

光大阳光价值 30 个月持有期混合型集合资产 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 1 月 1 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	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	23

§ 8 投资组合报告	53
8.1 期末基金资产组合情况	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	54
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	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
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	63
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	63
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	63
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	63
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	63
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
8.12 投资组合报告附注	64
§ 9 基金份额持有人信息	65
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
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	66
§ 10 开放式基金份额变动	66
§ 11 重大事件揭示	66
11.1 基金份额持有人大会决议	66
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	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
11.4 基金投资策略的改变	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
11.8 其他重大事件	68
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§ 13 备查文件目录	68
13.1 备查文件目录	68
13.2 存放地点	69
13.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	光大阳光价值 30 个月持有期混合型集合资产管理计划	
基金简称	光大阳光价值 30 个月持有混合	
基金主代码	860007	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 4 月 17 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	239,830,538.26 份	
基金合同存续期	3 年	
下属分级基金的基金简称	光大阳光价值 30 个月持有混合 A	光大阳光价值 30 个月持有混合 B
下属分级基金的交易代码	860007	860027
报告期末下属分级基金的份额总额	33,520,278.89 份	206,310,259.37 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	在深入研究、控制和分散投资组合风险的前提下，实现集合计划资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>（一）资产配置策略</p> <p>本集合计划通过定性与定量研究相结合的方法，确定投资组合中权益类资产和固定收益类资产的配置比例。本集合计划通过动态跟踪海内外主要经济体的 GDP、CPI、利率等宏观经济指标，以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等市场指标，确定未来市场变动趋势。本集合计划通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势，对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。根据上述定性和定量指标的分析结果，运用资产配置优化模型，在目标收益条件下，追求风险最小化目标，最终确定大类资产投资权重，实现资产合理配置。</p> <p>（二）权益类品种的投资策略</p> <p>1、行业配置策略</p> <p>本集合计划重点投资于一些符合转型期中国经济发展趋势的行业或子行业，如由人口老龄化驱动的医疗行业、具有品牌优势的消费品行业、可以替代人工的自动化行业等。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>包括（1）一级市场申购策略；（2）二级市场股票投资策略；（3）港股通股票投资策略（4）参与定向增发投资策略。</p> <p>（三）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>（四）资产支持证券投资策略</p> <p>本集合计划将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。</p> <p>（五）衍生品投资策略</p> <p>1、股指期货投资策略</p> <p>管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本集合计划的投资目标。本集合计划在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。</p> <p>2、国债期货的投资策略</p> <p>本集合计划投资国债期货以套期保值为目的，国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。管理人通过动态管理国债期货合约数量，以获取相应债券组合的超额收益。</p>
业绩比较基准	<p>中证 800 指数收益率×40%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×40%+中债综合指数收益率×20%。</p>
风险收益特征	<p>本集合计划为混合型集合计划，其预期风险和预期收益高于债券型基金、债券型集合计划、货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于股票型基金和股票型集合计划。</p> <p>本集合计划除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内集合计划类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本集合计划还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</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	zhuyi1@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		2020 年 4 月 17 日(基金合同生效日)-2020 年 12 月 31 日	
	光大阳光价值 30 个 月持有混合 A	光大阳光价值 30 个 月持有混合 B	光大阳光价值 30 个 月持有混合 A	光大阳光价值 30 个 月持有混合 B
本期已实现收益	9,688,974.39	30,536,243.04	13,671,112.14	24,476,757.03
本期利润	-11,020,485.79	-39,282,383.28	48,596,540.03	96,826,441.00
加权平均基金份额本期利润	-0.3062	-0.1904	0.9915	0.5256
本期加权平均净值利润率	-11.09%	-12.71%	42.86%	40.59%
本期基金份额净值增长率	-12.64%	-12.46%	53.23%	52.78%
3.1.2 期末数 据和指 标	2021 年末		2020 年末	

期末可供分配利润	48,767,555.42	60,424,015.22	56,080,540.03	29,887,782.80
期末可供分配基金份额利润	1.4549	0.2929	1.3266	0.1449
期末基金资产净值	82,287,834.31	275,918,232.83	118,786,432.23	315,200,616.11
期末基金份额净值	2.4549	1.3374	2.8100	1.5278
3.1.3 累计期末指标	2021 年末		2020 年末	
基金份额累计净值增长率	33.86%	33.74%	53.23%	52.78%

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 1 月 1 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

光大阳光价值 30 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
过去三个月	-5.07%	0.95%	-1.74%	0.60%	-3.33%	0.35%

过去六个月	-17.00%	1.36%	-8.61%	0.81%	-8.39%	0.55%
过去一年	-12.64%	1.42%	-5.66%	0.87%	-6.98%	0.55%
自基金合同生效起 至今	33.86%	1.37%	13.17%	0.87%	20.69%	0.50%

光大阳光价值 30 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
过去三个月	-5.02%	0.95%	-1.74%	0.60%	-3.28%	0.35%
过去六个月	-16.92%	1.36%	-8.61%	0.81%	-8.31%	0.55%
过去一年	-12.46%	1.42%	-5.66%	0.87%	-6.80%	0.55%
自基金合同生效起 至今	33.74%	1.37%	12.21%	0.87%	21.53%	0.50%

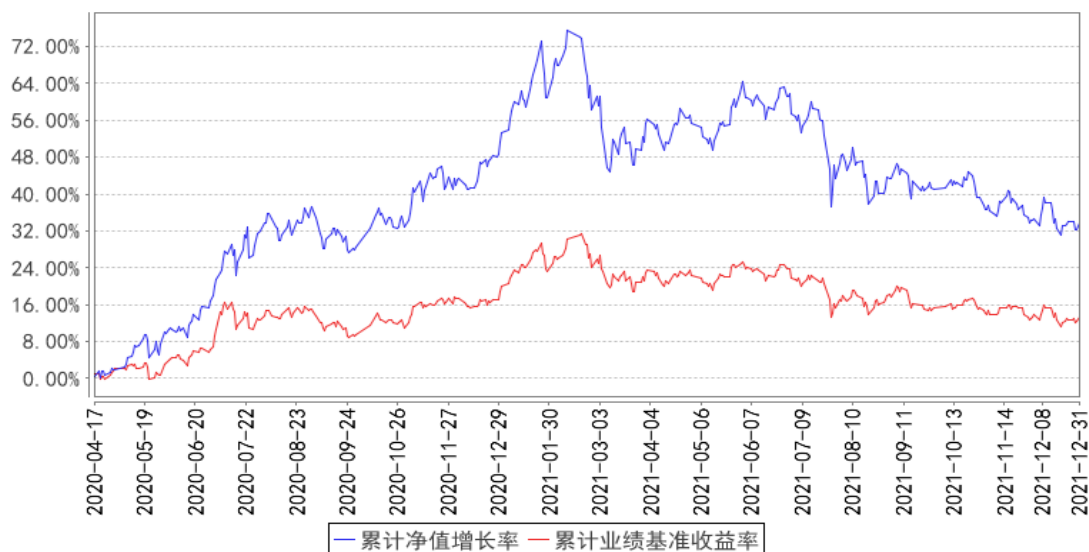
注：1、自基金合同生效日起至今指 2020 年 4 月 17 日-2021 年 12 月 31 日。

2、业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×40%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×40%+中债综合指数收益率×20%。

