

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 年年度报告

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

送出日期：2022 年 3 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 2022 年 3 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。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本集合计划出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 7 月 22 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
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
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
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	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	11
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	11
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	15
4.10 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
§ 5 托管人报告	15
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	21

§ 8 投资组合报告	45
8.1 期末基金资产组合情况	45
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
8.3 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
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
8.6 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	49
8.7 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	49
8.8 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	49
8.9 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	49
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	49
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
8.12 本报告期投资基金情况	50
8.13 投资组合报告附注	54
§ 9 基金份额持有人信息	55
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
9.3 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	55
§ 10 开放式基金份额变动	56
§ 11 重大事件揭示	56
11.1 基金份额持有人大会决议	56
11.2 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	56
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
11.4 基金投资策略的改变	56
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	57
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	57
11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
11.9 其他重大事件	58
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	58
12.1 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	58
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 13 备查文件目录	59
13.1 备查文件目录	59
13.2 存放地点	59
13.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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	
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	
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	731, 434, 845. 03 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 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。

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、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>
业绩比较基准	<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>
风险收益特征	<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>

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、甲 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ebscn-am.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2021 年 7 月 22 日(基金合同生效日)-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
本期已实现收益	17,273,147.57	-1,005,786.08
本期利润	17,396,319.19	-1,099,697.00
加权平均基金份额本期利润	0.0465	-0.0226
本期加权平均净值利润率	1.95%	-2.25%
本期基金份额净值增长率	2.14%	0.78%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	
期末可供分配利润	626,649,805.65	2,226,002.26
期末可供分配基金份额利润	1.4051	0.0078
期末基金资产净值	1,072,621,274.16	287,689,378.78
期末基金份额净值	2.4051	1.0078
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	
基金份额累计净值增长率	2.14%	0.78%

注：1、表中的“期末”均指报告期最后一日，即 2021 年 12 月 31 日；“本期”指 2021 年 7 月 22

日-2021 年 12 月 31 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 3 个月持有 (FOF) 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	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%

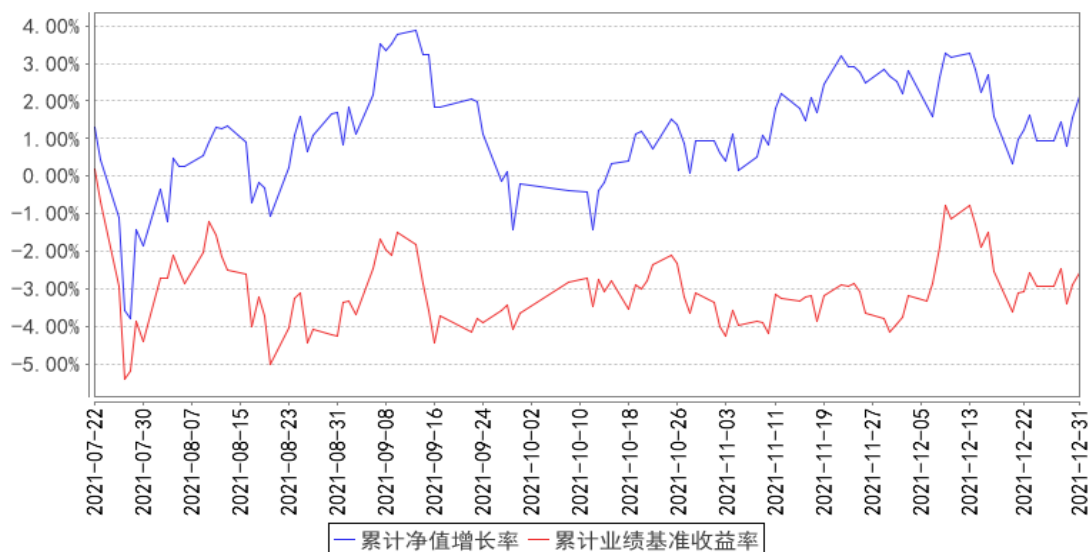
注：1、自基金合同生效日起至今指 2021 年 7 月 22 日-2021 年 12 月 31 日。

2、业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×65%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×5%+中证全债指数收益率×30%。

