

光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置 混合型集合资产管理计划 2021 年年度报告

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：广发银行股份有限公司

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。

集合计划托管人广发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	6
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	9
3.3 其他指标	13
3.4 过去三年基金的利润分配情况	13
§ 4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
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	18
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	18
§ 5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
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	18
§ 6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§ 7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	24

§ 8 投资组合报告	58
8.1 期末基金资产组合情况	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
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	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	70
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	72
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	73
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	73
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	73
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	73
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	73
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	74
8.12 市场中性策略执行情况	74
8.13 投资组合报告附注	74
§ 9 基金份额持有人信息	75
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	76
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	76
§ 10 开放式基金份额变动	77
§ 11 重大事件揭示	77
11.1 基金份额持有人大会决议	77
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	77
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	77
11.4 基金投资策略的改变	78
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	78
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	78
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	78
11.8 其他重大事件	78
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	79
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	79
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	79
§ 13 备查文件目录	79
13.1 备查文件目录	79
13.2 存放地点	79
13.3 查阅方式	79

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划		
基金简称	光大阳光对冲 6 个月持有混合		
基金主代码	860010		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2020 年 3 月 25 日		
基金管理人	上海光大证券资产管理有限公司		
基金托管人	广发银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	484,280,742.71 份		
基金合同存续期	3 年		
下属分级基金的基金简称	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C
下属分级基金的交易代码	860010	860028	860029
报告期末下属分级基金的份额总额	3,112,966.42 份	39,843,250.89 份	441,324,525.40 份

注：本报告中所述的“基金”包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

2.2 基金产品说明

投资目标	通过深入研究，捕捉宏观环境及政策趋势走向，灵活精选投资策略，在合理控制投资风险和保障集合计划资产流动性的基础上，追求集合计划资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本集合计划主要采用对冲套利的投资策略。通过数量化投资模型，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，并使用股指期货进行对冲操作，有效规避市场涨跌的系统性风险，获取选股的超额收益。力争实现集合计划资产长期稳健的绝对收益。另通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、信用风险、证券市场估值水平等因素，综合配置固定收益等各类资产，以实现整体资产的稳健增值。</p> <p>（一）股票投资策略</p> <p>本集合计划主要通过数量化投资模型，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。数量化投资模型的投资逻辑基于学术研究、投资实践中被普遍接受的选股因子构建对于个股的收益进行预测，因子包括价值、质量、成长、事件驱动、市场等大类。通过现代组合管理的数量化模型进行组合构建，优化系统风险及个股特定风险的最优配比。</p> <p>对于因子的选取，我们的方法论是自上而下的投资逻辑，首先保证其在经济学、金融学、行为金融学上的意义，判断其符合当前的经济和市场环境，然后再重点关注因子的稳定性、解释性、统计显著性。力求甄选出基本面绩优、在行业内有竞争优势、当前具有估值机会、具备核心成长潜力等方面的优秀上市公司。</p>

	<p>(二) 金融衍生工具对冲策略</p> <p>本集合计划在通过以上股票投资策略的基础上, 使用股指期货对冲组合的系统性风险, 从而分离出组合的超额收益。根据风险管理的原则, 以套期保值为目的, 在风险可控的前提下, 本着谨慎原则, 参与股指期货对冲。综合考虑股指期货不同合约之间的价差关系、套利机会、流动性等因素, 在各股指期货合约之间进行动态配置和临近到期合约的展期操作, 以提升组合收益和套期保值的效果。随着其他金融衍生工具的发展, 本集合计划会考虑使用法律法规允许范围内的其他对冲工具, 例如融券卖空、期权等。通过优选对冲工具, 提高管理市场风险的能力。</p> <p>(三) 融券投资策略</p> <p>本集合计划在投资机会和融券成本合适的情况下, 采用融券的方式进行配对交易。通过多因子模型, 可以找到行业、风格相近的股票之间存在的理论价差, 通过买入低价股、融券卖空高价股获得绝对收益。</p> <p>(四) 其他绝对收益投资策略</p> <p>包括: (1) 普通债券投资策略; (2) 可转债投资策略; (3) 衍生品投资策略; (4) 一级市场申购策略; (5) 现金类资产投资策略。</p> <p>(五) 资产支持证券投资策略</p> <p>本集合计划将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析, 并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型, 评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。</p>
业绩比较基准	中国人民银行公布的同期 1 年期银行定期存款基准利率(税后)+1%。
风险收益特征	本集合计划为混合型集合计划, 其预期风险和预期收益高于债券型基金、债券型集合计划、货币市场基金和货币型集合资产管理计划, 低于股票型基金和股票型集合计划。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海光大证券资产管理有限公司	广发银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	朱轶	顾洪峰
	联系电话	021-32068300	010-65169498
	电子邮箱	zhuyi1@ebscn.com	guhongfeng@cgbchina.com.cn
客户服务电话		95525	4008308003
传真		021-32068585	010-65169555
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层	广东省广州市越秀区东风东路 713 号
办公地址		中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层	北京市西城区菜市口大街 1 号院 2 号楼信托大厦
邮政编码		200127	100053
法定代表人		熊国兵	王凯

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
----------------	---------

登载基金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	上海光大证券资产管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层

§ 3 主要财务指标、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 3 月 25 日(基金合同生效日)-2020 年 12 月 31 日		
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C
本期已实现收益	66,535.21	439,706.37	16,292,014.09	1,383,727.22	17,419,595.83	-33,747,924.99
本期利润	-29,115.70	-469,303.60	-5,246,947.28	1,298,107.23	14,470,937.08	-8,107,947.64
加权平均基金份额本期利润	-0.0056	-0.0093	-0.0046	0.0517	0.0699	-0.0118
本期加权平均净值利润率	-0.52%	-0.88%	-0.43%	4.91%	6.73%	-1.12%
本期	-2.58%	-2.09%	-2.49%	5.26%	5.69%	5.40%

基金份额净值增长率						
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末			2020 年末		
期末可供分配利润	149,883.52	1,385,437.81	12,265,709.60	713,477.98	4,380,840.47	98,592,478.69
期末可供分配基金份额利润	0.0481	0.0348	0.0278	0.0759	0.0569	0.0540
期末基金资产净值	3,262,849.94	41,228,688.70	453,590,235.00	10,109,057.82	81,427,123.27	1,924,795,313.78
期末基金份额净值	1.0481	1.0348	1.0278	1.0759	1.0569	1.0540
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	2.54%	3.48%	2.78%	5.26%	5.69%	5.40%

注：1、表中的“期末”均指报告期最后一日，即 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（例如，集合计划的申购赎回费、集合计划转换费等），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，采用期末资产负债表中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）。

5、B 类份额设立日为 2020 年 3 月 25 日，C 类份额设立日为 2020 年 3 月 25 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

光大阳光对冲 6 个月持有混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.63%	0.22%	0.63%	0.01%	-2.26%	0.21%
过去六个月	-3.33%	0.30%	1.27%	0.01%	-4.60%	0.29%
过去一年	-2.58%	0.29%	2.53%	0.01%	-5.11%	0.28%
自基金合同生效起至今	2.54%	0.28%	4.53%	0.01%	-1.99%	0.27%

光大阳光对冲 6 个月持有混合 B

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.50%	0.22%	0.63%	0.01%	-2.13%	0.21%
过去六个月	-3.08%	0.30%	1.27%	0.01%	-4.35%	0.29%
过去一年	-2.09%	0.29%	2.54%	0.01%	-4.63%	0.28%

自基金合同生效起 至今	3.48%	0.28%	4.53%	0.01%	-1.05%	0.27%
----------------	-------	-------	-------	-------	--------	-------

光大阳光对冲 6 个月持有混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.61%	0.22%	0.63%	0.01%	-2.24%	0.21%
过去六个月	-3.28%	0.30%	1.27%	0.01%	-4.55%	0.29%
过去一年	-2.49%	0.29%	2.54%	0.01%	-5.03%	0.28%
自基金合同生效起 至今	2.78%	0.28%	4.53%	0.01%	-1.75%	0.27%

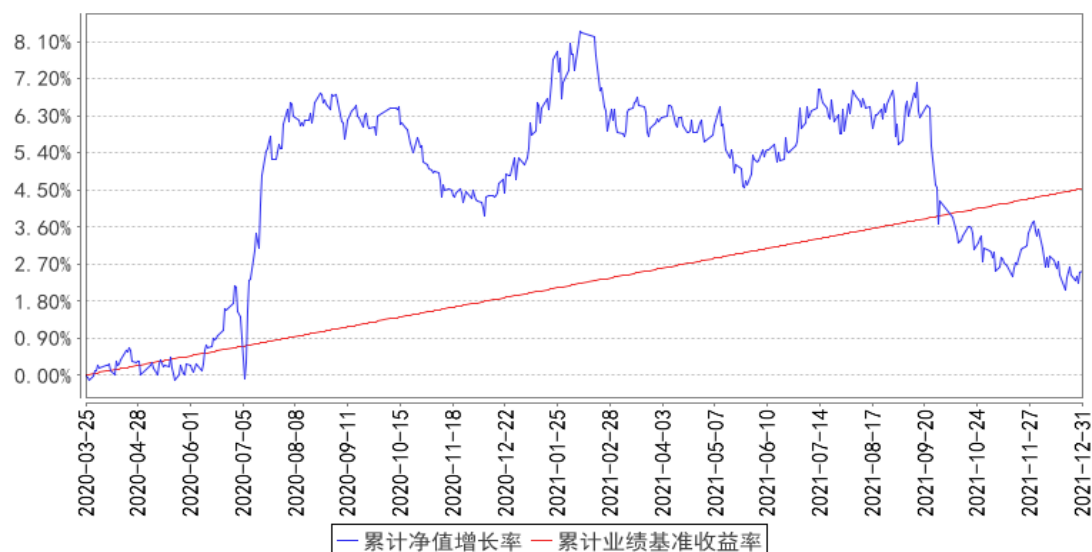
注：1、自基金合同生效日起至今指 2020 年 3 月 25 日-2021 年 12 月 31 日；