3、B 类份额设立日为 2020 年 4 月 17 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

光大阳光价值30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

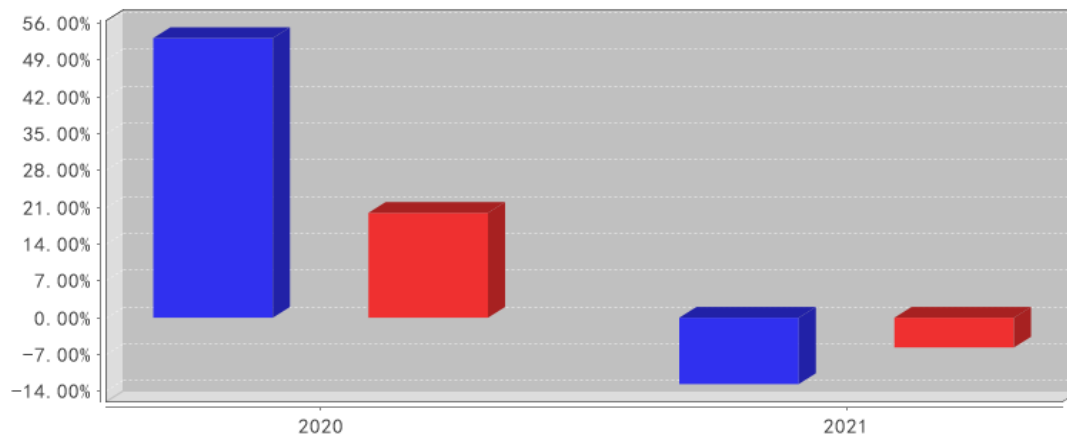


光大阳光价值30个月持有混合B累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



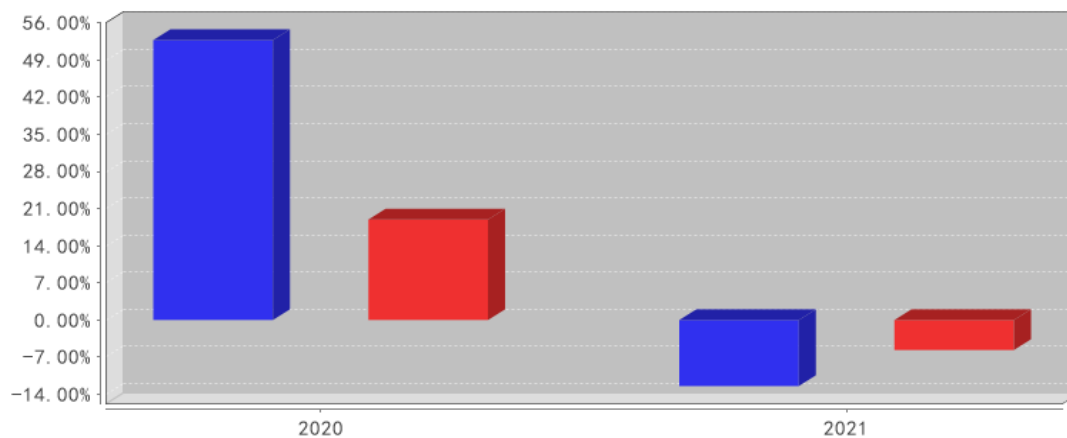
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

光大阳光价值30个月持有混合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



- 光大阳光价值30个月持有混合A净值增长率
- 光大阳光价值30个月持有混合A业绩基准收益率

光大阳光价值30个月持有混合B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



- 光大阳光价值30个月持有混合B净值增长率
- 光大阳光价值30个月持有混合B业绩基准收益率

注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

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		
王海涛	权益公募投资部总经理、本集合计划投资经理、光大阳光生活 18 个月持有期混合型集合资产管理计划投资经理、光大阳光智造混合型集合资产管理计划投资经理、光大阳光香港精选混合型集合资产管	2020 年 4 月 17 日	-	15 年	王海涛先生，北京师范大学硕士研究生毕业，历任首创证券、华泰证券研究员，太平资管、平安信托高级投资经理，上海人寿保险、华宝证券投资部门总经理，2019 年加入光证资管，现任权益公募投资部总经理。

	理计划投资经理				
--	---------	--	--	--	--

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，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。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

光大阳光价值的投资策略核心，可以用两句话来概括：一是价值投资，投资估值合理，目前

或未来拥有较高的 ROE 企业。二是投资 A 股和港股两个市场，均衡配置，选取两个市场的价值型企业。

2021 年 A 股市场成长风格与小市值风格盛行，低估值高 ROE 的蓝筹股，从 2 月份开始走出了一波熊市行情。代表性的金融地产、家电、白酒、建材等价值型行业，均出现了相当程度的下跌。同期港股市场互联网、医药、消费等港股市场相关行业，在政策压力下，也经历了一波熊市。我们的产品两个市场都遇到了较大的挑战。

在 2021 年虽然遇到了较大的挑战，但我们的投资风格没有发生偏移，仍然坚持价值风格。因为我们坚信，市场风格虽然摇摆不断，各种政策也是应接不暇，但企业价值、商业模式、客户需求更为恒久。作为一个拥有相对较长持有期的产品，我们没必要去追逐市场，而应盯紧复合回报率，甚至阶段性的做出逆势操作。

2021 年已经过去，我们的投资也有成败得失。比较成功的是，我们经历了一年的逆势，仍然风格稳定。需要总结的是，我们如何在未来能够继续降低产品的净值波动，提高夏普比率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 12 月 31 日，光大阳光价值 30 个月持有混合 A 类份额净值为 2.4549 元，本报告期份额净值增长率为-12.64%；光大阳光价值 30 个月持有混合 B 类份额净值为 1.3374 元，本报告期份额净值增长率为-12.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年的市场可预测性比较差，经过三年牛市，结构性牛市已经走到了极致。以新能源、半导体为代表的成长股，政策利好行业，都经历了非常大的涨幅，市场已经开始对利好变的迟钝，风险不断累积。对应的，该类公司进入了业绩兑现阶段，分化将大幅增加。另一方面，以中证 100、恒生指数为代表的资产，已经经历了接近一年的熊市，回调的幅度和时间都达到了历史平均水平。

宏观经济方面，利率一直是我们最关心的变量。我们认为全球加息周期预期下的国内利率，下调空间非常有限，不排除会出现阶段性上升。这对于场内资金会构成一定的压力，会促使投资者重新审视自己的投资组合。同时，过去一年各种政策冲击频发，对于宏观经济也造成了一定的干扰，2022 年我们判断政策协同性会增加，也会更加审慎。

参考目前的市场状况，我们倾向于认为目前价值类资产相对于成长类拥有更高的性价比，因这类资产通常在利率上升的初期会有更好的表现。同时，2021 年由于国内政策冲击，表现不佳的优秀企业，也会在 2022 年迎来估值修复。

对于中长期，我们仍然对以下几个问题表示关注，一是中国的老龄化趋势带来的影响；二是市场与政府之间的关系及其趋势；三是新时代背景下商业模式的演绎。希望我们在未来找到三个

问题的答案。

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价值 30 个月持有其混合型集合资产管理计划（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《光大阳光价值 30 个月持有其混合型集合资产管理计划 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_B04 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	安永华明（2022）审字第 61263195_B04 号
审计意见	<p>我们审计了光大阳光价值 30 个月持有期混合型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 年度的利润表、所有者权益（集合计划净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的光大阳光价值 30 个月持有期混合型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价值 30 个月持有期混合型集合资产管理计划 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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价值 30 个月持有期混合型集合资产管理计划，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。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>光大阳光价值 30 个月持有期混合型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。</p> <p>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。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，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>
管理层和治理层对财务报表的责任	<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价值 30 个月持有期混合型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</p>

	<p>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价值 30 个月持有期混合型集合资产管理计划的财务报告过程。</p>	
注册会计师对财务报表审计的责任	<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，就可能对光大阳光价值 30 个月持有期混合型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价值 30 个月持有期混合型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> <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。</p>	
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	丁诗怡
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：光大阳光价值 30 个月持有期混合型集合资产管理计划