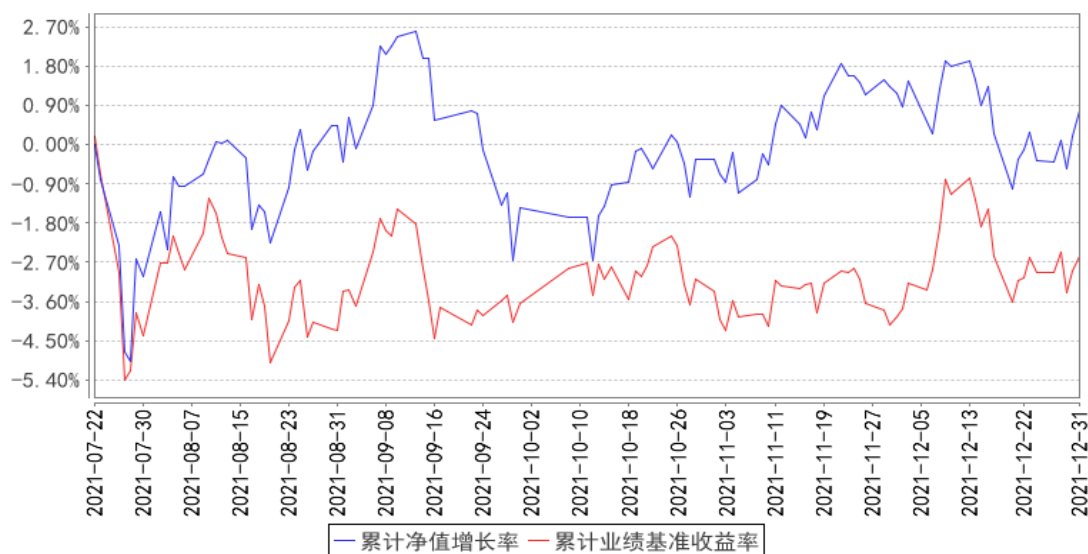
3、C 类份额设立日为 2021 年 7 月 23 日。

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

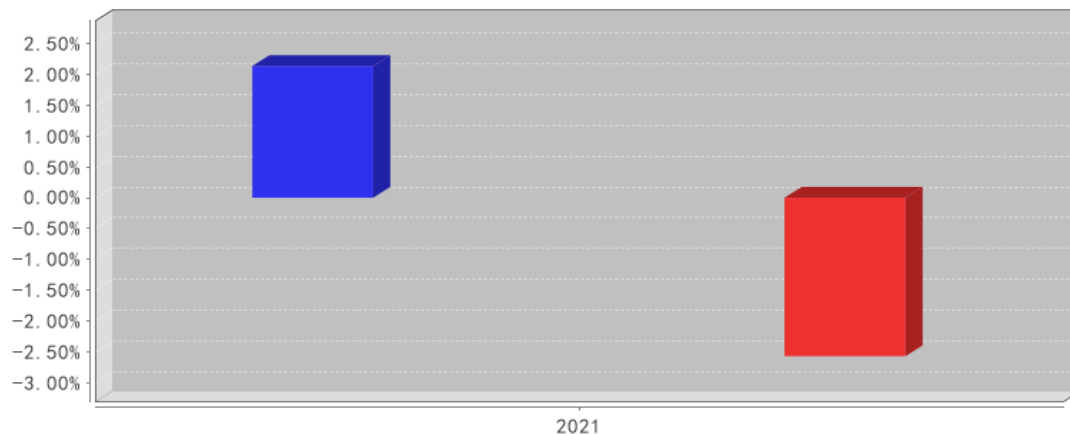


光大阳光3个月持有(FOF)C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



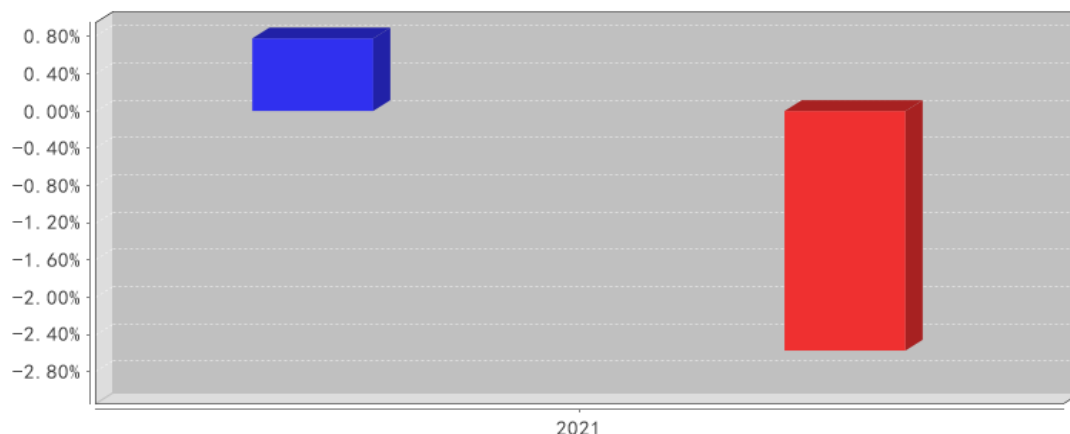
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

光大阳光3个月持有(FOF)A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



- 光大阳光3个月持有(FOF)A净值增长率
- 光大阳光3个月持有(FOF)A业绩基准收益率

光大阳光3个月持有(FOF)C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



- 光大阳光3个月持有(FOF)C净值增长率
- 光大阳光3个月持有(FOF)C业绩基准收益率

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本集合计划过去三年未进行利润分配。

§ 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 12 月末，本公司共管理 14 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的经验。

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		
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、本集合计划投资经理	2021 年 7 月 22 日	-	11 年	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 公平交易制度和控制方法

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》，将公司所已经管理、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 公平交易制度的执行情况

本集合计划管理人一贯公平的对待旗下管理的所有产品，指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。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》与《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》。

4.3.3 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

2021 年，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 2021 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。权益市场全年是结构性行情，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。风格来看，2021 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。2021 年初我们积极将组合减配了高位的消费医药，加配了新能源产业链，风格上从大盘成长向中小盘平衡。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 12 月 31 日，光大阳光 3 个月持有期混合型 (FOF) A 类份额净值为 2.4051 元，本报告期份额净值增长率为 2.14%；光大阳光 3 个月持有期混合型 (FOF) C 类份额净值为 1.0078