2、业绩比较基准为：中国人民银行公布的同期 1 年期银行定期存款基准利率（税后）+1%；

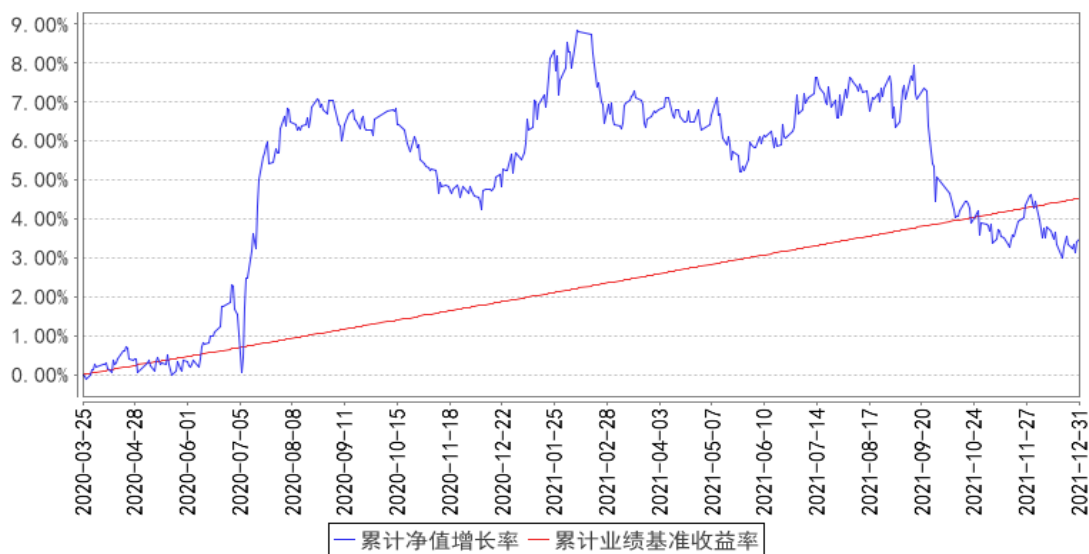
3、B 类份额设立日为 2020 年 3 月 25 日，C 类份额设立日为 2020 年 3 月 25 日。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

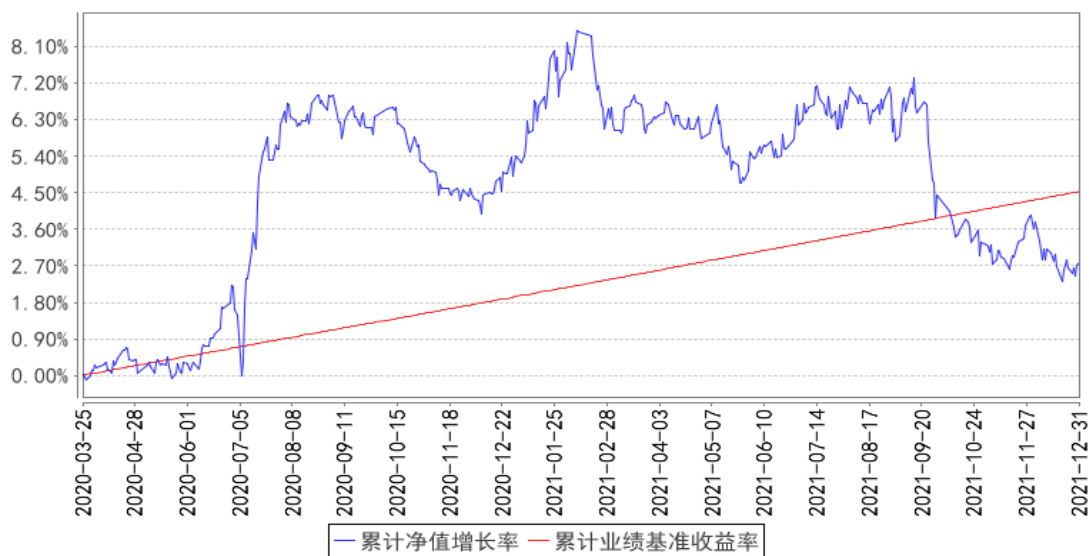
光大阳光对冲 6 个月持有混合 A 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

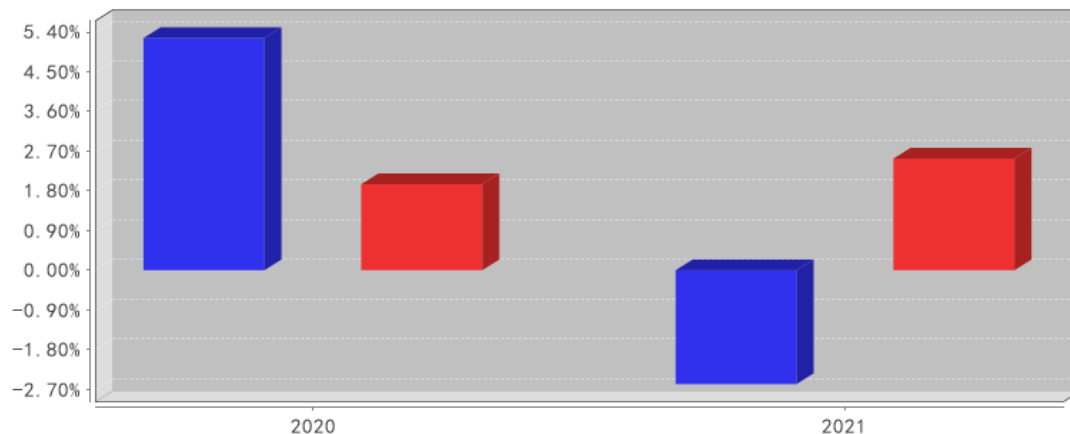


光大阳光对冲**6**个月持有混合**C**累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



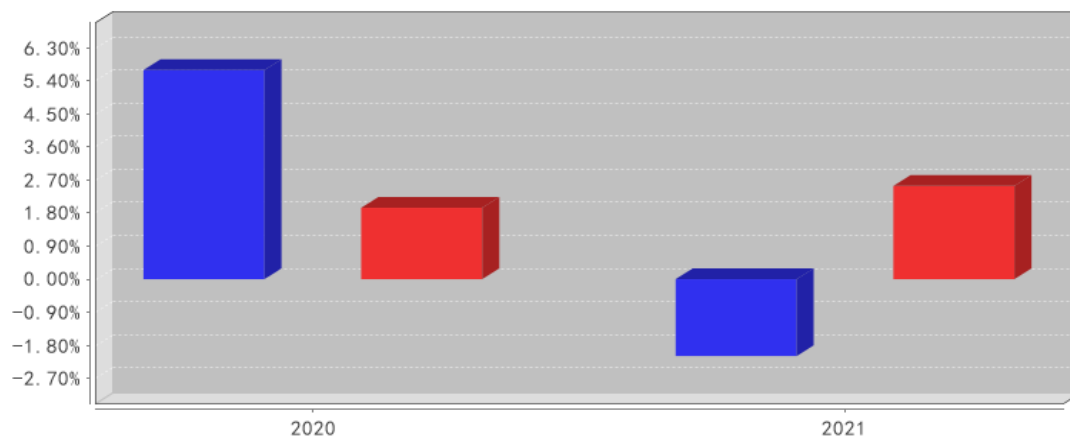
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

光大阳光对冲6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



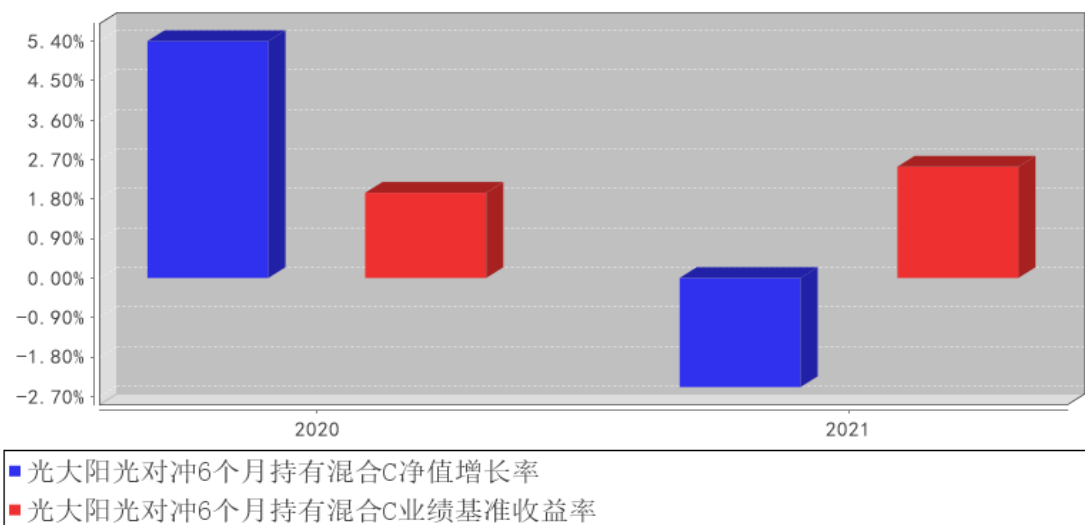
- 光大阳光对冲6个月持有混合A净值增长率
- 光大阳光对冲6个月持有混合A业绩基准收益率

光大阳光对冲6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



- 光大阳光对冲6个月持有混合B净值增长率
- 光大阳光对冲6个月持有混合B业绩基准收益率

光大阳光对冲6个月持有混合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



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	证券从	说明
----	----	-----------	-----	----

		(助理) 期限		业年限	
		任职日期	离任日期		
李 禄 俊	量化公募 投资部副 总经理、 本集计划 投资经理	2020 年 3 月 25 日	-	6 年	李禄俊先生，本硕均毕业于北京大学，曾在中金基金管理公司量化投资部任职，2018 年加入光证资管，现任量化公募投资部副总经理。
李 聚 华	投 资 总 监，原本 集计划 投资经理	2020 年 03 月 25 日	2021 年 07 月 19 日	16 年	李聚华先生，美国哥伦比亚大学统计学硕士，CFA。曾任美国对冲基金 Aristeia Capital 高级分析师，光大证券金融市场总部执行董事。现任光证资管总经理助理兼量化公募投资部总经理。

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；

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本集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

2021 年 A 股市场分化显著，整体围绕“风格切换”和“板块轮动”，赚钱效应下降。整体来看，大盘指数以震荡为主，结构化行情致使风格指数分化明显。全年上证指数与深证成指分别上涨 4.80% 和 2.67%，沪深 300 下跌 5.20%。以中小盘成长股为主的中证 500 和创业板指分别上涨 15.58% 和 12.02%，相反以大盘价值蓝筹股为主的上证 50 下跌 10.06%；在“碳中和”的背景下，宁组合大涨 40.95%，而 2020 年大火的茅指数下跌 4.4%；香港市场在互联网平台“反垄断”、教育培训行业“双减”、房地产违约以及医药、游戏等相关产业政策的持续冲击下呈现单边下降趋势，恒生指数、恒生中国企业指数、恒生科技分别下跌 14.08%、23.30%、32.70%。

权益市场虽然指数表现一般，但结构性机会不断涌现。30 个中信一级行业中，有 9 个行业指数 2021 年累计涨幅超过 20%，其中有 5 个行业指数累计涨幅超过 40%。

