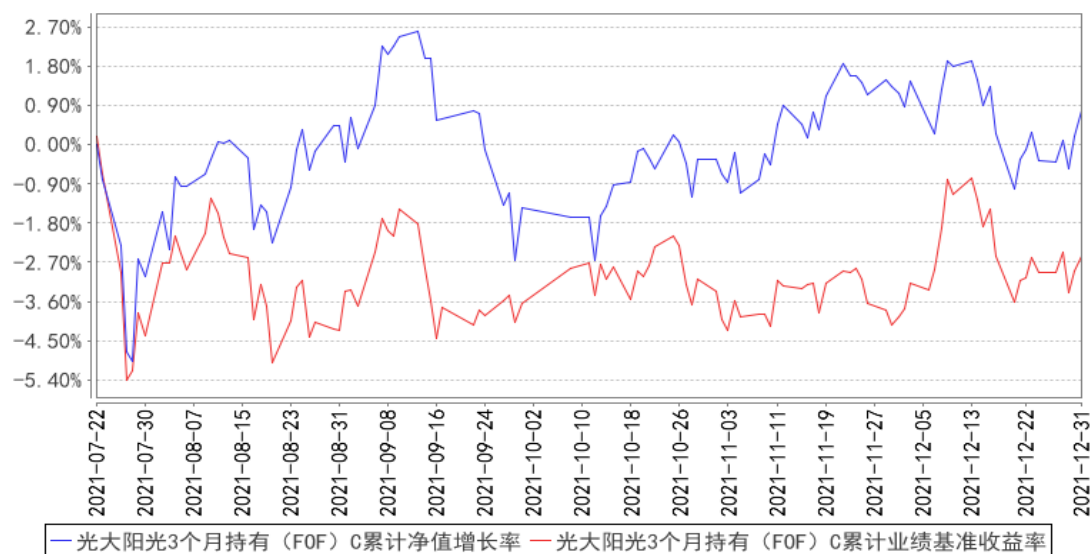
注：C类份额设立日为2021年7月22日，并自2021年07月23日开始有实际份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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3个月持有(FOF)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3个月持有(FOF)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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
沈吟	多策略投资总监兼 FOF 投资部总经理与多策略研究部总经理	2021 年 7 月 22 日	-	11	沈吟女士，同济大学本科、英国拉夫堡大学经济学硕士，曾任职于合众人寿保险股份有限公司、光大证券股份有限公司固定收益总部、证券投资总部、金融市场总部，2014 年加入光大证券资产管理有限公司，现任多策略投资总监兼 FOF 投资部总经理与多策略研究部总经理。

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遵规守信情况的说明

本报告期，上海光大证券资产管理有限公司作为本集合计划管理人，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、计划合同以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用计划资产，为集合计划份额持有人谋求最大利益，无损害集合计划持有人利益的行为，本集合计划投资组合符合有关法规及合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本集合计划管理人一贯公平对待旗下管理的所有集合计划和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《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》等规定。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

从宏观基本面来看，明年对权益市场是相对友好的。自 2020 年初疫情之后，国内经济经历了一轮小周期，从由于疫情导致的经济剧烈下行到今年上半年的经济复苏。下半年开始经济重新进入了一轮周期，与疫情前的潜在增速附近的经济周期波动靠拢。这两年经济增长支柱地产和出口，但看明年两者都有一些反向变化。地产压力很大，数据是断崖式的直线下跌，销售、开工和拿地数据都比较差；出口今年一直是超预期，随着海外防疫常态化明年出口预计也有一定下行压力。在经济增速下行的宏观背景下，保持流动性宽松是可以预见的，在经济向下的时候利率是保持低位的，所以我们对目前流动性的状况比较乐观。近一个月内已经落地的降准和 1pr 一年期的“降息”，是货币宽松很重要的信号。政策层面，近期中央经济工作会议的主题是“稳”，未来的工作重心前提是以经济建设为中心，所以经济下行是有底可托。今年重提稳增长是一个重大变化，中央把经济建设作为政治任务强调在历史上是并不常见的，明年的经济重回 5%-5.5% 可能性较大。因此，经济是前低后高，经济下行过程中流动性宽松，对权益市场估值有利；待经济逐步复苏的过程中，盈利增速也逐渐起来，在流动性没有大幅收缩的情况下，对权益市场的盈利端又较为有利。从宏观层面，流动性、政策层面都是对权益仍有可为的。