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	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	26,304,059.20	28,579,159.11
结算备付金		60,953.77	103,837.98
存出保证金		18,118.18	79,446.31
交易性金融资产	7.4.7.2	333,053,241.60	409,567,759.09
其中：股票投资		333,053,241.60	409,567,759.09
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	631,448.45
应收利息	7.4.7.5	9,207.69	10,243.30
应收股利		-	14,851.06
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		359,445,580.44	438,986,745.30
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 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		29.54	7.30
应付赎回款		-	651,844.91
应付管理人报酬		197,594.75	271,102.15
应付托管费		61,174.33	69,636.99
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	41,464.82	66,623.93
应交税费		801,249.86	3,800,481.68
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	138,000.00	140,000.00
负债合计		1,239,513.30	4,999,696.96
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	239,830,538.26	248,582,971.20
未分配利润	7.4.7.10	118,375,528.88	185,404,077.14
所有者权益合计		358,206,067.14	433,987,048.34
负债和所有者权益总计		359,445,580.44	438,986,745.30

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，本集合计划份额总额为 239,830,538.26 份，其中光大阳光价值 30 个月持有混合 A 集合计划份额总额为 33,520,278.89 份，集合计划份额净值 2.4549 元；光大阳光价值 30 个月持有混合 B 集合计划份额总额为 206,310,259.37 份，集合计划份额净值 1.3374 元。

7.2 利润表

会计主体：光大阳光价值 30 个月持有期混合型集合资产管理计划

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 4 月 17 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		-44,675,942.37	150,247,756.02
1. 利息收入		443,478.03	269,592.25
其中：存款利息收入	7.4.7.11	443,478.03	269,592.25
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		45,408,666.10	42,702,996.69
其中：股票投资收益	7.4.7.12	40,521,579.18	39,581,225.88
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	4,887,086.92	3,121,770.81

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-90,528,086.50	107,275,111.86
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	55.22
减：二、费用		5,626,926.70	4,824,774.99
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,657,748.77	1,643,315.02
2. 托管费	7.4.10.2.2	819,385.22	494,430.68
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	689,923.73	1,425,341.97
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1,321,868.98	1,127,533.80
7. 其他费用	7.4.7.20	138,000.00	134,153.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-50,302,869.07	145,422,981.03
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-50,302,869.07	145,422,981.03

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：光大阳光价值 30 个月持有期混合型集合资产管理计划

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 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）	248,582,971.20	185,404,077.14	433,987,048.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-50,302,869.07	-50,302,869.07
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）	-8,752,432.94	-16,725,679.19	-25,478,112.13
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回	-8,752,432.94	-16,725,679.19	-25,478,112.13

回款			
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）	239,830,538.26	118,375,528.88	358,206,067.14
项目	上年度可比期间 2020 年 4 月 17 日（基金合同生效日）至 2020 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）	57,469,244.51	47,922,874.90	105,392,119.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	145,422,981.03	145,422,981.03
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）	191,113,726.69	-7,941,778.79	183,171,947.90
其中：1. 基金申购款	206,310,259.37	12,064,381.74	218,374,641.11
2. 基金赎回款	-15,196,532.68	-20,006,160.53	-35,202,693.21
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	248,582,971.20	185,404,077.14	433,987,048.34

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：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

光大阳光价值 30 个月持有期混合型集合资产管理计划由原光大阳光内需动力集合资产管理计划转型而来。光大阳光内需动力集合资产管理计划的管理人上海光大证券资产管理有限公司于 3 月 17 日发布《光大阳光内需动力集合资产管理计划合同变更公告》，光大阳光内需动力集合资产管理计划产品变更为光大阳光价值 30 个月持有期混合型集合资产管理计划，光大阳光内需动力集合资产管理计划份额变更为光大阳光价值 30 个月持有期混合型集合资产管理计划 A 类份额。自 2020 年 4 月 17 日起，《光大阳光价值 30 个月持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》、《光大阳光价值 30 个月持有期混合型集合资产管理计划托管协议》生效，本集合计划资产管理合同变更生效之日起存续期不得超过 3 年。本集合计划的管理人为上海光大证券资产管理有限公司，托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《光大阳光价值 30 个月持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》的有关规定，本集合计划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（含创业板、中小板及其他经中国证监会允许集合计划投资的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本集合计划的投资组合比例为：股票资产占集合计划资产的比例为 60%~95%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%）。每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于集合计划资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

本集合计划业绩比较基准：中证 800 指数收益率×40%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×40%+中债综合指数收益率×20%。

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》、《光大阳光价值 30 个月持有期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 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 1 月 1 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 1 月 1 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 1 月 1 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、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

本集合计划持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具(主要为权证投资)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

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的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；
- 3、集合计划收益分配后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、同一类别每一集合计划份额享有同等分配权；
- 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	26,304,059.20	28,579,159.11
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	26,304,059.20	28,579,159.11
----	---------------	---------------

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	310,317,950.56	333,053,241.60	22,735,291.04
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	310,317,950.56	333,053,241.60	22,735,291.04
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	293,251,648.00	409,567,759.09	116,316,111.09
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	293,251,648.00	409,567,759.09	116,316,111.09

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	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	9,051.17	10,124.04
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	147.20	81.57
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	9.32	37.69
合计	9,207.69	10,243.30

7.4.7.6 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。

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	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	41,464.82	66,623.93
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	41,464.82	66,623.93

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	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	138,000.00	140,000.00
合计	138,000.00	140,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

光大阳光价值 30 个月持有混合 A

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	42,272,711.83	42,272,711.83
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-8,752,432.94	-8,752,432.94
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	33,520,278.89	33,520,278.89

光大阳光价值 30 个月持有混合 B

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	206,310,259.37	206,310,259.37
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
-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	206,310,259.37	206,310,259.37

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

光大阳光价值 30 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	56,080,540.03	20,432,714.37	76,513,254.40
本期利润	9,688,974.39	-20,709,460.18	-11,020,485.79
本期基金份额 交易产生的变 动数	-12,368,560.99	-4,356,652.20	-16,725,213.19
其中：基金申 购款	-	-	-
基金赎 回款	-12,368,560.99	-4,356,652.20	-16,725,213.19
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	53,400,953.43	-4,633,398.01	48,767,555.42

光大阳光价值 30 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	29,887,782.80	79,003,039.94	108,890,822.74
本期利润	30,536,243.04	-69,818,626.32	-39,282,383.28
本期基金份额 交易产生的变 动数	-10.62	-455.38	-466.00
其中：基金申 购款	-	-	-

基金赎回款	-10.62	-455.38	-466.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	60,424,015.22	9,183,958.24	69,607,973.46

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2020年4月17日（基金合同生效日）至2020年12月31日
活期存款利息收入	434,552.01	244,244.56
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	7,111.68	17,627.39
其他	1,814.34	7,720.30
合计	443,478.03	269,592.25

注：其他为交易所结算保证金、直销申购款利息收入。

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1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年4月17日（基金合同生效日）至2020年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	40,521,579.18	39,581,225.88
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	40,521,579.18	39,581,225.88

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1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年4月17日（基金合同
----	-----------------------------	----------------------------

	日	生效日) 至 2020 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	222,424,972.27	366,548,941.19
减: 卖出股票成本总额	181,903,393.09	326,967,715.31
买卖股票差价收入	40,521,579.18	39,581,225.88

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 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本集合计划本报告期无债券投资收益。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本集合计划本报告期无买卖债券差价收入。

7.4.7.13.3 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。

7.4.7.13.4 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。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本集合计划本报告期无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 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。

7.4.7.14.2 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。

7.4.7.14.3 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。

7.4.7.14.4 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。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 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。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本集合计划本报告期无衍生工具收益-其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 4 月 17 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	4,887,086.92	3,121,770.81
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	4,887,086.92	3,121,770.81

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 4 月 17 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-93,580,820.05	111,061,756.93
股票投资	-93,580,820.05	111,061,756.93
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-

权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-3,052,733.55	3,786,645.07
合计	-90,528,086.50	107,275,111.86

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 4 月 17 日（基金合 同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
其他收入	-	55.22
合计	-	55.22

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 4 月 17 日（基金合同生效日） 至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	689,923.73	1,425,341.97
银行间市场交易费用	-	-
合计	689,923.73	1,425,341.97

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 4 月 17 日（基金合同生效日） 至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	18,000.00	14,153.52
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
合计	138,000.00	134,153.52