债券市场来看，10 年期国债收益率震荡下行，债市全年表现出小牛行情，但不同品种表现有所差异，利率债和高等级信用债相对表现较好，同时不同债券之间信用利差进一步分化。中低评级信用债继续面临信用风险和估值的压力，同时部分行业例如房地产在行业周期和监管压力的双重影响下，违约风险也较往年有所上升。

全年来看，疫情仍然是制约全球经济增长的重要扰动因素，海外经济体供应链恢复偏缓慢，在动态清零的策略下，国内居民消费可能继续维持偏弱修复。

本集合计划的投资逻辑是通过量化模型选择盈利优质的上市公司，同时结合估值因子、成长因子等选股模型甄选出胜率较高的个股组合，对冲股指期货以获得绝对收益，再根据风险模型控制个股、行业和风格的整体风险暴露。2021 上半年市场风格的大幅波动对于对冲策略而言是极大的挑战。选股策略始终坚持基本面优质的选股逻辑，但春节后市场整体的风险偏好发生了剧烈的收缩，从而超额收益产生了一定的回撤。随着对市场波动率和资金面的重新校准，策略重新调整了价值风格和成长风格的比例，保持防守型的策略配置方案，同时控制市值、行业的整体暴露，基本达到了市场风格中性的投资结果。春季后蓝筹股快速下跌时，主动降低了多头敞口和选股模

型的风险敞口。因子配置上以稳健的估值因子为主体，四月以后随着市场年报的披露进程，选股逐步切换到业绩增长的成长因子和个股业绩超预期因子。选股模型在五月换手充分后，六月策略运行平稳并获得了显著的超额收益。三季度仓位主要以对冲为主，辅以股债多头。三季度偏好低价反转的市场环境是对冲类产品最不利的情形，根据股票的盈利、景气度、ROE、基本面业绩增长为逻辑选择的个股无法跑赢指数，叠加基差的快速收敛，对净值造成了很大的回撤。从对冲的角度，在市场快速切换的情况下风险偏好的变化会对产品净值造成巨大的风险。为了降低不利的市场环境对产品净值的冲击，本产品采用多策略配置的总体思路，降低对冲以及基差的影响，尤其是控制低配某些行业而产生的做空风险；在衡量宏观环境后适时增加债券的配置比例，以优化收益风险比。四季度仓位从以对冲为主逐步过度到风险预算框架下的多策略投资组合。从 12 月以后，本产品逐步增加利率债、可转债的比例，以优化收益风险比。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 12 月 31 日，光大阳光对冲策略 6 个月持有混合 A 类份额净值为 1.0481 元，本报告期份额净值增长率为-2.58%；光大阳光对冲策略 6 个月持有混合 B 类份额净值为 1.0348 元，本报告期份额净值增长率为-2.09%。光大阳光对冲策略 6 个月持有混合 C 类份额净值为 1.0278 元，本报告期份额净值增长率为-2.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年，尽管 Omicron 变异毒株使得全球疫情存在扩散风险，但疫情对于全球经济的影响已经逐渐减弱。在内部动能拉动的增长已近极限的情况下，多数发达经济体经济增速步入稳态区间。而全球联动恢复的进程屡屡受阻，这将使得发达经济体与新兴市场的增长割裂时间有所延长。以美国为代表的发达经济体对于通胀问题的关注度有所上升，即便疫情真的发生新一轮扩散，货币收紧的步伐不会就此停止，2022 年美联储很可能将加息付诸实际。从中长期的视角来看，我国潜在经济增速中枢下移已是不争的事实，首先，如果 Omicron 变异毒株导致全球疫情再度扩散，加上国内防控策略不变，则消费仍可能存在持续低于预期的风险，但居民消费意愿并无永久性损失；其次，出口和消费在一定程度上存在着此消彼长的关系，全球疫情和中美贸易关系缓和或将巩固出口韧性；最后，从投资端来说，在“底线思维”的稳增长诉求下，对地产投资不宜过分悲观，而财政约束下基建投资难以大举发力，不过制造业投资有望在成本压力下行过程中得到改善。我国当前财政倾向于留力而非发力，而在企业成本上行压力难以很快消除的情况下，可以对货币宽松抱以更多期待。2022 年的 A 股市场，大概率是经济放缓+流动性宽松的组合，而估值的走向，则相对复杂。债市方面，外围风险应关注美债走势，而不是简单关注联储自身行为。预计美债维持横盘震荡，中债受影响有限，仍然是以我为主，内因为主。内因关键是理解政府如何作为。跨

周期与逆周期有机结合，以及财政政策和货币政策协调配合，意味着总体政策方向仍然是总量控制、宽而有度、结构优化、适度前置。

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，广发银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划（以下称“本集合计划”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、集合计划合同和托管协议的有关规定，不存在任何损害集合计划份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、集合计划合同和托管协议的规定，对本集合计划管理人的投资运作方面进行了必要的监督，对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以及集合计划费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本集合计划管理人存在损害份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 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_B07 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	光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划
审计意见	我们审计了光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型

	<p>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,后附的光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划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对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划 2021 年 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>
<p>形成审计意见的基础</p>	<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对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划,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>
<p>强调事项</p>	<p>无</p>
<p>其他事项</p>	<p>无</p>
<p>其他信息</p>	<p>光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划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>
<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对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划的持续经营能力,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对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>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对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划的持续经营能力,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对冲策略 6 个月持有期灵活配置混</p>

	合型集合资产管理计划的财务报告过程。	
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：光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划

报告截止日：2021 年 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	20,675,583.61	21,871,738.77
结算备付金		35,682,420.12	81,554,644.23
存出保证金		20,153,603.81	148,867,591.34
交易性金融资产	7.4.7.2	437,331,324.93	1,879,269,542.24
其中：股票投资		206,821,340.82	1,291,906,844.29
基金投资		-	-
债券投资		225,582,484.11	373,862,697.95
资产支持证券投资		4,927,500.00	213,500,000.00
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	20,000,000.00	-
应收证券清算款		5,816,187.82	5,716,507.62
应收利息	7.4.7.5	2,690,399.47	7,065,344.14
应收股利		-	-
应收申购款		21,920.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		542,371,439.76	2,144,345,368.34
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		-	1,556,905.78
应付赎回款		2,339,008.95	2,628,833.39
应付管理人报酬		442,982.11	1,708,328.30

应付托管费		88,318.73	340,514.48
应付销售服务费		161,396.67	646,069.76
应付交易费用	7.4.7.7	1,130,802.20	1,293,614.11
应交税费		317.46	22,407.65
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	40,126,840.00	119,817,200.00
负债合计		44,289,666.12	128,013,873.47
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	484,280,742.71	1,912,644,697.73
未分配利润	7.4.7.10	13,801,030.93	103,686,797.14
所有者权益合计		498,081,773.64	2,016,331,494.87
负债和所有者权益总计		542,371,439.76	2,144,345,368.34

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，本集合计划份额总额为 484,280,742.71 份，其中光大阳光对冲 6 个月持有混合 A 集合计划份额总额为 3,112,966.42 份，集合计划份额净值 1.0481 元；光大阳光对冲 6 个月持有混合 B 集合计划份额总额为 39,843,250.89 份，集合计划份额净值 1.0348 元；光大阳光对冲 6 个月持有混合 C 集合计划份额总额为 441,324,525.40 份，集合计划份额净值 1.0278 元。

7.2 利润表

会计主体：光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 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 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		37,356,837.74	31,736,475.48
1. 利息收入		14,970,533.81	8,609,254.81
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,909,629.34	554,216.81
债券利息收入		5,484,818.99	3,490,186.39
资产支持证券利息收入		5,774,111.25	3,031,823.66
买入返售金融资产收入		1,801,974.23	1,533,027.95
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		44,929,926.18	520,527.78
其中：股票投资收益	7.4.7.12	98,956,548.44	79,246,899.03

基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	5,899,655.80	-793,251.40
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13.5	2,521,777.70	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-74,116,177.56	-81,188,226.55
股利收益	7.4.7.16	11,668,121.80	3,255,106.70
3. 公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	7.4.7.17	-22,543,622.25	22,605,698.61
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	-	994.28
减：二、费用		43,102,204.32	24,075,378.81
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	12,839,057.07	7,499,009.48
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,562,195.60	1,479,299.33
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	4,886,987.19	2,202,960.32
4. 交易费用	7.4.7.19	20,826,843.45	11,372,822.46
5. 利息支出		-	121,156.35
其中：卖出回购金融资产支 出		-	121,156.35
6. 税金及附加		1,703,387.16	1,251,998.07
7. 其他费用	7.4.7.20	283,733.85	148,132.80
三、利润总额（亏损总额以 “-”号填列）		-5,745,366.58	7,661,096.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-5,745,366.58	7,661,096.67

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 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）	1,912,644,697.73	103,686,797.14	2,016,331,494.87
二、本期经营活 动产生的基金净 值变动数（本期 利润）	-	-5,745,366.58	-5,745,366.58
三、本期基金份	-1,428,363,955.02	-84,140,399.63	-1,512,504,354.65

额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	635,155,558.63	43,900,854.06	679,056,412.69
2. 基金赎回款	-2,063,519,513.65	-128,041,253.69	-2,191,560,767.34
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）	484,280,742.71	13,801,030.93	498,081,773.64
项目	上年度可比期间 2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年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）	38,874,579.27	861,058.70	39,735,637.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,661,096.67	7,661,096.67
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）	1,873,770,118.46	95,164,641.77	1,968,934,760.23
其中：1. 基金申购款	2,177,276,617.07	112,612,332.23	2,289,888,949.30
2. 基金赎回款	-303,506,498.61	-17,447,690.46	-320,954,189.07
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）	1,912,644,697.73	103,686,797.14	2,016,331,494.87

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

光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划是由光大阳光稳健添利集合资产管理计划转型而来。本集合计划管理人上海光大证券资产管理有限公司于 2020 年 3 月 17 日发布《光大阳光稳健添利集合资产管理计划合同变更公告》。根据公告，光大阳光稳健添利集合资产管理计划名称变更为“光大阳光对冲 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划”，光大阳光稳健添利集合资产管理计划份额转换为光大阳光对冲 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划 A 类份额。合同变更后，本集合计划的托管人，登记机构不变。自 2020 年 3 月 25 日起《光大阳光对冲 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》、《光大阳光对冲 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划托管协议》生效。本集合计划自资产管理合同变更生效之日起存续期不得超过 3 年。本集合计划管理人为上海光大证券资产管理有限公司，托管人为广发银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《光大阳光对冲 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》，本集合计划的投资范围为：具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或同意注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券（含超短期融资券）、公司债、中期票据、可交换债券、可转换债券（含可分离可转换债券））、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、股指期货以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本集合计划可以参与融券业务。如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本集合计划的投资组合比例为：股票资产占集合计划资产的比例为 0%-95%；投资银行存款和同业存单合计占比不超过集合计划资产的 20%；本集合计划权益类多头头寸价值减去权益类空头头寸价值，占集合计划资产净值比例范围 0-10%。其中，权益类多头头寸价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合正风险敞口暴露价值及其他权益类工具多头价值的合计值。权益类空头头寸价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合负风险敞口暴露价值及其他权益类工具空头价值的合计值；每个交易日日终，持有的买入股指期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过集合计划资产净值的 95%。其中，