从中观来看，主要是行业选择和风格判断。经历了 2020 年整年的结构性行情后，市场分化不仅仅是行业层面，风格上也有所体现。从基金收益率差可以感受到，重仓新能源的产品最好的业绩和今年最差的基金业绩有 100% 左右的收益差，在历史上也是属于比较高的水平。因此，从行业的配置角度，明年的行业配置趋向更为均衡，景气度行业中部分估值水平已经达到了合理水平，投资者持仓水平也较低，需要积极关注基本面的变化。风格来看，今年的小盘风格相对大盘风格超额收益显著，一方面是 2020 年的大盘风格的转向，另一方面，也是在经济复苏后期中小企业的盈利弹性开始体现。展望明年，大小盘风格的均衡在“稳经济”背景下预计会有所收敛，每年的 12 月至开年春节，是 A 股盈利的真空期，市场具有一定的“春季躁动”倾向，相对均衡的风格对于开年是比较好的策略。待一季报之后，市场主线将会更加清晰，对于行业景气度判断有更多地线索。

市场交易层面来看，今年是私募产品替代北上资金、公募资金成为主力资金的一年，偏交易和高频的资金属性是否延续到明年值得关注，对市场的风格会有一些影响。如果私募偏交易性质的资金流入减缓，市场可能重新回到公募定价基本面驱动的节奏；若私募资金依然成为主力资金，行业轮动、中小市值可能相对占优。因此，对于这些资金的政策需要紧密跟踪，从北上资金的控制来看，监管已经注意到，是否有其他变化需要持续关注。

在寻找景气成长赛道方面，无论是处于经济复苏期还是经济下行周期都值得重视，是经济结

构转型过程中的中长期向。“碳经济”替代“房地产经济”是大时代背景，我们要积极拥抱它。随着今年波澜壮阔的新能源板块行情演绎之后，行业景气度没有发生变化，但是权益市场的股价和预期已经反映了大部分，展望明年，从贝塔性行情将演绎到阿发行行情，对于相关基金经理的定价和选股能力将是更大的挑战。从细分行业来看，将从新能源车演绎到新能源“加”，个股机会将蔓延到计算机、电子甚至公用事业领域，需要投资经理具有较为广泛的研究能力。此外，明年光伏和风电的基本面都是确定性的高增长，在明年基本面兑现的背景下仍然会有投资机会和 Alpha 的可能。

除了新能源景气赛道之外，我们还积极关注军工的机会，军工行业经过 2 年的业绩确定性增长，行业基本面的趋势获得很多投资者的认可，在明年景气度依然是可以维持的。虽然行业先天的估值波动较大，但是公募基金中不乏能够平衡估值和业绩的投资经理，我们会运用指数加主动相结合的方式，指数基金进行波段操作，主动基金作为底仓，平滑行业的波动。

总而言之，稳增长、高成长，二者在明年是共存的状态。投资节奏短期是较为均衡的配置，尤其是风格暴露上，并不一味地押注成长和中小盘；待一季度之后，稳增长预期明朗、行业主线清晰后，再调整仓位。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 12 月 31 日，光大阳光 3 个月持有 (FOF) A 类份额净值为 2.4051 元，本报告期份额净值增长率为 2.35%；光大阳光 3 个月持有 (FOF) C 类份额净值为 1.0078 元，本报告期份额净值增长率为 2.25%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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集合计划资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	83,417,709.11	6.12
	其中：股票	83,417,709.11	6.12
2	基金投资	1,132,885,860.94	83.12
3	固定收益投资	68,393,014.60	5.02
	其中：债券	68,393,014.60	5.02
	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	46,688,976.52	3.43
8	其他资产	31,549,483.45	2.31
9	合计	1,362,935,044.62	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 9,003,918.11 元人民币，占期末集合计划资产净值比例 0.66%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	47,208,607.00	3.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	15,565,373.00	1.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,226,600.00	0.46
J	金融业	4,976,451.00	0.37
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	436,760.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	74,413,791.00	5.47

5.2.2 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	6,161,776.99	0.45
消费者常用品	-	-

能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公用事业	2,842,141.12	0.21
房地产	-	-
合计	9,003,918.11	0.66