7.4.7.21 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。

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。

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1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年4月17日（基金合同生效日） 至2020年12月31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	409,959,745.94	100.00	886,217,123.22	100.00

7.4.10.1.2 债券交易

本集合计划本报告期无债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本集合计划本报告期无债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本集合计划本报告期无权证交易。

7.4.10.1.5 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	305,239.79	100.00	41,464.82	100.00

关联方名称	上年度可比期间 2020年4月17日（基金合同生效日）至2020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	660,951.11	100.00	66,623.93	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经手费的净额列示。

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。

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1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年4月17日（基金合 同生效日）至2020年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,657,748.77	1,643,315.02
其中：支付销售机构的客户维护费	1,091,517.58	643,366.35

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0.8%，B类份额固定年管理费率为0.6%，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1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年4月17日（基金合 同生效日）至2020年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	819,385.22	494,430.68

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。计算方法如下：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

本集合计划无销售服务费。

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
	光大阳光价值 30 个月持有混合 A	光大阳光价值 30 个月持有混合 B
基金合同生效日（2020 年 4 月 17 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	13,594,670.53
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	13,594,670.53

报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	5.6700%
项目	上年度可比期间 2020年4月17日（基金合同生效日）至2020年12月31日	上年度可比期间 2020年4月17日（基金合同生效日）至2020年12月31日
	光大阳光价值 30 个月持有混合 A	光大阳光价值 30 个月持有混合 B
基金合同生效日（2020年4月17日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	13,594,670.53
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	13,594,670.53
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	5.4700%

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投资、转换转入份额，期间赎回/卖出总份额含转换转出份额。

2、关联方投资本集合计划的费率按照集合计划合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

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

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。

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1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年4月17日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
光大银行	26,304,059.20	434,552.01	28,579,159.11	244,244.56

注：本集合计划的银行存款由集合计划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

本集合计划本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本集合计划本报告期没有需作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本集合计划本报告期末进行利润分配。

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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新股流通受限	16.53	16.53	90	1,487.70	1,487.70	-
300774	倍杰特	2021年7月26日	2022年2月16日	新股流通受限	4.57	21.08	185	845.45	3,899.80	-
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	新股流通受限	8.40	23.88	165	1,386.00	3,940.20	-
300854	中兰环保	2021年9月8日	2022年3月17日	新股流通受限	9.96	27.29	83	826.68	2,265.07	-
300994	久祺股份	2021年8月2日	2022年2月14日	新股流通受限	11.90	45.45	173	2,058.70	7,862.85	-
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2022年1月5日	新股流通受限	8.86	23.80	366	3,242.76	8,710.80	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	新股流通受限	8.29	26.06	268	2,221.72	6,984.08	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	新股流通受限	10.64	30.44	148	1,574.72	4,505.12	-
301025	读客文化	2021年7月6日	2022年1月19日	新股流通受限	1.55	20.88	127	196.85	2,651.76	-
301026	浩通科技	2021年7月8日	2022年1月17日	新股流通受限	18.03	62.73	87	1,568.61	5,457.51	-
301027	华蓝集团	2021年7月8日	2022年1月17日	新股流通受限	11.45	16.65	135	1,545.75	2,247.75	-

301028	东亚机械	2021年7月12日	2022年1月20日	新股流通受限	5.31	13.50	390	2,070.90	5,265.00	-
301029	怡合达	2021年7月14日	2022年1月24日	新股流通受限	14.14	89.87	194	2,743.16	17,434.78	-
301030	仕净科技	2021年7月15日	2022年1月24日	新股流通受限	6.10	31.52	116	707.60	3,656.32	-
301032	新柴股份	2021年7月15日	2022年1月24日	新股流通受限	4.97	12.51	214	1,063.58	2,677.14	-
301033	迈普医学	2021年7月15日	2022年1月26日	新股流通受限	15.14	59.97	55	832.70	3,298.35	-
301035	润丰股份	2021年7月21日	2022年1月28日	新股流通受限	22.04	56.28	381	8,397.24	21,442.68	-
301036	双乐股份	2021年7月21日	2022年1月29日	新股流通受限	23.38	29.93	92	2,150.96	2,753.56	-
301037	保立佳	2021年7月21日	2022年1月30日	新股流通受限	14.82	24.26	73	1,081.86	1,770.98	-
301039	中集车辆	2021年7月1日	2022年1月10日	新股流通受限	6.96	12.51	1,332	9,270.72	16,663.32	-
301041	金百泽	2021年8月2日	2022年2月11日	新股流通受限	7.31	28.21	95	694.45	2,679.95	-
301046	能辉科技	2021年8月10日	2022年2月17日	新股流通受限	8.34	48.99	141	1,175.94	6,907.59	-
301048	金鹰重工	2021年8月11日	2022年2月28日	新股流通受限	4.13	12.96	391	1,614.83	5,067.36	-
301049	超越科技	2021年8月17日	2022年2月24日	新股流通受限	19.34	32.92	92	1,779.28	3,028.64	-
301050	雷电微力	2021年8月17日	2022年2月24日	新股流通受限	60.64	234.74	132	8,004.48	30,985.68	-
301052	果麦文化	2021年8月23日	2022年2月28日	新股流通受限	8.11	33.64	128	1,038.08	4,305.92	-

		日	日							
301053	远信工业	2021年 8月25 日	2022年 03月 01日	新股流 通受限	11.87	28.78	95	1,127.65	2,734.10	-
301057	汇隆新材	2021年 8月31 日	2022年 3月9 日	新股流 通受限	8.03	19.02	107	859.21	2,035.14	-
301058	中粮工科	2021年 9月1 日	2022年 03月 09日	新股流 通受限	3.55	18.24	499	1,771.45	9,101.76	-
301059	金三江	2021年 9月3 日	2022年 03月 14日	新股流 通受限	8.09	19.30	118	954.62	2,277.40	-
301060	兰卫医学	2021年 9月6 日	2022年 03月 14日	新股流 通受限	4.17	30.94	151	629.67	4,671.94	-
301062	上海艾录	2021年 9月7 日	2022年 03月 14日	新股流 通受限	3.31	17.01	224	741.44	3,810.24	-
301066	万事利	2021年 9月13 日	2022年 03月 22日	新股流 通受限	5.24	22.84	171	896.04	3,905.64	-
301073	君亭酒店	2021年 9月22 日	2022年 03月 30日	新股流 通受限	12.24	32.00	72	881.28	2,304.00	-
301078	孩子王	2021年 9月30 日	2022年 04月 14日	新股流 通受限	5.77	12.14	344	1,984.88	4,176.16	-
301079	邵阳液压	2021年 10月11 日	2022年 04月 19日	新股流 通受限	11.92	24.82	63	750.96	1,563.66	-
301081	严牌股份	2021年 10月13 日	2022年 04月 20日	新股流 通受限	12.95	17.44	150	1,942.50	2,616.00	-
301083	百胜智能	2021年 10月13 日	2022年 04月 21日	新股流 通受限	9.08	14.21	130	1,180.40	1,847.30	-
301088	戎美股份	2021年 10月19 日	2022年 04月 28日	新股流 通受限	33.16	24.67	201	6,665.16	4,958.67	-
301089	拓新药业	2021年 10月20 日	2022年 04月 27日	新股流 通受限	19.11	67.93	97	1,853.67	6,589.21	-
301090	华润	2021年	2022年	新股流	10.45	11.22	703	7,346.35	7,887.66	-