有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于集合计划资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本集合计划投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。本集合计划的业绩比较基准为：中国人民银行公布的同期 1 年期银行定期存款基准利率（税后）+1%。

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》、《光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》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、资产支持证券投资和衍生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

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，由红利再投资而来的 B 类或 C 类份额不受锁定持有期的限制，再投资份额的持有期与原份额相同；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	上年度末
	2021年12月31日	2020年12月31日
活期存款	20,675,583.61	21,871,738.77
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	20,675,583.61	21,871,738.77

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	207,624,474.70	206,821,340.82	-803,133.88
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	43,921,484.11	672,126.35
	银行间市场	180,380,890.00	1,280,110.00
	合计	223,630,247.76	225,582,484.11
资产支持证券	4,927,500.00	4,927,500.00	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	436,182,222.46	437,331,324.93	1,149,102.47
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	1,231,531,055.82	1,291,906,844.29	60,375,788.47
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	124,749,697.95	242,493.81
	银行间市场	248,516,800.00	596,200.00
	合计	373,024,004.14	373,862,697.95
资产支持证券	213,500,000.00	213,500,000.00	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,818,055,059.96	1,879,269,542.24	61,214,482.28

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-160,946,784.11	-	-	-
其中：股指期货投资	-160,946,784.11	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-160,946,784.11	-	-	-
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-1,127,618,486.55	-	-	-
其中：股指期货投资	-1,127,618,486.55	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-1,127,618,486.55	-	-	-

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则（试行）》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“权益衍生工具-股指期货投资”与“证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵消的条件，故将“权益衍生工具-股指期货投资”的期末公允价值以抵消后的净额列报，净额为零。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	20,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	20,000,000.00	-
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

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	4,908.32	4,216.28
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	2,098.60	10,998.50
应收债券利息	2,673,691.35	4,182,089.92
应收资产支持证券利息	9,396.00	2,874,271.24
应收买入返售证券利息	-	-6,813.70
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	305.20	581.90
合计	2,690,399.47	7,065,344.14

7.4.7.6 其他资产

本集合计划本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	1,129,102.20	1,292,039.11
银行间市场应付交易费用	1,700.00	1,575.00
合计	1,130,802.20	1,293,614.11

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	153,000.00	135,000.00
其他	39,973,840.00	119,682,200.00
合计	40,126,840.00	119,817,200.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

光大阳光对冲 6 个月持有混合 A

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,395,579.84	9,395,579.84
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-6,282,613.42	-6,282,613.42
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	3,112,966.42	3,112,966.42

光大阳光对冲 6 个月持有混合 B

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	77,046,282.80	77,046,282.80
本期申购	1,722,870.68	1,722,870.68
本期赎回（以“-”号填列）	-38,925,902.59	-38,925,902.59
-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	39,843,250.89	39,843,250.89

光大阳光对冲 6 个月持有混合 C

项目	本期
----	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	1,826,202,835.09	1,826,202,835.09
本期申购	633,432,687.95	633,432,687.95
本期赎回 (以“-”号填列)	-2,018,310,997.64	-2,018,310,997.64
-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	441,324,525.40	441,324,525.40

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

光大阳光对冲 6 个月持有混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,707,398.57	-993,920.59	713,477.98
本期利润	66,535.21	-95,650.91	-29,115.70
本期基金份额交易产生的变动数	-1,309,146.54	774,667.78	-534,478.76
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-1,309,146.54	774,667.78	-534,478.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	464,787.24	-314,903.72	149,883.52

光大阳光对冲 6 个月持有混合 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,458,258.34	-77,417.87	4,380,840.47
本期利润	439,706.37	-909,009.97	-469,303.60
本期基金份额交易产生的变动数	-2,576,988.50	50,889.44	-2,526,099.06
其中：基金申购款	118,344.13	4,768.57	123,112.70
基金赎回款	-2,695,332.63	46,120.87	-2,649,211.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,320,976.21	-935,538.40	1,385,437.81

光大阳光对冲 6 个月持有混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	100,564,972.35	-1,972,493.66	98,592,478.69
本期利润	16,292,014.09	-21,538,961.37	-5,246,947.28
本期基金份额交易产生的变动数	-94,520,105.33	13,440,283.52	-81,079,821.81
其中：基金申购款	43,743,116.40	34,624.96	43,777,741.36
基金赎回款	-138,263,221.73	13,405,658.56	-124,857,563.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,336,881.11	-10,071,171.51	12,265,709.60

7.4.7.11 存款利息收入

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3月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日
活期存款利息收入	455,933.78	401,392.61
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	1,429,931.00	146,968.21
其他	23,764.56	5,855.99
合计	1,909,629.34	554,216.81

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	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年3月25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	98,956,548.44	79,246,899.03
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	98,956,548.44	79,246,899.03

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3月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出股票成交总额	8,115,431,916.35	3,851,242,308.75
减：卖出股票成本总额	8,016,475,367.91	3,771,995,409.72
买卖股票差价收入	98,956,548.44	79,246,899.03

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

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3月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	5,899,655.80	-793,251.40
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	5,899,655.80	-793,251.40

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	637,616,744.36	374,076,028.91

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	624,409,135.46	370,068,023.03
减：应收利息总额	7,307,953.10	4,801,257.28
买卖债券差价收入	5,899,655.80	-793,251.40

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

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3月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	219,092,666.48	-
减：卖出资产支持证券成本总额	208,572,500.00	-
减：应收利息总额	7,998,388.78	-
资产支持证券投资收益	2,521,777.70	-

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

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 收益金额 2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日
股指期货投资收益	-74,116,177.56	-81,188,226.55

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年3月25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	11,668,121.80	3,255,106.70
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	11,668,121.80	3,255,106.70

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-60,065,379.81	62,702,872.06
股票投资	-61,178,922.35	61,807,119.81
债券投资	1,113,542.54	895,752.25
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	37,521,757.56	-40,097,173.45

权证投资	-	-
期货投资	37,521,757.56	-40,097,173.45
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	-22,543,622.25	22,605,698.61

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3月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日
基金赎回费收入	-	750.48
其他收入	-	243.80
合计	-	994.28

注：本集合计划本报告期无其他收入。

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3月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日
交易所市场交易费用	20,823,368.45	11,364,466.46
银行间市场交易费用	3,475.00	5,025.00
其他交易费用	-	3,331.00
合计	20,826,843.45	11,372,822.46

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3月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日
审计费用	18,000.00	11,557.68
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	1,960.00	675.12
账户维护费	69,075.34	15,900.00
其他	74,698.51	-
合计	283,733.85	148,132.80

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
广发银行股份有限公司	集合计划托管人、集合计划代销机构
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	集合计划销售机构、集合计划管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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3月25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	15,092,109,845.62	100.00	8,852,117,244.00	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1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年3月25日（基金合同生效日）至 2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 （%）	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 （%）
光大证券	739,342,200.64	100.00	1,325,043,920.00	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1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年3月25日(基金合同生效日)至 2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
光大证券	19,395,000,000.00	100.00	34,692,000,000.00	100.00

7.4.10.1.4 权证交易

本集合计划本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

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	11,047,938.77	100.00	1,129,102.20	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2020年3月25日(基金合同生效日)至2020年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	6,447,920.78	100.00	1,292,039.11	100.00

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和手续费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本集合计划提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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3月25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	12,839,057.07	7,499,009.48
其中：支付销售机构的客户维护费	6,339,236.95	3,670,136.15

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

A 类份额管理费的计算方法如下： $H=E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的集合计划 A 类份额管理费

E 为前一日的集合计划 A 类份额的资产净值，A 类份额管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

H 为每日应计提的集合计划 B 类份额管理费

E 为前一日的集合计划 B 类份额的资产净值，B 类份额管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

H 为每日应计提的集合计划 C 类份额管理费

E 为前一日的集合计划 C 类份额的资产净值，C 类份额管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

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 3 月 25 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	2,562,195.60	1,479,299.33

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

$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值集合计划托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C	合计
光大证券	-	-	40,598.84	40,598.84
光证资管	-	-	203.57	203.57
合计	-	-	40,802.41	40,802.41
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C	合计
上海光大证券资产管理有限公司	-	-	810.27	810.27
光大证券股份有限公司	-	-	197,313.75	197,313.75
合计	-	-	198,124.02	198,124.02

注：1、销售服务费仅对 C 类份额收取。

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

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

H 为每日应计提的集合计划销售服务费

E 为前一日的集合计划 C 类份额的资产净值。销售服务费逐日累计至每月月末，按月支付给各销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

本集合计划本期未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

本集合计划本期未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

本集合计划本期未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限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

本报告期管理人未持有本集合计划份额。

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3月25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
广发银行股份有限公司	20,675,583.61	455,933.78	21,871,738.77	401,392.61

注：本集合计划的银行存款由基金托管人广发银行股份有限公司保管，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

本集合计划支付给光大期货的股指期货交易手续费参考市场价格经本集合的管理人与对方协商确定，以包括中国金融期货交易所收取的上交手续费的全额列示。于2021年12月31日，本集合无应付交易手续费余额。于2021年1月1日-2021年12月31日期间，本集合期间交易手续费支出258,072.65元。

本集合计划用于期货交易结算的资金分别存放于光大期货的结算账户和保证金账户中，结算备付金按银行同业利率计息，由光大期货进行结息处理，存出保证金不计息。于2021年12月31日，本集合的结算备付金余额为31,018,890.01元，存出保证金余额为19,475,380.80元。

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	期末成本总额	期末估值总额	备注

							位：股)			
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 02月 03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 02月 11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 03月 15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 02月 11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	2021年	2022年	新股流	4.97	12.51	214	1,063.58	2,677.14	-

	股份	7月15日	1月24日	通受限						
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	441	9,719.64	24,819.48	-
301036	双乐股份	2021年7月21日	2022年01月28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01月31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	1,373	9,556.08	17,176.23	-
301041	金百泽	2021年8月2日	2022年02月10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02月16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02月17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02月23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02月23日	新股流通受限	60.64	234.74	145	8,792.80	34,037.30	-
301052	果麦文化	2021年8月23日	2022年02月28日	新股流通受限	8.11	33.64	128	1,038.08	4,305.92	-
301053	远信工业	2021年8月25日	2022年02月28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03月08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08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14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29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13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18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19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20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27日	新股流 通受限	33.16	24.67	380	12,600.80	9,374.60	-
301089	拓新药业	2021年 10月20日	2022年 04月25日	新股流 通受限	19.11	67.93	97	1,853.67	6,589.21	-
301090	华润材料	2021年 10月19日	2022年 04月25日	新股流 通受限	10.45	11.22	1,353	14,138.85	15,180.66	-
301091	深城交	2021年 10月20日	2022年 03月28日	新股流 通受限	36.50	31.31	294	10,731.00	9,205.14	-
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	178	6,463.18	6,322.56	-
301093	华兰股份	2021年 10月21日	2022年 05月	新股流 通受限	58.08	49.85	209	12,138.72	10,418.65	-