元，本报告期份额净值增长率为 0.78%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观基本面来看，这两年经济增长支柱地产和出口，但看 2022 年两者都有一些反向变化。地产压力很大，数据都是直线下跌，销售、开工和拿地数据都比较差；出口 2021 年一直是超预期，随着海外防疫常态化 2022 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下行的，所以我们对目前流动性的状况比较乐观。2021 年底已经落地的降准和 LPR 一年期的“降息”，是货币宽松很重要的信号。政策层面，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。2021 年底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，2022 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较为有利的。

从中观来看，主要是行业选择和风格判断。从行业的配置角度，2022 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。展望 2022 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的线索。

市场交易层面来看，2021 年是私募产品替代北上资金、公募基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值得关注，对市场的风格会有一定影响。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方向。“碳经济”替代“房地产经济”是大时代背景，我们要积极拥抱它。但随着 21 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 2022 年，从贝塔性行情将演绎到阿尔法行情，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，

2022 年光伏和风电的基本面都是确定性的高增长，在 2022 年基本面兑现的背景下仍然会有投资机会和 Alpha 的可能。

总而言之，稳增长、高成长，二者在 22 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。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，管理人继续完善内部控制、提升风险管理水平，着重开展了以下各项工作：

1、继续完善内部控制体系

公司根据法律法规、监管要求及业务发展需求，不断优化现有的标准化业务流程体系，强调业务流程服务于加强风险防范和提升运营效率，通过信息技术手段持续提升业务操作的系统化程度，并不断优化。

2、持续改进投资监控的方法与手段，保证集合计划投资业务的合法合规性

报告期内，在投资日常合规监控工作方面，公司根据法律法规和产品特点进一步完善了投资监控系统以提升投资监控效率；在实现交易价差分析、银行间交易分析、研究报告检查等专项检查工作定期化、日常化的基础上，公司加强了内幕交易风险的检查和防范，多次开展有关内幕交易的合规培训，进一步强化全体投研人员对内幕交易行为和结果的认识。

3、规范集合计划销售业务，保证集合计划销售业务的合法合规性

报告期内，在集合计划持续营销活动中，公司严格规范销售业务，按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金宣传推介材料管理暂行规定》及相关法规规定审查宣传推介材料，逐步落实反洗钱法律法规各项要求，并督促销售部门做好投资者教育工作，本报告期内没有出现主动违规行为。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本集合计划管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和集合计划合同的约定，对集合计划所持有的投资品种进行估值，本集合计划托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。集合计划份额净值由集合计划管理人完成估值后，经集合计划托管人复核无误后由集合计划管理人对外公布。本集合计划管理人对投资品种进行估值时原则上应保持估值程序和技术的一致性，对旗下管理的不同产品持有的具有相同特征的同一投资品种的估值调整原则、程序及技术应当一致（中国证监会规定的特殊品种除外）。为了保障集合计划能真实、准确地反映投资品种的公允价值，本集合计划管理人授权估值委员会负责建立健全估值

决策体系，估值委员会成员的任命和调整由总经理办公会审议决定。运营部是估值委员会的日常办事机构，负责关注相关投资品种的动态，确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种，并提交估值委员会审议。运营部的估值人员均具有专业会计学习经历，具有基金从业人员资格。

4.8 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。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划（以下称“本集合计划”）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、集合计划合同、托管协议等的规定，依法安全保管了集合计划的全部资产，对本集合计划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集合计划运作情况报告，没有发生任何损害集合计划份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为集合计划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、集合计划合同、托管协议等的规定，对集合计划管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现集合计划管理人在投资运作、集合计划资产净值的计算、集合计划份额申购赎回价格的计算、集合计划费用开支等方面存在损害集合计划份额持有人利益的行为。该集合计划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集合计划合同及实际运作情况进行处理。

5.3 托管人对本年度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集合计划管理人编制的《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 年年度报告》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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明 (2022) 审字第 61263195_B11 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	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
审计意见	我们审计了光大阳光 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划的财务报表, 包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表, 2021 年 7 月 22 日 (集合计划合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益 (集合计划净值) 变动表以及相关财务报表附注。 我们认为, 后附的光大阳光 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制, 公允反映了光大阳光 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 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 7 月 22 日 (集合计划合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则, 我们独立于光大阳光 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划, 并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	光大阳光 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息, 但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息, 我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计, 我们的责任是阅读其他信息,

	<p>在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估光大阳光 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项 (如适用)，并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督光大阳光 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对光大阳光 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致光大阳光 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报 (包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p>

	我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	王自清	虞良玉
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12	
审计报告日期	2022 年 3 月 31 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：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

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	45,742,657.82
结算备付金		946,318.70
存出保证金		433,539.01
交易性金融资产	7.4.7.2	1,284,696,584.65
其中：股票投资		83,417,709.11
基金投资		1,132,885,860.94
债券投资		68,393,014.60
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		30,000,000.00
应收利息	7.4.7.5	842,753.76
应收股利		-
应收申购款		273,190.68
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		1,362,935,044.62
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		1.88