	材料	10月19日	04月26日	通受限						
301091	深城交	2021年10月20日	2022年04月29日	新股流通受限	36.50	31.31	245	8,942.50	7,670.95	-
301092	争光股份	2021年10月21日	2022年05月05日	新股流通受限	36.31	35.52	146	5,301.26	5,185.92	-
301093	华兰股份	2021年10月21日	2022年05月05日	新股流通受限	58.08	49.85	110	6,388.80	5,483.50	-
301096	百诚医药	2021年12月13日	2022年06月20日	新股流通受限	79.60	78.53	97	7,721.20	7,617.41	-
301098	金埔园林	2021年11月4日	2022年05月12日	新股流通受限	12.36	22.17	193	2,385.48	4,278.81	-
301099	雅创电子	2021年11月10日	2022年05月23日	新股流通受限	21.99	71.36	133	2,924.67	9,490.88	-
301100	风光股份	2021年12月10日	2022年06月17日	新股流通受限	27.81	31.14	236	6,563.16	7,349.04	-
301101	明月镜片	2021年12月9日	2022年06月16日	新股流通受限	26.91	43.36	154	4,144.14	6,677.44	-
301108	洁雅股份	2021年11月25日	2022年06月06日	新股流通受限	57.27	53.71	96	5,497.92	5,156.16	-
301111	粤万年青	2021年11月30日	2022年06月07日	新股流通受限	10.48	36.68	134	1,404.32	4,915.12	-
301118	恒光股份	2021年11月9日	2022年05月18日	新股流通受限	22.70	49.02	129	2,928.30	6,323.58	-
301126	达嘉维康	2021年11月30日	2022年06月07日	新股流通受限	12.37	19.23	254	3,141.98	4,884.42	-
301127	天源环保	2021年12月23日	2022年06月30日	新股流通受限	12.03	17.12	649	7,807.47	11,110.88	-
301133	金钟股份	2021年11月19日	2022年05月26日	新股流通受限	14.33	26.95	147	2,106.51	3,961.65	-

301136	招标股份	2021年 12月31 日	2022年 1月11 日	新股流 通受限	10.52	10.52	2,637	27,741.24	27,741.24	-
301138	华研精机	2021年 12月8 日	2022年 06月 15日	新股流 通受限	26.17	44.86	124	3,245.08	5,562.64	-
301155	海力风电	2021年 11月17 日	2022年 05月 24日	新股流 通受限	60.66	96.75	248	15,043.68	23,994.00	-
301168	通灵股份	2021年 12月2 日	2022年 06月 10日	新股流 通受限	39.08	52.13	161	6,291.88	8,392.93	-
301177	迪阿股份	2021年 12月8 日	2022年 06月 15日	新股流 通受限	116.88	116.08	95	11,103.60	11,027.60	-
301179	泽宇智能	2021年 12月1 日	2022年 06月 08日	新股流 通受限	43.99	50.77	133	5,850.67	6,752.41	-
301182	凯旺科技	2021年 12月16 日	2022年 06月 23日	新股流 通受限	27.12	30.58	99	2,684.88	3,027.42	-
301185	鸥玛软件	2021年 11月11 日	2022年 05月 19日	新股流 通受限	11.88	21.16	190	2,257.20	4,020.40	-
301188	力诺特玻	2021年 11月4 日	2022年 05月 11日	新股流 通受限	13.00	20.48	237	3,081.00	4,853.76	-
301189	奥尼电子	2021年 12月21 日	2022年 06月 28日	新股流 通受限	66.18	56.62	119	7,875.42	6,737.78	-
301190	善水科技	2021年 12月17 日	2022年 06月 24日	新股流 通受限	27.85	27.46	234	6,516.90	6,425.64	-
301193	家联科技	2021年 12月2 日	2022年 06月 09日	新股流 通受限	30.73	29.14	153	4,701.69	4,458.42	-
301198	喜悦智行	2021年 11月25 日	2022年 06月 02日	新股流 通受限	21.76	29.20	96	2,088.96	2,803.20	-
301199	迈赫股份	2021年 11月30 日	2022年 06月 07日	新股流 通受限	29.28	32.00	179	5,241.12	5,728.00	-
301221	光庭信息	2021年 12月15 日	2022年 06月	新股流 通受限	69.89	88.72	107	7,478.23	9,493.04	-

		日	22 日							
601728	中国 电信	2021 年 8 月 11 日	2022 年 02 月 21 日	新股流 通受限	4.53	4.27	59,111	267,772.83	252,403.97	-
688262	国芯 科技	2021 年 12 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股流 通受限	41.98	41.98	2,351	98,694.98	98,694.98	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本集合计划本报告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交易中作为抵押的债券。

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

本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末未持有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

本集合计划本报告期末未持有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

本集合计划本报告期末未持有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

本集合计划本报告期末未持有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

本集合计划本报告期末未持有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

本集合计划的管理人在运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本集合计划资产的流动性风险进行管理，集合计划管理人建立了健全的流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，对组合持仓集中度、流动性受限资产比例、现金类资产比例等流动性指标进行持续的监测和分析，通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，对交易对手进行必要的尽职调查和准入，加强逆回购的流动性风险和交易对手风险的管理，并健全了逆回购交易质押品管理制度。

本集合计划所持有的的证券大部分具有良好的流动性，部分证券流通暂时受限的情况参见附注 7.4.12 “期末（2021 年 12 月 31 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。

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	26,304,059.20	-	-	-	26,304,059.20
结算备付金	60,953.77	-	-	-	60,953.77
存出保证金	18,118.18	-	-	-	18,118.18
交易性金融资产	-	-	-	-333,053,241.60	333,053,241.60
应收利息	-	-	-	9,207.69	9,207.69
资产总计	26,383,131.15	-	-	-333,062,449.29	359,445,580.44
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	197,594.75	197,594.75
应付托管费	-	-	-	61,174.33	61,174.33
应付证券清算款	-	-	-	29.54	29.54
应付交易费用	-	-	-	41,464.82	41,464.82
应交税费	-	-	-	801,249.86	801,249.86
其他负债	-	-	-	138,000.00	138,000.00
负债总计	-	-	-	1,239,513.30	1,239,513.30
利率敏感度缺口	26,383,131.15	-	-	-331,822,935.99	358,206,067.14
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	28,579,159.11	-	-	-	28,579,159.11
结算备付金	103,837.98	-	-	-	103,837.98
存出保证金	79,446.31	-	-	-	79,446.31
交易性金融资产	-	-	-	-409,567,759.09	409,567,759.09
应收利息	-	-	-	10,243.30	10,243.30
应收股利	-	-	-	14,851.06	14,851.06
应收证券清算款	-	-	-	631,448.45	631,448.45
资产总计	28,762,443.40	-	-	-410,224,301.90	438,986,745.30
负债					
应付赎回款	-	-	-	651,844.91	651,844.91
应付管理人报酬	-	-	-	271,102.15	271,102.15
应付托管费	-	-	-	69,636.99	69,636.99
应付证券清算款	-	-	-	7.30	7.30
应付交易费用	-	-	-	66,623.93	66,623.93

应交税费	-	-	-	3,800,481.68	3,800,481.68
其他负债	-	-	-	140,000.00	140,000.00
负债总计	-	-	-	4,999,696.96	4,999,696.96
利率敏感度缺口	28,762,443.40	-	-	-405,224,604.94	433,987,048.34

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本集合计划本报告期末未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于集合计划资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本集合计划持有以非记账本位币人民币计价的资产与负债，因此存在相应的外汇风险。本集合计划管理人每日对本集合计划的外汇头寸进行监控。

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			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	138,510,741.02	-	138,510,741.02
资产合计	-	138,510,741.02	-	138,510,741.02
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	-	138,510,741.02	-	138,510,741.02
项目	上年度末 2020年12月31日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	205,651,687.27	-	205,651,687.27

资产合计	-	205,651,687.27	-	205,651,687.27
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	-	205,651,687.27	-	205,651,687.27

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）	上年度末（2020年12月31日）
分析	港币相对人民币升值 5%	6,925,537.05	10,282,584.36
	港币相对人民币贬值 5%	-6,925,537.05	-10,282,584.36

7.4.13.4.3 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。

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		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	333,053,241.60	92.98	409,567,759.09	94.37
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	333,053,241.60	92.98	409,567,759.09	94.37