		日	05日								
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	159	12,656.40	12,486.27		-
301098	金埔园林	2021年 11月4日	2022年 05月11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16日	新股流 通受限	27.81	31.14	304	8,454.24	9,466.56		-
301101	明月镜片	2021年 12月9日	2022年 06月15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02日	新股流 通受限	57.27	53.71	161	9,220.47	8,647.31		-
301111	粤万年青	2021年 11月30日	2022年 06月06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 07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06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29日	新股流 通受限	12.03	17.12	851	10,237.53	14,569.12		-
301133	金钟股份	2021年 11月19日	2022年 05月25日	新股流 通受限	14.33	26.95	147	2,106.51	3,961.65		-
301138	华研精机	2021年 12月8日	2022年 06月14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23日	新股流 通受限	60.66	96.75	446	27,054.36	43,150.50		-
301168	通灵股份	2021年 12月2日	2022年 06月09日	新股流 通受限	39.08	52.13	180	7,034.40	9,383.40		-
301177	迪阿	2021年	2022年	新股流	116.88	116.08	158	18,467.04	18,340.64		-

	股份	12月8日	06月14日	通受限						
301179	泽宇智能	2021年12月1日	2022年06月07日	新股流通受限	43.99	50.77	189	8,314.11	9,595.53	-
301182	凯旺科技	2021年12月16日	2022年06月22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18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10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27日	新股流通受限	66.18	56.62	188	12,441.84	10,644.56	-
301190	善水科技	2021年12月17日	2022年06月23日	新股流通受限	27.85	27.46	343	9,552.55	9,418.78	-
301193	家联科技	2021年12月2日	2022年06月08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01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06日	新股流通受限	29.28	32.00	195	5,709.60	6,240.00	-
301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年06月21日	新股流通受限	69.89	88.72	159	11,112.51	14,106.48	-
301136	招标股份	2021年12月31日	2022年7月10日	新股流通受限	10.52	10.52	2,637	27,741.24	27,741.24	-
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	3,720	156,165.60	156,165.60	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	-------	------	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

							位：张)			
113052	兴业转债	2021年 12月27 日	2022年 1月14 日	新债未 上市	200.00	100.00	5,420	542,000.00	542,000.00	-
113052	兴业转债	2021年 12月29 日	2022年 1月14 日	新债未 上市	200.00	100.00	4,220	422,000.00	422,000.00	-

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参与银行间市场债券正回购。

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参与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参与转融通证券出借业务。

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广发银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本集合计划在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本集合计划的管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

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	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	30,030,000.00	213,876,616.70
合计	30,030,000.00	213,876,616.70

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。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	19,980,892.50	3,951,976.60
AAA以下	23,940,591.61	6,769,104.65
未评级	151,631,000.00	149,265,000.00
合计	195,552,484.11	159,986,081.25

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。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	4,927,500.00	213,500,000.00
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	4,927,500.00	213,500,000.00

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。

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	20,675,583.61	-	-	-	20,675,583.61
结算备付金	35,682,420.12	-	-	-	35,682,420.12
存出保证金	20,153,603.81	-	-	-	20,153,603.81
交易性金融资产	34,957,500.00	124,626,114.18	70,926,369.93	206,821,340.82	437,331,324.93
买入返售金融资产	20,000,000.00	-	-	-	20,000,000.00
应收利息	-	-	-	2,690,399.47	2,690,399.47
应收申购款	-	-	-	21,920.00	21,920.00
应收证券清算款	-	-	-	5,816,187.82	5,816,187.82
资产总计	131,469,107.54	124,626,114.18	70,926,369.93	215,349,848.11	542,371,439.76

负债					
应付赎回款	-	-	-	2,339,008.95	2,339,008.95
应付管理人报酬	-	-	-	442,982.11	442,982.11
应付托管费	-	-	-	88,318.73	88,318.73
应付销售服务费	-	-	-	161,396.67	161,396.67
应付交易费用	-	-	-	1,130,802.20	1,130,802.20
应交税费	-	-	-	317.46	317.46
其他负债	-	-	-	40,126,840.00	40,126,840.00
负债总计	-	-	-	44,289,666.12	44,289,666.12
利率敏感度缺口	131,469,107.54	124,626,114.18	70,926,369.93	171,060,181.99	498,081,773.64
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	21,871,738.77	-	-	-	21,871,738.77
结算备付金	81,554,644.23	-	-	-	81,554,644.23
存出保证金	148,867,591.34	-	-	-	148,867,591.34
交易性金融资产	224,597,697.95	362,765,000.00	-	-1,291,906,844.29	1,879,269,542.24
应收利息	-	-	-	7,065,344.14	7,065,344.14
应收证券清算款	-	-	-	5,716,507.62	5,716,507.62
资产总计	476,891,672.29	362,765,000.00	-	-1,304,688,696.05	2,144,345,368.34
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,628,833.39	2,628,833.39
应付管理人报酬	-	-	-	1,708,328.30	1,708,328.30
应付托管费	-	-	-	340,514.48	340,514.48
应付证券清算款	-	-	-	1,556,905.78	1,556,905.78
应付销售服务费	-	-	-	646,069.76	646,069.76
应付交易费用	-	-	-	1,293,614.11	1,293,614.11
应交税费	-	-	-	22,407.65	22,407.65
其他负债	-	-	-	119,817,200.00	119,817,200.00
负债总计	-	-	-	128,013,873.47	128,013,873.47
利率敏感度缺口	476,891,672.29	362,765,000.00	-	-1,176,674,822.58	2,016,331,494.87

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）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-1,490,755.71	-1,084,386.80
	市场利率下降 25 个基点	1,490,755.71	1,084,386.80

	基点		
--	----	--	--

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。本集合计划的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

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	206,821,340.82	41.52	1,291,906,844.29	64.07
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	206,821,340.82	41.52	1,291,906,844.29	64.07

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%	9,800,999.17	67,984,884.83
	沪深 300 指数下降 5%	-9,800,999.17	-67,984,884.83

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 248,828,181.83 元，属于第二层次的余额为 188,503,143.1 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	206,821,340.82	38.13
	其中：股票	206,821,340.82	38.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	230,509,984.11	42.50
	其中：债券	225,582,484.11	41.59
	资产支持证券	4,927,500.00	0.91
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	20,000,000.00	3.69
	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	56,358,003.73	10.39
8	其他各项资产	28,682,111.10	5.29
9	合计	542,371,439.76	100.00

注：本集合计划本报告期末持有港股通交易机制投资的港股。

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	377,642.00	0.08
B	采矿业	10,617,518.30	2.13
C	制造业	121,862,635.28	24.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,255,114.00	0.65
E	建筑业	1,320,244.81	0.27
F	批发和零售业	1,928,783.40	0.39
G	交通运输、仓储和邮政业	2,259,410.90	0.45
H	住宿和餐饮业	2,304.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,920,676.37	1.79
J	金融业	44,818,192.41	9.00

K	房地产业	3,645,602.00	0.73
L	租赁和商务服务业	2,266,373.81	0.46
M	科学研究和技术服务业	3,156,569.35	0.63
N	水利、环境和公共设施管理业	407,907.81	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,829,939.70	0.37
R	文化、体育和娱乐业	152,426.68	0.03
S	综合	-	-
	合计	206,821,340.82	41.52

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本集合计划本期末未持有港股通投资股票投资组合。

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	600519	贵州茅台	7,619	15,618,950.00	3.14
2	600036	招商银行	163,209	7,949,910.39	1.60
3	300750	宁德时代	9,216	5,419,008.00	1.09
4	601398	工商银行	1,149,700	5,323,111.00	1.07
5	601318	中国平安	101,226	5,102,802.66	1.02
6	600030	中信证券	137,800	3,639,298.00	0.73
7	601012	隆基股份	38,578	3,325,423.60	0.67
8	601166	兴业银行	166,357	3,167,437.28	0.64
9	600887	伊利股份	68,400	2,835,864.00	0.57
10	300059	东方财富	73,591	2,730,962.01	0.55
11	603259	药明康德	22,040	2,613,503.20	0.52
12	601899	紫金矿业	266,229	2,582,421.30	0.52
13	600809	山西汾酒	7,889	2,491,188.42	0.50
14	600309	万华化学	22,476	2,270,076.00	0.46
15	000001	平安银行	135,197	2,228,046.56	0.45
16	600438	通威股份	46,406	2,086,413.76	0.42
17	000858	五粮液	8,800	1,959,408.00	0.39
18	600900	长江电力	83,700	1,899,990.00	0.38
19	603501	韦尔股份	6,104	1,896,940.08	0.38
20	600048	保利发展	121,000	1,891,230.00	0.38
21	300124	汇川技术	26,752	1,835,187.20	0.37
22	603986	兆易创新	10,300	1,811,255.00	0.36
23	600276	恒瑞医药	33,300	1,688,643.00	0.34
24	600570	恒生电子	26,300	1,634,545.00	0.33