应付赎回款		490,660.62
应付管理人报酬		1,051,019.81
应付托管费		210,204.02
应付销售服务费		73,531.85
应付交易费用	7.4.7.7	643,948.66
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	155,024.84
负债合计		2,624,391.68
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	731,434,845.03
未分配利润	7.4.7.10	628,875,807.91
所有者权益合计		1,360,310,652.94
负债和所有者权益总计		1,362,935,044.62

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，本集合计划份额总额为 731,434,845.03 份，其中光大阳光 3 个月持有期混合型 (FOF) A 类份额总额为 445,971,468.51 份，集合计划份额净值 2.4051 元；光大阳光 3 个月持有期混合型 (FOF) C 类份额总额为 285,463,376.52 份，集合计划份额净值 1.0078 元。

7.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2021 年 7 月 22 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 7 月 22 日 (基金合同 生效日) 至 2021 年 12 月 31 日
一、收入		24,572,644.38
1. 利息收入		761,541.69
其中：存款利息收入	7.4.7.11	248,717.07
债券利息收入		483,248.18
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		29,576.44
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益 (损失以“-”填列)		23,780,133.33
其中：股票投资收益	7.4.7.12	5,962,666.44
基金投资收益	7.4.7.13	16,932,903.33
债券投资收益	7.4.7.14	-

资产支持证券投资收益	7.4.7.14.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-
股利收益	7.4.7.17	884,563.56
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	7.4.7.18	29,260.70
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	7.4.7.19	1,708.66
减: 二、费用		8,276,022.19
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,169,432.57
2. 托管费	7.4.10.2.2	833,886.52
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	80,726.84
4. 交易费用	7.4.7.20	2,979,949.99
5. 利息支出		-
其中: 卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		56,028.47
7. 其他费用	7.4.7.21	155,997.80
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		16,296,622.19
减: 所得税费用		-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		16,296,622.19

7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 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

本报告期: 2021 年 7 月 22 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2021 年 7 月 22 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 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)	368,217,027.83	498,806,355.75	867,023,383.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	16,296,622.19	16,296,622.19
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)	363,217,817.20	113,772,829.97	476,990,647.17
其中: 1. 基金申购款	388,608,143.65	144,344,664.36	532,952,808.01
2. 基金赎回款	-25,390,326.45	-30,571,834.39	-55,962,160.84

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）	731,434,845.03	628,875,807.91	1,360,310,652.94

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

光大阳光 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划是由光大阳光基中宝 (阳光 2 号二期) 集合资产管理计划转型而来。本集和计划管理人上海光大证券资产管理有限公司于 2021 年 7 月 8 日发布了《光大阳光基中宝集合资产管理计划合同变更公告》，光大阳光基中宝 (阳光 2 号二期) 集合资产管理计划名称变更为“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”，光大阳光基中宝 (阳光 2 号二期) 集合资产管理计划产品份额变更为光大阳光 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划份额。合同变更后，本集合计划的托管人、登记机构不变。自 2021 年 7 月 22 日起，《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》、《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》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 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》的有关规定，本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（包括 QDII 基金和香港互认基金）份额，国内依法发行上市的股票（含创业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）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）。

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：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的比例不低于计划资产的 80%，其中，投资于股票、股票型基金和权益类资产比例不低于 60% 的混合型基金合计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%），投资于商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）份额的比例不高于集合计划资产的 10%。本集合计划保留的现金或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%，其中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：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%

7.4.2 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 3 个月持有期混合型基金中基金集合资产管理计划 (FOF) 资产管理合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划 2021 年 7 月 22 日（集合计划合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间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 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 7 月 22 日（集合计划合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本集合计划财务报表所载财务信息根据下列企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2021 年 7 月 22 日至 2021 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本集合计划以人民币为记账本位币，除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本集合计划对金融资产的持有意图和持有能力。本集合计划目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本集合计划目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本集合计划持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本集合计划目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本集合计划持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本集合计划成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：

(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

(2) 该金融资产已转移，且本集合计划将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者

(3) 该金融资产已转移，虽然本集合计划既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的

风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本集合计划持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本集合计划持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本集合计划（1）具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且（2）交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的

金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益，股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬、托管费和销售服务费（如有）在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

- 1、在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划可进行收益分配；
- 2、本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；由红利再投资而来的 A 类或 C 类份额不受锁定持有期的限制。
- 3、集合计划收益分配后各类集合计划份额净值不能低于面值；即集合计划收益分配基准日的各类集合计划份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；
- 4、由于本集合计划 A 类份额、C 类份额的销售费用收取方式存在不同，各集合计划份额类别对应的可供分配收益将有所不同。本集合计划同一类别的每一集合计划份额享有同等分配权；

7.4.4.12 外币交易

无。

7.4.4.13 分部报告

本集合计划以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本集合计划内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本集合计划的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本集合计划能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本集合计划目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本集合计划的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本集合计划确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本集合计划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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 于 2017 年 10 月 23 日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自 2017 年 10 月 23 日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，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》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于

2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本集合计划持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本集合计划持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	45,742,657.82
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	45,742,657.82

7.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	84,215,888.10	83,417,709.11	-798,178.99
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	23,389,014.60	-73,096.20
	银行间市场	45,004,000.00	11,160.00
	合计	68,393,014.60	-61,936.20
资产支持证券	-	-	-
基金	1,042,070,958.50	1,132,885,860.94	90,814,902.44