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）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	沪深 300 指数上升 5%	19,146,537.67	19,666,822.96
	沪深 300 指数下降 5%	-19,146,537.67	-19,666,822.96

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 332,237,188.00 元，属于第二层次的余额为 816,053.6 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 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	333,053,241.60	92.66
	其中：股票	333,053,241.60	92.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	26,365,012.97	7.33
8	其他各项资产	27,325.87	0.01
9	合计	359,445,580.44	100.00

注：本集合计划本报告期末未通过港股通交易机制投资的港股公允价值为：138,510,741.02 元，占期末集合计划资产净值比例为 38.67%。

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	1,100.95	0.00
B	采矿业	90.48	0.00
C	制造业	141,159,892.27	39.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,278.66	0.00
E	建筑业	13,509.86	0.00
F	批发和零售业	245,157.06	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	3,274,339.40	0.91
H	住宿和餐饮业	3,676.80	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	664,113.20	0.19
J	金融业	37,366,792.00	10.43
K	房地产业	11,264,867.19	3.14
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	346,635.01	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	157,313.36	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,302.00	0.00
Q	卫生和社会工作	6,547.36	0.00
R	文化、体育和娱乐业	27,884.98	0.01
S	综合	-	-
	合计	194,542,500.58	54.31

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	12,570,600.00	3.51
消费者常用品	3,654,263.20	1.02
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	44,765,644.00	12.50
工业	16,603,493.76	4.64
信息技术	46,847,479.26	13.08
电信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	14,069,260.80	3.93
合计	138,510,741.02	38.67

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	00700	腾讯控股	66,070	24,675,802.46	6.89
2	600309	万华化学	235,000	23,735,000.00	6.63
3	600036	招商银行	430,000	20,945,300.00	5.85
4	000333	美的集团	260,000	19,190,600.00	5.36
5	000858	五粮液	78,000	17,367,480.00	4.85
6	03323	中国建材	1,800,000	14,069,260.80	3.93
7	00853	微创医疗	600,000	13,931,904.00	3.89
8	02269	药明生物	180,000	13,620,398.40	3.80
9	03690	美团-W	70,000	12,900,092.80	3.60
10	300285	国瓷材料	300,000	12,771,000.00	3.57
11	000651	格力电器	310,000	11,479,300.00	3.20
12	000002	万科A	570,000	11,263,200.00	3.14
13	601318	中国平安	200,000	10,082,000.00	2.81
14	600887	伊利股份	230,000	9,535,800.00	2.66
15	00586	海螺创业	300,000	9,345,168.00	2.61
16	01810	小米集团-W	600,000	9,271,584.00	2.59
17	603899	晨光文具	140,000	9,031,400.00	2.52
18	002507	涪陵榨菜	230,000	8,694,000.00	2.43
19	01448	福寿园	1,650,000	8,269,615.20	2.31
20	600486	扬农化工	60,000	7,872,000.00	2.20
21	02382	舜宇光学科技	36,000	7,258,325.76	2.03
22	600276	恒瑞医药	140,000	7,099,400.00	1.98
23	002142	宁波银行	165,000	6,316,200.00	1.76
24	01302	先健科技	2,100,000	6,284,073.60	1.75
25	600585	海螺水泥	150,000	6,045,000.00	1.69
26	06160	百济神州	40,000	5,265,344.00	1.47
27	600809	山西汾酒	15,000	4,736,700.00	1.32
28	02020	安踏体育	45,000	4,300,984.80	1.20
29	00291	华润啤酒	70,000	3,654,263.20	1.02
30	600009	上海机场	70,000	3,268,300.00	0.91
31	09926	康方生物-B	105,000	2,918,832.00	0.81
32	01521	方达控股	850,000	2,745,092.00	0.77
33	002304	洋河股份	10,000	1,647,300.00	0.46
34	688032	禾迈股份	360	253,436.40	0.07
35	601728	中国电信	59,111	252,403.97	0.07
36	688110	东芯股份	3,821	172,632.78	0.05
37	688151	华强科技	4,032	146,280.96	0.04

38	688167	炬光科技	665	145,635.00	0.04
39	688248	南网科技	5,740	132,594.00	0.04
40	301127	天源环保	6,488	128,883.51	0.04
41	301177	迪阿股份	945	119,215.60	0.03
42	301221	光庭信息	1,063	100,762.36	0.03
43	688262	国芯科技	2,351	98,694.98	0.03
44	301168	通灵股份	1,602	94,939.39	0.03
45	301100	风光股份	2,356	85,895.04	0.02
46	301096	百诚医药	969	82,530.93	0.02
47	301101	明月镜片	1,532	81,613.08	0.02
48	688206	概伦电子	2,033	74,590.77	0.02
49	301179	泽宇智能	1,330	73,078.18	0.02
50	301138	华研精机	1,236	71,059.44	0.02
51	301189	奥尼电子	1,190	71,019.20	0.02
52	688265	南模生物	1,012	70,890.60	0.02
53	301190	善水科技	2,336	69,906.04	0.02
54	301111	粤万年青	1,335	62,863.37	0.02
55	301199	迈赫股份	1,788	62,284.35	0.02
56	301126	达嘉维康	2,532	56,572.24	0.02
57	301193	家联科技	1,530	48,315.87	0.01
58	688227	品高股份	1,203	38,592.24	0.01
59	301182	凯旺科技	987	34,693.50	0.01
60	688210	统联精密	798	33,085.08	0.01
61	301050	雷电微力	132	30,985.68	0.01
62	301136	招标股份	2,637	27,741.24	0.01
63	301155	海力风电	275	27,320.40	0.01
64	301035	润丰股份	405	22,834.68	0.01
65	600927	永安期货	547	20,523.44	0.01
66	301099	雅创电子	223	17,802.38	0.00
67	301039	中集车辆	1,412	17,689.72	0.00
68	301029	怡合达	194	17,434.78	0.00
69	301089	拓新药业	166	12,136.81	0.00
70	603071	物产环能	480	12,124.80	0.00
71	688112	鼎阳科技	112	10,973.76	0.00
72	301017	漱玉平民	454	10,836.00	0.00
73	301058	中粮工科	581	10,707.32	0.00
74	301011	华立科技	175	10,535.00	0.00
75	300994	久祺股份	227	10,434.33	0.00
76	301026	浩通科技	163	10,314.67	0.00
77	688190	云路股份	87	10,307.76	0.00
78	301093	华兰股份	200	10,181.50	0.00
79	603230	内蒙新华	388	10,037.56	0.00

80	301046	能辉科技	202	10,000.29	0.00
81	301118	恒光股份	186	9,860.43	0.00
82	301033	迈普医学	149	9,043.63	0.00
83	301108	洁雅股份	158	8,886.70	0.00
84	301015	百洋医药	285	8,635.50	0.00
85	301002	崧盛股份	152	8,177.60	0.00
86	301090	华润材料	724	8,165.70	0.00
87	301009	可靠股份	431	7,951.95	0.00
88	605111	新洁能	44	7,836.40	0.00
89	301091	深城交	248	7,769.83	0.00
90	300910	瑞丰新材	91	7,266.35	0.00
91	301018	申菱环境	272	7,090.00	0.00
92	300860	锋尚文化	83	7,035.08	0.00
93	301060	兰卫医学	205	6,547.36	0.00
94	003021	兆威机电	79	6,308.15	0.00
95	688232	新点软件	145	6,300.25	0.00
96	301012	扬电科技	124	6,279.36	0.00
97	301052	果麦文化	178	6,088.42	0.00
98	300814	中富电路	247	5,968.88	0.00
99	301078	孩子王	435	5,689.49	0.00
100	603216	梦天家居	224	5,664.96	0.00
101	301188	力诺特玻	265	5,542.56	0.00
102	300982	苏文电能	75	5,519.25	0.00
103	301092	争光股份	153	5,457.59	0.00
104	001317	三羊马	63	5,401.62	0.00
105	301028	东亚机械	397	5,361.39	0.00
106	301020	密封科技	174	5,309.82	0.00
107	301048	金鹰重工	403	5,231.40	0.00
108	300774	倍杰特	244	5,197.80	0.00
109	301098	金埔园林	222	5,099.51	0.00
110	301088	戎美股份	204	5,036.37	0.00
111	301030	仕净科技	158	5,014.18	0.00
112	001296	长江材料	83	4,920.24	0.00
113	301198	喜悦智行	151	4,848.65	0.00
114	301133	金钟股份	170	4,805.06	0.00
115	301066	万事利	203	4,711.08	0.00
116	301010	晶雪节能	192	4,604.16	0.00
117	301016	雷尔伟	177	4,587.84	0.00
118	300973	立高食品	34	4,490.72	0.00
119	300864	南大环境	97	4,404.77	0.00
120	301053	远信工业	148	4,318.80	0.00
121	301041	金百泽	149	4,287.53	0.00