25	601888	中国中免	7,441	1,632,629.81	0.33
26	601225	陕西煤业	133,400	1,627,480.00	0.33
27	600436	片仔癀	3,300	1,442,595.00	0.29
28	688981	中芯国际	26,691	1,414,356.09	0.28
29	002223	鱼跃医疗	36,900	1,394,820.00	0.28
30	601288	农业银行	470,900	1,384,446.00	0.28
31	002594	比亚迪	5,100	1,367,412.00	0.27
32	600745	闻泰科技	10,300	1,331,790.00	0.27
33	002648	卫星化学	32,900	1,316,987.00	0.26
34	300450	先导智能	17,600	1,308,912.00	0.26
35	601615	明阳智能	49,200	1,284,120.00	0.26
36	600690	海尔智家	41,700	1,246,413.00	0.25
37	000568	泸州老窖	4,900	1,243,963.00	0.25
38	603882	金城医学	11,100	1,236,207.00	0.25
39	002049	紫光国微	5,400	1,215,000.00	0.24
40	300122	智飞生物	9,700	1,208,620.00	0.24
41	002129	中环股份	28,600	1,194,050.00	0.24
42	601988	中国银行	386,800	1,179,740.00	0.24
43	600176	中国巨石	62,789	1,142,759.80	0.23
44	601601	中国太保	41,800	1,133,616.00	0.23
45	600585	海螺水泥	27,900	1,124,370.00	0.23
46	000063	中兴通讯	33,241	1,113,573.50	0.22
47	600000	浦发银行	128,077	1,092,496.81	0.22
48	600188	兖矿能源	46,300	1,089,439.00	0.22
49	688099	晶晨股份	8,161	1,062,562.20	0.21
50	000333	美的集团	14,200	1,048,102.00	0.21
51	600031	三一重工	45,300	1,032,840.00	0.21
52	688085	三友医疗	33,004	1,018,833.48	0.20
53	601658	邮储银行	198,511	1,012,406.10	0.20
54	002539	云图控股	75,900	1,007,193.00	0.20
55	002821	凯莱英	2,300	1,000,500.00	0.20
56	002064	华峰化学	95,600	998,064.00	0.20
57	688111	金山办公	3,749	993,485.00	0.20
58	002906	华阳集团	18,000	989,280.00	0.20
59	603288	海天味业	9,400	988,034.00	0.20
60	603599	广信股份	24,800	967,200.00	0.19
61	000657	中钨高新	60,100	966,408.00	0.19
62	002850	科达利	6,000	962,040.00	0.19
63	002142	宁波银行	24,720	946,281.60	0.19
64	300014	亿纬锂能	7,700	909,986.00	0.18
65	603392	万泰生物	4,100	908,150.00	0.18
66	603486	科沃斯	6,000	905,700.00	0.18

67	600233	圆通速递	53,500	892,380.00	0.18
68	000002	万科A	44,500	879,320.00	0.18
69	601919	中远海控	47,010	878,616.90	0.18
70	600837	海通证券	71,400	875,364.00	0.18
71	601328	交通银行	187,500	864,375.00	0.17
72	601666	平煤股份	97,600	816,912.00	0.16
73	600584	长电科技	26,075	808,846.50	0.16
74	601699	潞安环能	71,200	805,272.00	0.16
75	002254	泰和新材	40,900	802,049.00	0.16
76	688005	容百科技	6,936	801,662.88	0.16
77	601668	中国建筑	154,100	770,500.00	0.15
78	600586	金晶科技	79,700	738,022.00	0.15
79	601963	重庆银行	82,400	733,360.00	0.15
80	000776	广发证券	28,900	710,651.00	0.14
81	600104	上汽集团	34,300	707,609.00	0.14
82	601688	华泰证券	39,500	701,520.00	0.14
83	600884	杉杉股份	21,300	698,001.00	0.14
84	600487	亨通光电	45,600	689,472.00	0.14
85	002156	通富微电	35,234	684,596.62	0.14
86	600958	东方证券	46,400	683,936.00	0.14
87	002460	赣锋锂业	4,600	657,110.00	0.13
88	601211	国泰君安	34,600	618,994.00	0.12
89	300760	迈瑞医疗	1,600	609,280.00	0.12
90	601233	桐昆股份	28,700	607,866.00	0.12
91	300911	亿田智能	7,300	598,016.00	0.12
92	300327	中颖电子	8,600	583,940.00	0.12
93	688357	建龙微纳	3,018	579,274.92	0.12
94	603799	华友钴业	5,200	573,612.00	0.12
95	600893	航发动力	8,400	533,064.00	0.11
96	601088	中国神华	23,500	529,220.00	0.11
97	600050	中国联通	132,200	519,546.00	0.10
98	600406	国电南瑞	12,900	516,387.00	0.10
99	300593	新雷能	9,400	511,172.00	0.10
100	601985	中国核电	59,900	497,170.00	0.10
101	002304	洋河股份	3,000	494,190.00	0.10
102	301071	力量钻石	1,700	487,390.00	0.10
103	002727	一心堂	12,200	469,822.00	0.09
104	300316	晶盛机电	6,700	465,650.00	0.09
105	600588	用友网络	12,800	459,264.00	0.09
106	601633	长城汽车	9,400	456,276.00	0.09
107	600028	中国石化	107,300	453,879.00	0.09
108	603612	索通发展	21,900	449,388.00	0.09

109	600803	新奥股份	23,600	433,296.00	0.09
110	600779	水井坊	3,600	431,964.00	0.09
111	600141	兴发集团	11,400	431,832.00	0.09
112	300015	爱尔眼科	10,167	429,860.76	0.09
113	600256	广汇能源	65,700	429,678.00	0.09
114	000983	山西焦煤	51,900	429,213.00	0.09
115	688598	金博股份	1,198	425,337.92	0.09
116	688066	航天宏图	5,850	425,295.00	0.09
117	002410	广联达	6,600	422,268.00	0.08
118	601728	中国电信	95,111	408,283.97	0.08
119	601857	中国石油	82,200	403,602.00	0.08
120	601939	建设银行	68,600	401,996.00	0.08
121	002013	中航机电	21,700	394,506.00	0.08
122	000988	华工科技	14,100	392,826.00	0.08
123	000062	深圳华强	22,700	391,121.00	0.08
124	000930	中粮科技	35,900	390,233.00	0.08
125	002709	天赐材料	3,400	389,810.00	0.08
126	002028	思源电气	7,900	388,759.00	0.08
127	600885	宏发股份	5,200	388,128.00	0.08
128	605266	健之佳	5,060	387,444.20	0.08
129	600016	民生银行	99,200	386,880.00	0.08
130	000519	中兵红箭	14,500	386,715.00	0.08
131	600348	华阳股份	32,400	383,940.00	0.08
132	600183	生益科技	16,295	383,747.25	0.08
133	002266	浙富控股	53,800	383,056.00	0.08
134	688396	华润微	5,926	382,819.60	0.08
135	002003	伟星股份	29,700	380,754.00	0.08
136	000039	中集集团	21,991	377,365.56	0.08
137	000933	神火股份	41,500	377,235.00	0.08
138	601138	工业富联	31,400	374,288.00	0.08
139	605111	新洁能	2,100	374,010.00	0.08
140	600765	中航重机	7,400	373,626.00	0.08
141	002416	爱施德	32,800	373,264.00	0.07
142	600064	南京高科	39,900	372,666.00	0.07
143	603156	养元饮品	13,100	372,171.00	0.07
144	300296	利亚德	36,200	371,050.00	0.07
145	002202	金风科技	22,500	370,575.00	0.07
146	603369	今世缘	6,800	369,920.00	0.07
147	603589	口子窖	5,200	368,524.00	0.07
148	600196	复星医药	7,500	367,050.00	0.07
149	600038	中直股份	4,500	361,350.00	0.07
150	600600	青岛啤酒	3,600	356,400.00	0.07

151	000630	铜陵有色	102,200	355,656.00	0.07
152	603077	和邦生物	103,700	353,617.00	0.07
153	002010	传化智联	40,500	352,350.00	0.07
154	000725	京东方 A	68,300	344,915.00	0.07
155	000937	冀中能源	62,400	343,824.00	0.07
156	300037	新宙邦	3,000	339,000.00	0.07
157	300308	中际旭创	7,900	335,750.00	0.07
158	300196	长海股份	19,100	334,823.00	0.07
159	002008	大族激光	6,200	334,800.00	0.07
160	688600	皖仪科技	15,429	330,180.60	0.07
161	688368	晶丰明源	1,021	326,822.10	0.07
162	002812	恩捷股份	1,300	325,520.00	0.07
163	688200	华峰测控	614	314,306.60	0.06
164	688589	力合微	4,328	313,650.16	0.06
165	300752	隆利科技	9,000	312,750.00	0.06
166	688356	键凯科技	918	309,485.34	0.06
167	001979	招商蛇口	22,700	302,818.00	0.06
168	603613	国联股份	2,800	301,000.00	0.06
169	688059	华锐精密	1,895	300,736.50	0.06
170	688188	柏楚电子	779	300,273.34	0.06
171	601168	西部矿业	21,800	296,698.00	0.06
172	603733	仙鹤股份	7,200	293,832.00	0.06
173	300567	精测电子	4,000	289,720.00	0.06
174	000538	云南白药	2,700	282,555.00	0.06
175	601066	中信建投	9,500	277,875.00	0.06
176	002597	金禾实业	5,400	277,290.00	0.06
177	002384	东山精密	10,200	276,420.00	0.06
178	002475	立讯精密	5,600	275,520.00	0.06
179	605183	确成股份	13,900	273,135.00	0.05
180	300595	欧普康视	4,700	269,639.00	0.05
181	300358	楚天科技	10,300	268,521.00	0.05
182	300307	慈星股份	34,100	268,367.00	0.05
183	600426	华鲁恒升	8,400	262,920.00	0.05
184	300568	星源材质	7,000	257,110.00	0.05
185	601336	新华保险	6,500	252,720.00	0.05
186	603236	移远通信	1,200	244,680.00	0.05
187	300984	金沃股份	3,900	240,435.00	0.05
188	000887	中鼎股份	10,900	237,729.00	0.05
189	300073	当升科技	2,700	234,549.00	0.05
190	603283	赛腾股份	7,700	226,380.00	0.05
191	601229	上海银行	31,100	221,743.00	0.04
192	601636	旗滨集团	12,939	221,256.90	0.04

193	002340	格林美	21,200	219,420.00	0.04
194	000651	格力电器	5,900	218,477.00	0.04
195	600547	山东黄金	11,500	216,430.00	0.04
196	002050	三花智控	8,500	215,050.00	0.04
197	002415	海康威视	4,100	214,512.00	0.04
198	002068	黑猫股份	19,700	206,850.00	0.04
199	300451	创业慧康	18,500	206,830.00	0.04
200	300546	雄帝科技	11,500	205,160.00	0.04
201	300274	阳光电源	1,400	204,120.00	0.04
202	688388	嘉元科技	1,621	203,516.55	0.04
203	601186	中国铁建	25,800	201,240.00	0.04
204	002185	华天科技	15,800	200,818.00	0.04
205	300617	安靠智电	2,800	200,788.00	0.04
206	688022	瀚川智能	3,063	199,340.04	0.04
207	300347	泰格医药	1,528	195,278.40	0.04
208	002352	顺丰控股	2,800	192,976.00	0.04
209	600456	宝钛股份	2,600	186,628.00	0.04
210	601319	中国人保	39,100	183,770.00	0.04
211	000977	浪潮信息	5,000	179,150.00	0.04
212	600057	厦门象屿	20,700	175,743.00	0.04
213	688561	奇安信	1,993	175,224.56	0.04
214	688056	莱伯泰科	2,700	173,826.00	0.03
215	600383	金地集团	13,200	171,204.00	0.03
216	300115	长盈精密	8,600	170,624.00	0.03
217	002971	和远气体	7,200	169,488.00	0.03
218	688201	信安世纪	2,699	169,092.35	0.03
219	603218	日月股份	5,100	168,045.00	0.03
220	300990	同飞股份	1,300	166,088.00	0.03
221	002271	东方雨虹	3,100	163,308.00	0.03
222	600919	江苏银行	27,700	161,491.00	0.03
223	300363	博腾股份	1,800	161,010.00	0.03
224	300896	爱美客	300	160,833.00	0.03
225	600763	通策医疗	800	159,200.00	0.03
226	601816	京沪高铁	32,600	157,458.00	0.03
227	688262	N 国芯	3,720	156,165.60	0.03
228	002508	老板电器	4,300	154,886.00	0.03
229	002714	牧原股份	2,900	154,744.00	0.03
230	688536	思瑞浦	200	153,600.00	0.03
231	002128	电投能源	10,200	151,470.00	0.03
232	688558	国盛智科	3,320	150,064.00	0.03
233	688308	欧科亿	2,087	147,509.16	0.03
234	300769	德方纳米	300	147,348.00	0.03