其他	-	-	-
合计	1,194,741,797.40	1,284,696,584.65	89,954,787.25

7.4.7.3 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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。

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	20,592.83
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	866.99
应收债券利息	821,083.74
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	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	210.20
合计	842,753.76

7.4.7.6 其他资产

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	643,436.16
银行间市场应付交易费用	512.50
合计	643,948.66

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	24.84

应付证券出借违约金	-
预提费用	155,000.00
合计	155,024.84

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

光大阳光 3 个月持有 (FOF) A

项目	本期 2021 年 7 月 22 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	368,217,027.83	368,217,027.83
本期申购	99,733,269.42	99,733,269.42
本期赎回 (以“-”号填列)	-21,978,828.74	-21,978,828.74
-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	445,971,468.51	445,971,468.51

光大阳光 3 个月持有 (FOF) C

项目	本期 2021 年 7 月 22 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	288,874,874.23	288,874,874.23
本期赎回 (以“-”号填列)	-3,411,497.71	-3,411,497.71
-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	285,463,376.52	285,463,376.52

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

光大阳光 3 个月持有 (FOF) A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	536,615,316.72	-37,808,960.97	498,806,355.75
本期利润	17,273,147.57	123,171.62	17,396,319.19
本期基金份额交易产生的变动数	118,080,324.91	-7,633,194.20	110,447,130.71
其中：基金申购款	151,069,198.08	-10,091,719.88	140,977,478.20
基金赎回	-32,988,873.17	2,458,525.68	-30,530,347.49

回款			
本期已分配利润			
本期末	671,968,789.20	-45,318,983.55	626,649,805.65

光大阳光 3 个月持有 (FOF) C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日			
本期利润	-1,005,786.08	-93,910.92	-1,099,697.00
本期基金份额交易产生的变动数	6,296,598.37	-2,970,899.11	3,325,699.26
其中：基金申购款	6,374,301.99	-3,007,115.83	3,367,186.16
基金赎回款	-77,703.62	36,216.72	-41,486.90
本期已分配利润			
本期末	5,290,812.29	-3,064,810.03	2,226,002.26

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年7月22日（基金合同生效日）至2021年12月31日
活期存款利息收入	231,223.05
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	14,179.34
其他	3,314.68
合计	248,717.07

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年7月22日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	5,962,666.44
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	5,962,666.44

7.4.7.12.2 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 7 月 22 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	302,792,922.24
减：卖出股票成本总额	296,830,255.80
买卖股票差价收入	5,962,666.44

7.4.7.12.3 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投资收益-证券出借差价收入。

7.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 7 月 22 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
卖出/赎回基金成交总额	1,187,510,178.67
减：卖出/赎回基金成本总额	1,170,577,275.34
基金投资收益	16,932,903.33

7.4.7.14 债券投资收益**7.4.7.14.1 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。

7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本集合计划本报告期无债券投资收益。

7.4.7.14.3 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。

7.4.7.14.4 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。

7.4.7.14.5 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。

7.4.7.15 贵金属投资收益**7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成**

本集合计划本报告期未进行贵金属投资。

7.4.7.15.2 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。

7.4.7.15.3 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。

7.4.7.15.4 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。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 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。

7.4.7.16.2 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。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 7 月 22 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	84,645.20
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	799,918.36
合计	884,563.56

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021 年 7 月 22 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	29,260.70
股票投资	-1,746,472.39
债券投资	-61,936.20
资产支持证券投资	-
基金投资	1,837,669.29
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	-
合计	29,260.70

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 7 月 22 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	1,708.66
合计	1,708.66

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 7 月 22 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	923,467.20
银行间市场交易费用	712.50
交易基金产生的费用	2,055,770.29
其中：申购费	36,000.00
赎回费	1,438,724.91
交易费	525,053.79
转换费	55,991.59
合计	2,979,949.99

7.4.7.20.1 持有基金产生的费用

项目	本期费用
	2021 年 7 月 22 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费 (元)	134,632.37
当期持有基金产生的应支付管理费 (元)	4,280,989.56
当期持有基金产生的应支付托管费 (元)	729,480.02
当期交易基金产生的申购费 (元)	36,000.00
当期交易基金产生的赎回费 (元)	1,438,724.91

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。

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 7 月 22 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	26,697.80
信息披露费	120,000.00
证券出借违约金	-
账户维护费	9,300.00
合计	155,997.80

7.4.7.22 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

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。

7.4.9 关联方关系

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 (“光证资管”)	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”)	集合计划代销机构、集合计划管理人的股东

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2021 年 7 月 22 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
光大证券	666,324,524.34	100.00

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2021 年 7 月 22 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
光大证券	23,462,110.80	100.00

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 7 月 22 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
光大证券	28,000,000.00	100.00

7.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 7 月 22 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期基金 成交总额的比例（%）
光大证券	1,750,176,228.20	100.00

7.4.10.1.5 权证交易

本集合计划本报告期无权证交易。

7.4.10.1.6 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7月22日（基金合同生效日）至2021年12月31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	966,762.72	100.00	643,436.16	100.00

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 7 月 22 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,169,432.57
其中：支付销售机构的客户维护费	786,361.73