122	300937	药易购	92	4,190.60	0.00
123	001215	千味央厨	71	4,132.91	0.00
124	301062	上海艾录	239	4,080.69	0.00
125	301185	鸥玛软件	192	4,073.82	0.00
126	603529	爱玛科技	88	4,010.16	0.00
127	003026	中晶科技	52	3,850.60	0.00
128	301049	超越科技	112	3,719.44	0.00
129	301073	君亭酒店	112	3,676.80	0.00
130	300614	百川畅银	75	3,600.00	0.00
131	301079	邵阳液压	127	3,595.66	0.00
132	300979	华利集团	40	3,562.00	0.00
133	301059	金三江	180	3,553.98	0.00
134	605555	德昌股份	87	3,549.60	0.00
135	300854	中兰环保	127	3,548.99	0.00
136	301036	双乐股份	118	3,548.38	0.00
137	301081	严牌股份	193	3,492.34	0.00
138	301025	读客文化	163	3,436.56	0.00
139	300985	致远新能	70	3,431.40	0.00
140	605376	博迁新材	40	3,361.20	0.00
141	300998	宁波方正	100	3,333.00	0.00
142	301007	德迈仕	165	3,286.80	0.00
143	300895	铜牛信息	80	3,258.40	0.00
144	301057	汇隆新材	168	3,245.99	0.00
145	003038	鑫铂股份	42	3,106.74	0.00
146	301083	百胜智能	200	3,050.60	0.00
147	301037	保立佳	123	3,027.48	0.00
148	301032	新柴股份	240	3,010.20	0.00
149	001210	金房节能	84	2,981.16	0.00
150	300925	法本信息	96	2,766.72	0.00
151	001218	丽臣实业	63	2,748.06	0.00
152	605259	绿田机械	82	2,734.70	0.00
153	001219	青岛食品	83	2,539.80	0.00
154	301027	华蓝集团	150	2,503.80	0.00
155	300907	康平科技	83	2,466.76	0.00
156	300929	华骐环保	90	2,412.00	0.00
157	300943	春晖智控	51	2,360.28	0.00
158	300992	泰福泵业	91	2,252.25	0.00
159	605058	澳弘电子	88	2,240.48	0.00
160	300986	志特新材	35	2,240.35	0.00
161	605005	合兴股份	92	2,188.68	0.00
162	003010	若羽臣	93	2,078.55	0.00
163	300996	普联软件	65	2,053.35	0.00

164	300926	博俊科技	81	1,927.80	0.00
165	600955	维远股份	42	1,916.46	0.00
166	300922	天秦装备	52	1,892.80	0.00
167	003027	同兴环保	75	1,834.50	0.00
168	300987	川网传媒	47	1,823.60	0.00
169	605068	明新旭腾	50	1,807.50	0.00
170	605339	南侨食品	54	1,799.28	0.00
171	300962	中金辐照	90	1,784.70	0.00
172	605020	永和股份	58	1,780.60	0.00
173	300886	华业香料	58	1,759.72	0.00
174	603171	税友股份	48	1,689.60	0.00
175	300917	特发服务	51	1,667.19	0.00
176	003029	吉大正元	77	1,620.85	0.00
177	001207	联科科技	74	1,619.12	0.00
178	300913	兆龙互连	59	1,614.83	0.00
179	605319	无锡振华	95	1,611.20	0.00
180	605177	东亚药业	57	1,575.48	0.00
181	605136	丽人丽妆	64	1,558.40	0.00
182	605337	李子园	30	1,491.00	0.00
183	001234	泰慕士	90	1,487.70	0.00
184	300958	建工修复	53	1,431.53	0.00
185	300930	屹通新材	44	1,427.36	0.00
186	605179	一鸣食品	93	1,408.95	0.00
187	605151	西上海	69	1,400.70	0.00
188	603759	海天股份	82	1,399.74	0.00
189	300940	南极光	39	1,385.67	0.00
190	605580	恒盛能源	84	1,363.32	0.00
191	300868	杰美特	52	1,339.52	0.00
192	002996	顺博合金	91	1,331.33	0.00
193	003032	传智教育	62	1,302.00	0.00
194	300861	美畅股份	16	1,244.32	0.00
195	003020	立方制药	27	1,238.22	0.00
196	003040	楚天龙	46	1,210.72	0.00
197	003031	中瓷电子	14	1,173.06	0.00
198	605122	四方新材	50	1,132.50	0.00
199	605028	世茂能源	48	1,118.40	0.00
200	603176	汇通集团	440	1,078.00	0.00
201	605577	龙版传媒	72	1,056.24	0.00
202	605277	新亚电子	34	1,035.98	0.00
203	600906	财达证券	81	1,033.56	0.00
204	605133	嵘泰股份	36	1,033.56	0.00
205	605303	园林股份	65	1,016.60	0.00

206	001216	华瓷股份	60	1,002.60	0.00
207	605069	正和生态	52	999.44	0.00
208	300891	惠云钛业	62	992.62	0.00
209	300966	共同药业	24	984.48	0.00
210	300997	欢乐家	56	970.48	0.00
211	605167	利柏特	97	955.45	0.00
212	605011	杭州热电	45	947.70	0.00
213	300892	品渥食品	23	931.96	0.00
214	603219	富佳股份	47	930.13	0.00
215	300890	翔丰华	15	927.45	0.00
216	300963	中洲特材	38	924.92	0.00
217	605258	协和电子	29	923.07	0.00
218	600032	浙江新能	59	912.14	0.00
219	300882	万胜智能	47	884.07	0.00
220	003013	地铁设计	44	883.52	0.00
221	300931	通用电梯	76	883.12	0.00
222	605299	舒华体育	46	879.52	0.00
223	605077	华康股份	21	878.85	0.00
224	003037	三和管桩	79	862.68	0.00
225	003006	百亚股份	48	860.64	0.00
226	605338	巴比食品	24	836.16	0.00
227	300948	冠中生态	34	833.68	0.00
228	300967	晓鸣股份	30	799.80	0.00
229	605598	上海港湾	50	796.50	0.00
230	003030	祖名股份	29	753.71	0.00
231	600935	华塑股份	98	748.72	0.00
232	300975	商络电子	41	714.63	0.00
233	605208	永茂泰	33	694.65	0.00
234	300942	易瑞生物	24	692.64	0.00
235	300893	松原股份	18	690.30	0.00
236	001208	华菱线缆	45	667.35	0.00
237	300960	通业科技	26	648.18	0.00
238	605566	福莱蒾特	21	644.49	0.00
239	688082	盛美上海	5	639.00	0.00
240	003025	思进智能	19	638.21	0.00
241	605365	立达信	33	632.61	0.00
242	300991	创益通	19	625.29	0.00
243	605186	健麾信息	16	580.16	0.00
244	601156	东航物流	26	568.88	0.00
245	605183	确成股份	28	550.20	0.00
246	603213	镇洋发展	23	532.68	0.00
247	301006	迈拓股份	21	505.89	0.00