注：以上分类采用港交所二级分类标准。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	603799	华友钴业	75,700	8,350,467.00	0.61
2	600029	南方航空	1,224,300	8,337,483.00	0.61
3	601872	招商轮船	1,762,900	7,227,890.00	0.53
4	603899	晨光文具	110,200	7,109,002.00	0.52
5	002705	新宝股份	271,200	6,698,640.00	0.49
6	300454	深信服	32,600	6,226,600.00	0.46
7	09992 HK	泡泡玛特	168,600	6,161,776.99	0.45
8	002311	海大集团	83,400	6,113,220.00	0.45
9	002791	坚朗五金	29,900	5,429,541.00	0.40
10	002594	比亚迪	19,000	5,094,280.00	0.37

注：对于同时在 A+H 股上市 的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	23,389,014.60	1.72
2	央行票据	-	-
3	金融债券	45,004,000.00	3.31
	其中：政策性金融债	45,004,000.00	3.31
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	68,393,014.60	5.03

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	210216	21 国开 16	250,000	24,990,000.00	1.84
2	019654	21 国债 06	233,820	23,389,014.60	1.72
3	210206	21 国开 06	200,000	20,014,000.00	1.47

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本集合计划本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本集合计划投资范围不包括股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本集合计划投资范围不包括国债期货。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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

本集合计划投资的前十名证券的发行主体本报告期末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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	433,539.01
2	应收证券清算款	30,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	842,753.76
5	应收申购款	273,190.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,549,483.45

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本集合计划本报告期末未持有可转换债券。

5.11.5 报告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的情况。

5.11.6 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。

§6 基金中基金

6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	001887	中欧价值智选回报 E	契约型开放式	12,636,593.25	78,432,806.98	5.77	否
2	004868	交银股息优化	契约型开放式	18,286,465.56	52,665,020.81	3.87	否

3	512070	非银 ETF	交易型开放式 (ETF)	61,924,200.00	46,133,529.00	3.39	否
4	515650	富国中证消费 50ETF	交易型开放式 (ETF)	29,299,600.00	44,066,598.40	3.24	否
5	515150	国企富国	交易型开放式 (ETF)	33,375,200.00	43,387,760.00	3.19	否
6	450001	国富中国收益混合	契约型开放式	26,572,180.31	42,674,921.58	3.14	否
7	003435	博时鑫泽灵活配置混合 C	契约型开放式	18,772,989.21	42,089,041.81	3.09	否
8	512760	国泰 CES 半导体 ETF	交易型开放式 (ETF)	27,164,460.00	41,724,610.56	3.07	否
9	166001	中欧新趋势混合 (LOF) A	上市契约型开放式 (LOF)	23,248,244.22	40,856,464.39	3.00	否
10	519702	交银趋势领先	契约型开放式	8,292,419.24	40,248,915.27	2.96	否

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2021 年 10 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用
当期交易基金产生的申购费(元)	25,000.00	—
当期交易基金产生的赎回费(元)	635,956.66	—
当期持有基金产生的应支付销售服务费(元)	90,530.45	—
当期持有基金产生的应支付管理费(元)	2,467,633.60	—
当期持有基金产生的应支付托管费(元)	422,930.29	—

注：(1) 当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法估算得出。

(2) 根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的 (ETF 除外)，应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费 (按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外)、销售服务等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本

基金基金资产。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	光大阳光 3 个月持有 (FOF) A	光大阳光 3 个月持有 (FOF) C
报告期期初基金份额总额	360,221,490.46	7,036,512.03
报告期期间基金总申购份额	97,205,839.21	281,838,362.20
减：报告期期间基金总赎回份额	11,455,861.16	3,411,497.71
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	445,971,468.51	285,463,376.52

§ 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内集合计划管理人未持有本集合计划份额。

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内集合计划管理人未新增固有资金投资本集合计划。

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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

本集合计划报告期内未出现单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过 20%的情况。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

1) 2021 年 11 月 30 日，关于旗下光大阳光 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划新增中国光大银行股份有限公司代销并开通定期定额投资业务的公告。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会准予《光大阳光 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划资

产管理合同》变更批复的文件；

- 2、《光大阳光 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《光大阳光 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《光大阳光 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 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

10.2 存放地点

备查文件存放于集合计划管理人的办公场所：

- 1、中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层

10.3 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

上海光大证券资产管理有限公司

2022 年 1 月 21 日