注：1、本集合计划不同类别份额的管理费分别计算，A 类份额固定年管理费率为 1%，C 类份额固定年管理费率为 1%，本集合计划固定管理费的计算方法如下：

$$G = E \times \text{相应类别份额的固定管理费率} / \text{当年天数}$$

G 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

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 7 月 22 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	833,886.52

注：集合计划托管费按前一日的集合计划资产净值的 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。

7.4.10.2.3 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 7 月 22 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	光大阳光 3 个月持有 (FOF) A	光大阳光 3 个月持有 (FOF) C	合计
光大银行	-	71,570.99	71,570.99
光大证券	-	8,895.32	8,895.32
光证资管	-	187.02	187.02
合计	-	80,653.33	80,653.33

注：C 类份额集合计划销售服务费按前一日的 C 类份额集合计划资产净值的 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 C 类份额前一日的集合计划资产净值

C 类份额集合计划销售服务费每日计算，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。

7.4.10.3 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末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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无与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

7.4.10.4.2 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无与关联方通过约定申报方式进行适用市场化费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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基金。

7.4.10.5.2 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 3 个月持有 (FOF) A

关联方名称	本期末 2021 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 (%)
光大证券股份有限公司	56,857,500.00	7.77

7.4.10.6 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 7 月 22 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	45,742,657.82	231,223.05

注：本集合计划的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本集合计划在承销期内未参与投资关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.10.8.2 当期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

项目	本期费用
	2021 年 7 月 22 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日
当期交易基金产生的申购费 (元)	36,000.00
当期交易基金产生的赎回费 (元)	1,438,724.91
当期持有基金产生的应支付销售服务费 (元)	134,632.37
当期持有基金产生的应支付管理费 (元)	4,280,989.56
当期持有基金产生的应支付托管费 (元)	729,480.02

7.4.11 利润分配情况

本集合计划本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末 (2021 年 12 月 31 日) 本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本集合计划本报告期末未持有因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本集合计划本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本集合计划本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本集合计划本报告期末未持有交易所市场债券正回购。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理**7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本集合计划在日常经营活动中面临的与金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。管理人制定内部风险管理制度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。

公司建立四个层级的风险管理体系，即董事会、经理层及各专业委员会、各风险管理职能部门、各业务部门。公司董事会是风险管理的最高决策机构，承担全面风险管理的最终责任。公司经理层就公司风险管理工作的有效性向董事会负责，对全面风险管理承担主要责任。公司经理层

在董事会的领导下，全面负责公司风险管理的日常工作。公司经理层下设专业委员会就不同类别风险管理对经理层负责，委员会根据公司各委员会议事规则确定的职责范围，行使公司风险管理职能。各风险管理职能部门按照公司授权对公司不同风险进行识别、监测、评估和报告，并制定公司不同类型风险管理办法，明确具体工作流程，并为业务决策提供对口风险管理建议，协助、指导和检查各部门的对口风险管理工作。公司各业务部门按照公司授权管理体系在被授予的权限范围内开展业务，严禁越权从事经营活动，并通过制度、流程、系统等方式，进行有效管理和控制。

本集合计划的管理人主要通过定性分析和定量分析的方法评估各种金融工具风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本集合计划的投资目标，结合集合计划资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	68,393,014.60
合计	68,393,014.60

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级中包含国债、政策性金融债、央票以及未有第三方机构评级的其他债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本期末不存在按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本期末不存在按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本集合计划本期末不存在按长期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本期末不存在按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本期末不存在按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

无。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	45,742,657.82	-	-	-	45,742,657.82
结算备付金	946,318.70	-	-	-	946,318.70
存出保证金	433,539.01	-	-	-	433,539.01
交易性金融资产	68,393,014.60	-	-	1,216,303,570.05	1,284,696,584.65
应收利息	-	-	-	842,753.76	842,753.76
应收申购款	-	-	-	273,190.68	273,190.68
应收证券清算款	-	-	-	30,000,000.00	30,000,000.00
资产总计	115,515,530.13	-	-	1,247,419,514.49	1,362,935,044.62
负债					
应付赎回款	-	-	-	490,660.62	490,660.62
应付管理人报酬	-	-	-	1,051,019.81	1,051,019.81
应付托管费	-	-	-	210,204.02	210,204.02
应付证券清算款	-	-	-	1.88	1.88
应付销售服务费	-	-	-	73,531.85	73,531.85
应付交易费用	-	-	-	643,948.66	643,948.66
其他负债	-	-	-	155,024.84	155,024.84
负债总计	-	-	-	2,624,391.68	2,624,391.68
利率敏感度缺口	115,515,530.13	-	-	-1,244,795,122.81	1,360,310,652.94

7.4.13.4.1.2 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 12 月 31 日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-85,352.18
	市场利率下降 25 个基点	85,352.18

7.4.13.4.2 外汇风险

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日			合计
	美元 折合人民	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	

	币元			
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	9,003,918.11	-	9,003,918.11
资产合计	-	9,003,918.11	-	9,003,918.11
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	-	9,003,918.11	-	9,003,918.11

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除市场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 12 月 31 日)
分析	港币相对人民币升值 5%	450,195.91
	港币相对人民币贬值 5%	-450,195.91