248	001209	洪兴股份	18	491.04	0.00
249	300918	南山智尚	46	470.58	0.00
250	003019	宸展光电	16	467.68	0.00
251	300961	深水海纳	22	447.70	0.00
252	300955	嘉亨家化	13	427.31	0.00
253	601187	厦门银行	61	420.90	0.00
254	601825	沪农商行	62	418.50	0.00
255	605228	神通科技	45	417.15	0.00
256	001288	运机集团	23	409.63	0.00
257	003018	金富科技	37	408.85	0.00
258	601665	齐鲁银行	72	401.76	0.00
259	605162	新中港	30	382.80	0.00
260	300945	曼卡龙	18	378.54	0.00
261	605377	华旺科技	21	376.74	0.00
262	601686	友发集团	35	343.00	0.00
263	003028	振邦智能	8	335.20	0.00
264	003004	声迅股份	12	325.56	0.00
265	003023	彩虹集团	12	323.16	0.00
266	601528	瑞丰银行	28	315.84	0.00
267	300978	东箭科技	17	307.02	0.00
268	300972	万辰生物	19	301.15	0.00
269	605507	国邦医药	10	288.30	0.00
270	601921	浙版传媒	24	231.12	0.00
271	300876	蒙泰高新	7	211.89	0.00
272	605298	必得科技	11	208.12	0.00
273	001217	华尔泰	10	193.10	0.00
274	003036	泰坦股份	15	185.70	0.00
275	600916	中国黄金	13	178.49	0.00
276	601963	重庆银行	20	178.00	0.00
277	605055	迎丰股份	22	173.80	0.00
278	605368	蓝天燃气	12	173.40	0.00
279	605138	盛泰集团	12	144.96	0.00
280	688230	芯导科技	1	142.90	0.00
281	300950	德国特	3	125.25	0.00
282	001212	中旗新材	3	96.93	0.00
283	001203	大中矿业	6	90.48	0.00
284	605268	王力安防	7	89.81	0.00
285	688739	成大生物	1	76.13	0.00
286	300933	中辰股份	6	73.32	0.00
287	605180	华生科技	2	70.60	0.00
288	003035	南网能源	7	58.03	0.00
289	603565	中谷物流	2	56.78	0.00

290	605599	菜百股份	4	53.84	0.00
291	300932	三友联众	1	38.10	0.00
292	605196	华通线缆	2	21.46	0.00
293	605060	联德股份	1	17.00	0.00
294	001213	中铁特货	2	12.12	0.00

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	000002	万科 A	23,617,920.00	5.44
1	02202 HK	万科企业	3,978,672.14	0.92
2	000858	五粮液	11,072,032.00	2.55
3	00700 HK	腾讯控股	9,669,833.89	2.23
4	600887	伊利股份	8,729,905.00	2.01
5	600585	海螺水泥	8,397,331.96	1.93
6	000651	格力电器	7,777,747.00	1.79
7	03323 HK	中国建材	7,402,803.79	1.71
8	002507	涪陵榨菜	7,306,120.52	1.68
9	601318	中国平安	7,141,639.00	1.65
10	603899	晨光文具	6,261,181.08	1.44
11	002142	宁波银行	6,123,831.00	1.41
12	601166	兴业银行	5,508,564.00	1.27
13	600201	生物股份	5,481,161.03	1.26
14	002352	顺丰控股	5,154,335.00	1.19
15	02020 HK	安踏体育	4,666,677.66	1.08
16	09926 HK	康方生物-B	4,410,312.43	1.02
17	000333	美的集团	4,347,332.00	1.00
18	03690 HK	美团-W	4,172,918.97	0.96
19	00291 HK	华润啤酒	3,823,381.42	0.88
20	600009	上海机场	3,192,078.00	0.74

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	000002	万科 A	15,185,224.00	3.50
1	02202 HK	万科企业	3,608,404.82	0.83
2	600426	华鲁恒升	14,247,522.00	3.28
3	02020 HK	安踏体育	12,989,318.71	2.99
4	02382 HK	舜宇光学科技	11,778,611.50	2.71
5	600048	保利发展	11,627,952.00	2.68

6	03323 HK	中国建材	10,359,625.73	2.39
7	01066 HK	威高股份	9,956,412.07	2.29
8	00268 HK	金蝶国际	7,685,724.89	1.77
9	600486	扬农化工	7,317,856.00	1.69
10	01521 HK	方达控股	6,919,174.63	1.59
11	601318	中国平安	6,439,830.00	1.48
12	01801 HK	信达生物	6,385,140.94	1.47
13	03319 HK	雅生活服务	6,291,882.53	1.45
14	600809	山西汾酒	6,106,141.00	1.41
15	600309	万华化学	6,034,311.93	1.39
16	01177 HK	中国生物制药	6,020,927.11	1.39
17	601166	兴业银行	5,727,128.00	1.32
18	603899	晨光文具	4,769,255.40	1.10
19	300633	开立医疗	4,722,643.20	1.09
20	600201	生物股份	4,680,988.00	1.08

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	198,996,707.42
卖出股票收入（成交）总额	222,424,972.27

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

本集合计划本报告期末未持有债券。

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

本集合计划本报告期末未持有债券。

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进行股指期货投资。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本集合计划的投资目标。本集合计划在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

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

集合计划投资国债期货以套期保值为目的，国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。管理人通过动态管理国债期货合约数量，以获取相应债券组合的超额收益。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本集合计划本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本报告编制日前一年内：

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

2) 本集合计划持有的“招商银行”因未依法履行其他职责，被中国银行保险监督管理委员会公开处罚 7170 万元（银保监罚决字【2021】16 号）。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本集合计划投资的前十名股票未有超出集合计划合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	18,118.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,207.69
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,325.87

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本集合计划本报告期末未持有可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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 (%)
光大阳光价值 30 个月持有混合 A	284	118,029.15	-	-	33,520,278.89	100.00
光大阳光价值 30 个月持有混合 B	2,911	70,872.64	13,746,516.18	6.66	192,563,743.19	93.34
合计	3,195	75,064.33	13,746,516.18	5.73	226,084,022.08	94.27

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	光大阳光价值 30 个月持有混合 A	0.00	-
	光大阳光价值 30 个月持有混合 B	3,046,338.39	1.4766
	合计	3,046,338.39	1.2702

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	光大阳光价值 30 个月持有混合 A	0
	光大阳光价值 30 个月持有混合 B	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	光大阳光价值 30 个月持有混合 A	0
	光大阳光价值 30 个月持有混合 B	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	光大阳光价值 30 个月持有混合 A	光大阳光价值 30 个月持有混合 B
基金合同生效日 (2020 年 4 月 17 日) 基金份额总额	57,469,244.51	-
本报告期期初基金份额总额	42,272,711.83	206,310,259.37
本报告期基金总申购份额	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	8,752,432.94	-
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	33,520,278.89	206,310,259.37

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。

§ 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 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 18,000.00 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。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**11.7.1 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	409,959,745.94	100.00%	305,239.79	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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
光大证券	-	-	-	-	-	-

注：本集合计划本报告期末进行债券交易、债券回购交易以及权证交易。

11.8 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	关于旗下光大阳光价值 30 个月持有期混合型集合资产管理计划 A 类份额 2021 年港股通非交易日暂停开放的公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 01 月 20 日
2	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
3	关于直销渠道参与公司旗下参公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
4	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
5	光大阳光价值 30 个月持有期混合型集合资产管理计划招募说明书(更新)	中国证监会规定的媒介	2021 年 12 月 22 日
6	关于旗下光大阳光价值 30 个月持有期混合型集合资产管理计划 2021 年岁末港股通非交易日暂停开放公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 12 月 27 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

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、中国证监会关于同意光大阳光价值 30 个月持有期混合型集合资产管理计划合同变更的函；
- 2、《光大阳光价值 30 个月持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《光大阳光价值 30 个月持有期混合型集合资产管理计划托管协议》；

- 4、《光大阳光价值 30 个月持有期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。

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