235	688367	工大高科	5,841	145,849.77	0.03
236	002991	甘源食品	1,900	144,970.00	0.03
237	601169	北京银行	32,600	144,744.00	0.03
238	300500	启迪设计	6,100	143,167.00	0.03
239	688071	华依科技	2,143	140,987.97	0.03
240	002179	中航光电	1,400	140,784.00	0.03
241	300426	唐德影视	16,100	138,299.00	0.03
242	601689	拓普集团	2,600	137,800.00	0.03
243	002463	沪电股份	8,300	137,614.00	0.03
244	688345	博力威	2,300	137,080.00	0.03
245	600660	福耀玻璃	2,900	136,706.00	0.03
246	600011	华能国际	14,100	136,629.00	0.03
247	600699	均胜电子	6,200	136,214.00	0.03
248	300684	中石科技	6,200	136,028.00	0.03
249	688385	复旦微电	2,699	135,867.66	0.03
250	600458	时代新材	9,800	135,730.00	0.03
251	002405	四维图新	8,400	133,728.00	0.03
252	300286	安科瑞	4,000	132,720.00	0.03
253	601995	中金公司	2,700	132,381.00	0.03
254	688529	豪森股份	4,274	130,741.66	0.03
255	601677	明泰铝业	2,900	127,861.00	0.03
256	300979	华利集团	1,300	115,765.00	0.02
257	300498	温氏股份	6,000	115,560.00	0.02
258	300855	图南股份	1,600	112,784.00	0.02
259	002389	航天彩虹	4,000	111,200.00	0.02
260	000650	仁和药业	11,900	110,908.00	0.02
261	000661	长春高新	400	108,560.00	0.02
262	002982	湘佳股份	2,200	107,338.00	0.02
263	002027	分众传媒	12,900	105,651.00	0.02
264	300416	苏试试验	3,100	105,245.00	0.02
265	000543	皖能电力	18,800	104,528.00	0.02
266	300748	金力永磁	2,300	103,247.00	0.02
267	002957	科瑞技术	4,000	101,720.00	0.02
268	300207	欣旺达	2,400	101,184.00	0.02
269	300428	立中集团	3,800	99,940.00	0.02
270	688301	奕瑞科技	200	99,380.00	0.02
271	002345	潮宏基	18,000	99,180.00	0.02
272	002240	盛新锂能	1,700	98,515.00	0.02
273	605128	上海沿浦	2,200	98,340.00	0.02
274	600905	三峡能源	13,000	97,630.00	0.02
275	300945	曼卡龙	4,600	96,738.00	0.02
276	002402	和而泰	3,500	96,005.00	0.02

277	688233	神工股份	1,083	95,520.60	0.02
278	600926	杭州银行	7,400	94,868.00	0.02
279	002434	万里扬	6,300	92,862.00	0.02
280	002791	坚朗五金	500	90,795.00	0.02
281	300491	通合科技	4,300	84,710.00	0.02
282	002958	青农商行	21,700	83,762.00	0.02
283	002493	荣盛石化	4,600	83,536.00	0.02
284	002960	青鸟消防	1,700	82,535.00	0.02
285	002948	青岛银行	17,500	81,025.00	0.02
286	300757	罗博特科	1,300	80,600.00	0.02
287	600019	宝钢股份	11,100	79,476.00	0.02
288	600875	东方电气	3,700	79,254.00	0.02
289	601766	中国中车	12,800	77,952.00	0.02
290	000733	振华科技	600	74,568.00	0.01
291	002472	双环传动	2,700	74,466.00	0.01
292	600999	招商证券	4,200	74,130.00	0.01
293	002840	华统股份	4,200	72,576.00	0.01
294	300835	龙磁科技	1,000	72,150.00	0.01
295	300863	卡倍亿	800	71,736.00	0.01
296	600346	恒力石化	3,100	71,207.00	0.01
297	601800	中国交建	8,200	70,356.00	0.01
298	300705	九典制药	2,000	70,280.00	0.01
299	300915	海融科技	1,200	68,652.00	0.01
300	000875	吉电股份	7,500	68,175.00	0.01
301	600918	中泰证券	6,800	67,796.00	0.01
302	601390	中国中铁	11,600	67,164.00	0.01
303	600559	老白干酒	2,400	67,056.00	0.01
304	002505	鹏都农牧	17,300	66,086.00	0.01
305	300902	国安达	1,600	65,936.00	0.01
306	601669	中国电建	8,100	65,448.00	0.01
307	002841	视源股份	800	65,120.00	0.01
308	300433	蓝思科技	2,800	64,344.00	0.01
309	001215	千味央厨	1,100	64,031.00	0.01
310	688080	映翰通	681	59,723.70	0.01
311	002325	洪涛股份	20,000	57,200.00	0.01
312	600009	上海机场	1,200	56,028.00	0.01
313	000893	亚钾国际	2,100	55,965.00	0.01
314	600976	健民集团	700	55,223.00	0.01
315	603993	洛阳钼业	9,600	53,568.00	0.01
316	300813	泰林生物	500	50,000.00	0.01
317	002736	国信证券	4,300	49,364.00	0.01
318	688678	福立旺	1,499	49,152.21	0.01

319	601696	中银证券	3,500	47,075.00	0.01
320	603668	天马科技	3,600	45,180.00	0.01
321	002627	三峡旅游	8,400	44,688.00	0.01
322	000895	双汇发展	1,400	44,170.00	0.01
323	300999	金龙鱼	700	44,051.00	0.01
324	300908	仲景食品	800	43,360.00	0.01
325	301155	海力风电	446	43,150.50	0.01
326	000761	本钢板材	10,100	42,420.00	0.01
327	603444	吉比特	100	42,185.00	0.01
328	002060	粤水电	7,600	42,180.00	0.01
329	600808	马钢股份	11,300	41,697.00	0.01
330	002056	横店东磁	2,200	41,514.00	0.01
331	601878	浙商证券	3,100	40,858.00	0.01
332	601117	中国化学	3,400	40,800.00	0.01
333	300955	嘉亨家化	1,200	39,444.00	0.01
334	000959	首钢股份	6,800	38,964.00	0.01
335	688208	道通科技	486	38,588.40	0.01
336	000682	东方电子	4,500	38,115.00	0.01
337	600018	上港集团	6,800	37,264.00	0.01
338	601998	中信银行	8,000	36,960.00	0.01
339	002311	海大集团	500	36,650.00	0.01
340	600685	中船防务	1,500	34,995.00	0.01
341	600418	江淮汽车	2,000	34,800.00	0.01
342	002171	楚江新材	2,600	34,476.00	0.01
343	000997	新大陆	1,900	34,428.00	0.01
344	002497	雅化集团	1,200	34,392.00	0.01
345	600841	上柴股份	2,900	34,307.00	0.01
346	002937	兴瑞科技	1,700	34,272.00	0.01
347	301050	雷电微力	145	34,037.30	0.01
348	300068	南都电源	2,400	33,984.00	0.01
349	002655	共达电声	1,900	33,953.00	0.01
350	002886	沃特股份	1,100	33,924.00	0.01
351	600522	中天科技	2,000	33,920.00	0.01
352	002063	远光软件	3,400	33,796.00	0.01
353	002335	科华数据	900	32,724.00	0.01
354	300928	华安鑫创	600	31,686.00	0.01
355	000400	许继电气	1,200	31,320.00	0.01
356	688050	爱博医疗	143	30,062.89	0.01
357	001914	招商积余	1,400	28,364.00	0.01
358	002339	积成电子	3,400	27,982.00	0.01
359	301136	招标股份	2,637	27,741.24	0.01
360	002988	豪美新材	1,300	26,793.00	0.01

361	002572	索菲亚	1,200	26,640.00	0.01
362	000625	长安汽车	1,700	25,823.00	0.01
363	300643	万通智控	2,000	25,820.00	0.01
364	603867	新化股份	700	25,802.00	0.01
365	000921	海信家电	1,700	25,755.00	0.01
366	300699	光威复材	300	25,344.00	0.01
367	688559	海目星	423	25,257.33	0.01
368	000786	北新建材	700	25,081.00	0.01
369	688595	芯海科技	200	24,890.00	0.00
370	301035	润丰股份	441	24,819.48	0.00
371	603801	志邦家居	800	24,336.00	0.00
372	688383	新益昌	191	23,061.34	0.00
373	300993	玉马遮阳	800	22,968.00	0.00
374	000938	紫光股份	1,000	22,850.00	0.00
375	688155	先惠技术	200	22,800.00	0.00
376	002859	洁美科技	600	22,320.00	0.00
377	300219	鸿利智汇	1,400	22,134.00	0.00
378	688135	利扬芯片	529	22,106.91	0.00
379	002544	杰赛科技	900	21,366.00	0.00
380	000799	酒鬼酒	100	21,250.00	0.00
381	002879	长缆科技	900	21,240.00	0.00
382	000100	TCL 科技	3,400	20,978.00	0.00
383	000932	华菱钢铁	4,000	20,440.00	0.00
384	688123	聚辰股份	299	20,290.14	0.00
385	000829	天音控股	1,100	20,284.00	0.00
386	300031	宝通科技	700	19,285.00	0.00
387	688330	宏力达	169	19,208.54	0.00
388	300415	伊之密	900	19,116.00	0.00
389	301090	华润材料	1,624	18,768.70	0.00
390	301177	迪阿股份	158	18,340.64	0.00
391	000598	兴蓉环境	2,800	17,696.00	0.00
392	301029	怡合达	194	17,434.78	0.00
393	301039	中集车辆	1,373	17,176.23	0.00
394	002241	歌尔股份	300	16,230.00	0.00
395	300618	寒锐钴业	200	16,036.00	0.00
396	301127	天源环保	905	15,658.30	0.00
397	301221	光庭信息	159	14,106.48	0.00
398	688077	大地熊	180	13,894.20	0.00
399	688095	福昕软件	100	13,801.00	0.00
400	300733	西菱动力	500	13,140.00	0.00
401	301096	百诚医药	159	12,486.27	0.00
402	002224	三力士	2,300	12,167.00	0.00