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是集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计划进行风险度量,动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	83,417,709.11	6.13
交易性金融资产—基金投资	1,132,885,860.94	83.28

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	1,216,303,570.05	89.41

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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 12 月 31 日)
分析	沪深 300 指数上升 5%	4,514,797.80
	沪深 300 指数下降 5%	-4,514,797.80

注: 本期末, 用沪深 300 指数浮动 5% 的情形下, 基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险; Beta 系数根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出。

7.4.14 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 12 月 31 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 318,318,500.62 元, 属于第二层次的余额为 966,378,084.03, 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 12 月 31 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	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	其他各项资产	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%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	-	-
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

8.2.2 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：以上行业分类采用港交所二级分类标准。

8.3 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	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	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
11	300059	东方财富	134,100	4,976,451.00	0.37
12	002648	卫星化学	106,100	4,247,183.00	0.31
13	002078	太阳纸业	362,600	4,166,274.00	0.31
14	00916	龙源电力	191,000	2,842,141.12	0.21
15	300144	宋城演艺	30,500	436,760.00	0.03

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。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600029	南方航空	13,059,174.00	0.96
2	002714	牧原股份	12,825,740.20	0.94
3	600486	扬农化工	12,679,201.95	0.93
4	603799	华友钴业	11,040,090.00	0.81
5	002705	新宝股份	10,136,648.00	0.75
6	002594	比亚迪	9,531,786.00	0.70
7	601995	中金公司	8,792,151.00	0.65
8	002142	宁波银行	8,740,309.19	0.64
9	002129	中环股份	8,699,617.00	0.64
10	600036	招商银行	8,691,477.73	0.64
11	000001	平安银行	8,686,516.60	0.64
12	688408	中信博	8,603,709.49	0.63
13	600519	贵州茅台	8,517,536.00	0.63
14	00939	建设银行	8,441,176.51	0.62
15	00941	中国移动	8,423,795.72	0.62
16	300059	东方财富	8,325,914.00	0.61

17	002466	天齐锂业	8,137,130.75	0.60
18	603259	药明康德	7,814,642.58	0.57
19	600893	航发动力	7,648,941.00	0.56
20	601872	招商轮船	7,622,297.08	0.56

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002714	牧原股份	12,128,626.74	0.89
2	600486	扬农化工	11,406,332.74	0.84
3	002142	宁波银行	10,033,126.64	0.74
4	002648	卫星化学	9,492,811.00	0.70
5	600519	贵州茅台	9,165,433.00	0.67
6	688408	中信博	9,079,857.78	0.67
7	600893	航发动力	9,070,922.80	0.67
8	601012	隆基股份	9,045,136.20	0.66
9	002129	中环股份	8,955,295.00	0.66
10	600036	招商银行	8,728,434.32	0.64
11	601995	中金公司	8,700,328.00	0.64
12	00941	中国移动	8,581,799.71	0.63
13	00939	建设银行	8,460,701.23	0.62
14	000001	平安银行	8,148,170.00	0.60
15	600884	杉杉股份	7,641,487.00	0.56
16	603259	药明康德	7,289,924.00	0.54
17	300791	仙乐健康	7,278,677.50	0.54
18	002466	天齐锂业	6,337,669.40	0.47
19	688680	海优新材	6,222,340.52	0.46
20	601689	拓普集团	5,987,874.00	0.44

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 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	363,531,602.10
卖出股票收入（成交）总额	302,792,922.24

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。

8.5 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	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

8.6 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	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

8.7 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。

8.8 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投资。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本集合计划投资范围不包括国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本集合计划投资范围不包括国债期货。

8.12 本报告期投资基金情况

8.12.1 投资政策及风险说明

本集合计划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。

本集合计划的投资组合比例为：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的比例不低于计划资产的 80%，其中，投资于股票、股票型基金和权益类资产比例不低于 60% 的混合型基金合计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%），投资于商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）份额的比例不高于集合计划资产的 10%。

报告期内，本集合计划投资运作符合合同约定的投资政策、投资限制等要求。

8.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

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 优先	契约 型开 放式	8,292,419.24	40,248,915.27	2.96	否
11	010696	工银金融 地产混合 C	契约 型开 放式	15,015,600.62	39,160,686.42	2.88	否
12	540003	汇丰晋信 动态策略 A	契约 型开 放式	7,296,418.43	37,277,401.76	2.74	否
13	001736	圆信永丰 优加生活 股票	契约 型开 放式	9,617,515.46	34,642,290.69	2.55	否
14	004139	中邮军民 融合灵活 配置混合	契约 型开 放式	13,261,669.37	34,127,579.96	2.51	否
15	002685	中欧丰泓 沪港深灵	契约 型开	18,941,904.54	31,083,665.35	2.29	否

		活配置混合 A	放式				
16	040015	华安动态灵活配置混合	契约型开放式	5,856,465.77	30,904,569.87	2.27	否
17	270028	广发制造业精选混合 A	契约型开放式	4,148,091.81	30,305,958.76	2.23	否
18	011322	国泰智能装备股票 C	契约型开放式	8,714,411.69	29,350,138.57	2.16	否
19	000566	华泰柏瑞创新升级混合 A	契约型开放式	8,363,952.79	29,315,654.53	2.16	否
20	013511	汇丰晋信低碳先锋股票 C	契约型开放式	6,524,518.21	29,177,645.44	2.14	否
21	006879	华安智能生活混合	契约型开放式	8,980,554.42	23,451,819.81	1.72	否
22	007130	中庚小盘价值股票	契约型开放式	9,726,193.95	22,556,016.39	1.66	否
23	511990	华宝添益	交易型开放式 (ETF)	225,364.00	22,543,611.65	1.66	否
24	001718	工银瑞信物流产业股票	契约型开放式	5,408,058.41	22,540,787.45	1.66	否
25	159974	央企创新	交易型开放式 (ETF)	15,619,700.00	22,258,072.50	1.64	否
26	001975	景顺长城环保优势	契约型开	5,000,000.00	21,175,000.00	1.56	否

		股票	放式				
27	750001	安信策略 精选灵活 配置混合	契约 型开 放式	7,459,530.03	20,812,088.78	1.53	否
28	009846	国富港股 通远见价 值混合	契约 型开 放式	21,434,290.68	19,974,615.48	1.47	否
29	009886	新华景气 行业混合 C	契约 型开 放式	15,521,930.88	19,748,552.66	1.45	否
30	001347	富国新收 益灵活配 置混合 C	契约 型开 放式	9,483,167.38	19,601,706.97	1.44	否
31	310358	申万菱信 新经济混 合	契约 型开 放式	10,520,595.68	19,381,041.36	1.42	否
32	003853	金鹰信息 产业股票 A	契约 型开 放式	4,264,006.12	18,882,724.70	1.39	否
33	001171	工银瑞信 养老产业 股票 A	契约 型开 放式	8,399,944.35	17,715,482.63	1.30	否
34	006551	中庚价值 领航	契约 型开 放式	7,000,000.00	15,173,900.00	1.12	否
35	512710	军工龙头 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	14,411,900.00	14,786,609.40	1.09	否
36	008284	易方达全 球医药行 业混合发 起式 (QDII)(人 民币份额)	契约 型开 放式	11,873,672.47	14,260,280.64	1.05	否

37	001475	易方达国防军工混合	契约型开放式	4,770,515.27	10,380,641.23	0.76	否
38	013618	华安大安全混合 C	契约型开放式	3,529,827.04	10,017,649.14	0.74	否

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 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。

8.13.2 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。

8.13.3 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	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

8.13.4 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处于转股期的可转换债券。

8.13.5 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未存在流通受限情况。

8.13.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 3 个月持有 (FOF) A	3,551	125,590.39	56,857,500.00	12.75	389,113,968.51	87.25
光大阳光 3 个月持有 (FOF) C	1,802	158,414.75	-	-	285,463,376.52	100.00
合计	5,353	136,640.17	56,857,500.00	7.78	674,577,345.03	92.22

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）。

9.2 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 3 个月持有 (FOF) A	242,054.61	0.0543
	光大阳光 3 个月持有 (FOF) C	4,005.06	0.0014
	合计	246,059.67	0.0336

注：从业人员持有集合占集合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）。

9.3 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 3 个月持有 (FOF) A	0~10
	光大阳光 3 个月持有 (FOF) C	0
	合计	0~10

本基金基金经理持有 本开放式基金	光大阳光 3 个月持有 (FOF) A	0
	光大阳光 3 个月持有 (FOF) C	0
	合计	0

§ 10 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
基金合同生效日 (2021 年 7 月 22 日) 基金份额总额	368,217,027.83	-
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	99,733,269.42	288,874,874.23
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	21,978,828.74	3,411,497.71
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额 (份额减少 以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份 额总额	445,971,468.51	285,463,376.52

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本集合计划未召开集合计划份额持有人大会。

11.2 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、托管人无重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本集合计划投资策略未发生改变。

11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期持有的基金未发生重大影响事件。

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内集合计划管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。本集合计划本年度（2021 年自然年度全年）支付给审计机构安永华明会计师事务所（特殊合伙）的报酬为 35,000.00 元人民币，该会计师事务所自本集合计划合同生效日起为本集合计划提供审计服务至今。

11.7 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。

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 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	666,324,524.34	100.00%	966,762.72	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、权证等交易（如有）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。

11.8.2 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		基金交易	
	成交金额	占当期债券	成交金额	占当期债券回购	成交金额	占当期权证	成交金额	占当期基金

		成交总 额的比例		成交总额 的比例		证 成交 总额 的比例		成交总 额的比例
光大 证券	23,462,110.80	100.00%	28,000,000.00	100.00%	-	-	1,750,176,228.20	100.00%

11.9 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	光大阳光 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划合同生效公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 07 月 23 日
2	关于旗下光大阳光 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划在上海浦东发展银行申购费率优惠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 08 月 03 日
3	关于开通旗下部分集合计划转换业务的公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 08 月 09 日
4	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 08 月 12 日
5	关于直销渠道参与公司旗下参公管理集合资产管理计划转换费优惠的公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 08 月 16 日
6	关于旗下参公集合资产管理计划在上海天天基金销售有限公司渠道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 09 月 13 日
7	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	中国证监会规定的媒介	2021 年 11 月 30 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

本集合计划本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 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

13.2 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。

13.3 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 3 月 31 日