403	300460	惠伦晶体	600	11,970.00	0.00
404	301189	奥尼电子	188	10,644.56	0.00
405	301093	华兰股份	209	10,418.65	0.00
406	301179	泽宇智能	189	9,595.53	0.00
407	301099	雅创电子	133	9,490.88	0.00
408	301100	风光股份	304	9,466.56	0.00
409	688300	联瑞新材	85	9,423.95	0.00
410	301190	善水科技	343	9,418.78	0.00
411	301168	通灵股份	180	9,383.40	0.00
412	301088	戎美股份	380	9,374.60	0.00
413	688398	赛特新材	184	9,347.20	0.00
414	301091	深城交	294	9,205.14	0.00
415	301058	中粮工科	499	9,101.76	0.00
416	301017	漱玉平民	366	8,710.80	0.00
417	301108	洁雅股份	161	8,647.31	0.00
418	300994	久祺股份	173	7,862.85	0.00
419	300783	三只松鼠	200	7,794.00	0.00
420	688630	芯碁微装	106	7,529.18	0.00
421	000681	视觉中国	300	7,170.00	0.00
422	301018	申菱环境	268	6,984.08	0.00
423	301046	能辉科技	141	6,907.59	0.00
424	301101	明月镜片	154	6,677.44	0.00
425	301089	拓新药业	97	6,589.21	0.00
426	603899	晨光文具	100	6,451.00	0.00
427	301118	恒光股份	129	6,323.58	0.00
428	301092	争光股份	178	6,322.56	0.00
429	301199	迈赫股份	195	6,240.00	0.00
430	600845	宝信软件	100	6,083.00	0.00
431	301015	百洋医药	199	6,029.70	0.00
432	688030	山石网科	198	5,872.68	0.00
433	300590	移为通信	200	5,770.00	0.00
434	301138	华研精机	124	5,562.64	0.00
435	301026	浩通科技	87	5,457.51	0.00
436	301028	东亚机械	390	5,265.00	0.00
437	301048	金鹰重工	391	5,067.36	0.00
438	301111	粤万年青	134	4,915.12	0.00
439	301126	达嘉维康	254	4,884.42	0.00
440	301188	力诺特玻	237	4,853.76	0.00
441	301060	兰卫医学	151	4,671.94	0.00
442	301020	密封科技	148	4,505.12	0.00
443	600985	淮北矿业	400	4,472.00	0.00
444	301193	家联科技	153	4,458.42	0.00

445	301052	果麦文化	128	4,305.92	0.00
446	301098	金埔园林	193	4,278.81	0.00
447	301078	孩子王	344	4,176.16	0.00
448	688698	伟创电气	155	4,157.10	0.00
449	301185	鸥玛软件	190	4,020.40	0.00
450	301133	金钟股份	147	3,961.65	0.00
451	300814	中富电路	165	3,940.20	0.00
452	301066	万事利	171	3,905.64	0.00
453	300774	倍杰特	185	3,899.80	0.00
454	301062	上海艾录	224	3,810.24	0.00
455	688239	航宇科技	55	3,749.35	0.00
456	301030	仕净科技	116	3,656.32	0.00
457	688578	艾力斯	116	3,503.20	0.00
458	301033	迈普医学	55	3,298.35	0.00
459	301049	超越科技	92	3,028.64	0.00
460	301182	凯旺科技	99	3,027.42	0.00
461	300035	中科电气	100	3,025.00	0.00
462	301198	喜悦智行	96	2,803.20	0.00
463	301016	雷尔伟	108	2,799.36	0.00
464	301036	双乐股份	92	2,753.56	0.00
465	301053	远信工业	95	2,734.10	0.00
466	301041	金百泽	95	2,679.95	0.00
467	301032	新柴股份	214	2,677.14	0.00
468	301025	读客文化	127	2,651.76	0.00
469	301081	严牌股份	150	2,616.00	0.00
470	601339	百隆东方	400	2,356.00	0.00
471	301073	君亭酒店	72	2,304.00	0.00
472	301059	金三江	118	2,277.40	0.00
473	300854	中兰环保	83	2,265.07	0.00
474	301027	华蓝集团	135	2,247.75	0.00
475	301057	汇隆新材	107	2,035.14	0.00
476	301083	百胜智能	130	1,847.30	0.00
477	301037	保立佳	73	1,770.98	0.00
478	301079	邵阳液压	63	1,563.66	0.00
479	001234	泰慕士	90	1,487.70	0.00
480	603176	汇通集团	440	1,078.00	0.00
481	688599	天合光能	1	78.90	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	600519	贵州茅台	88,468,958.79	4.39
2	601318	中国平安	83,394,003.58	4.14
3	603259	药明康德	78,089,528.94	3.87
4	600036	招商银行	76,254,947.38	3.78
5	600309	万华化学	73,625,050.95	3.65
6	600019	宝钢股份	67,451,505.31	3.35
7	000100	TCL 科技	62,636,126.00	3.11
8	601166	兴业银行	61,173,863.00	3.03
9	000001	平安银行	58,614,849.75	2.91
10	000725	京东方 A	56,669,839.38	2.81
11	601919	中远海控	54,478,218.77	2.70
12	600809	山西汾酒	53,437,808.49	2.65
13	600031	三一重工	52,664,049.67	2.61
14	601336	新华保险	50,436,778.24	2.50
15	603501	韦尔股份	50,411,933.20	2.50
16	000661	长春高新	48,746,256.60	2.42
17	300059	东方财富	47,055,824.90	2.33
18	002027	分众传媒	46,739,188.75	2.32
19	601899	紫金矿业	45,348,448.18	2.25
20	600438	通威股份	44,416,662.96	2.20
21	600584	长电科技	44,378,706.39	2.20
22	000063	中兴通讯	43,189,307.54	2.14
23	603882	金域医学	43,123,824.56	2.14
24	000786	北新建材	43,041,303.00	2.13
25	603345	安井食品	42,919,620.10	2.13
26	600919	江苏银行	41,891,341.06	2.08
27	600887	伊利股份	41,491,663.00	2.06
28	002129	中环股份	40,724,782.67	2.02

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	600519	贵州茅台	118,070,288.43	5.86
2	601318	中国平安	100,265,208.15	4.97
3	601166	兴业银行	87,643,696.45	4.35
4	600036	招商银行	84,110,376.20	4.17
5	000001	平安银行	79,517,988.60	3.94
6	600309	万华化学	79,156,275.93	3.93
7	603259	药明康德	77,361,742.11	3.84
8	601919	中远海控	73,494,346.43	3.64
9	600019	宝钢股份	72,862,093.63	3.61

10	601888	中国中免	69,895,454.78	3.47
11	300059	东方财富	68,953,866.74	3.42
12	603501	韦尔股份	68,232,344.97	3.38
13	601899	紫金矿业	66,702,845.81	3.31
14	600438	通威股份	66,476,950.14	3.30
15	600031	三一重工	64,516,660.90	3.20
16	000725	京东方A	64,304,397.00	3.19
17	600584	长电科技	64,010,693.98	3.17
18	000661	长春高新	62,581,701.04	3.10
19	002027	分众传媒	62,083,539.77	3.08
20	000100	TCL科技	61,320,439.45	3.04
21	600809	山西汾酒	60,928,340.55	3.02
22	603882	金域医学	59,411,932.63	2.95
23	601211	国泰君安	56,624,610.31	2.81
24	600887	伊利股份	55,926,861.44	2.77
25	601336	新华保险	54,690,740.73	2.71
26	300015	爱尔眼科	50,521,182.18	2.51
27	000858	五粮液	45,803,177.30	2.27
28	603345	安井食品	45,793,712.74	2.27
29	601658	邮储银行	45,138,504.52	2.24
30	300124	汇川技术	44,069,869.84	2.19
31	000063	中兴通讯	43,319,599.97	2.15
32	601688	华泰证券	42,827,611.12	2.12
33	000568	泸州老窖	42,434,455.15	2.10
34	002129	中环股份	41,300,782.46	2.05
35	000961	中南建设	40,941,589.17	2.03
36	600919	江苏银行	40,789,885.20	2.02
37	601117	中国化学	40,690,051.63	2.02

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	6,992,575,376.66
卖出股票收入（成交）总额	8,115,431,916.35

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	90,377,000.00	18.15

2	央行票据	-	-
3	金融债券	91,284,000.00	18.33
	其中：政策性金融债	91,284,000.00	18.33
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）	43,921,484.11	8.82
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	225,582,484.11	45.29

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	200009	20 付息国债 09	500,000	49,985,000.00	10.04
2	210210	21 国开 10	300,000	30,648,000.00	6.15
3	190208	19 国开 08	300,000	30,606,000.00	6.14
4	092118100	21 农发清发 100	300,000	30,030,000.00	6.03
5	210009	21 付息国债 09	200,000	20,332,000.00	4.08

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	138935	中和 11A	150,000	4,927,500.00	0.99

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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF2202	IF2202	-2	-2,970,360.00	-2,297.14	-
IF2203	IF2203	-70	-103,962,600.00	-1,595,658.75	-
IH2202	IH2202	-26	-25,674,480.00	-88,320.00	-

			00		
IH2203	IH2203	-30	-29,687,400.00	338,220.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-1,348,055.89
股指期货投资本期收益（元）					-74,116,177.56
股指期货投资本期公允价值变动（元）					37,521,757.56

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本集合计划使用股指期货对冲组合的系统性风险，从而分离出组合的超额收益。根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货对冲。综合考虑股指期货不同合约之间的价差关系、套利机会、流动性等因素，在各股指期货合约之间进行动态配置和临近到期合约的展期操作，以提升组合收益和套期保值的效果。

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

根据本集合计划合同，本集合计划投资范围不包括国债期货。

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进行国债期货投资。

8.11.3 本期国债期货投资评价

根据本集合计划合同，本集合计划投资范围不包括国债期货。

8.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 206,821,340.82 元，占基金资产净值的比例为 41.52%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-162,294,840.00 元，占基金资产净值的比例为-32.58%，空头合约市值占股票资产的比例为-78.47%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 36,508,492.68 元，公允价值变动损益为-23,657,164.79 元。

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

本报告编制日前一年内：

1) 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）。

2) 本集合计划持有的“兴业银行”因未依法履行其他职责，被中国人民银行公开处罚 5 万元（银罚字【2021】26 号）。

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	20,153,603.81
2	应收证券清算款	5,816,187.82
3	应收股利	-
4	应收利息	2,690,399.47
5	应收申购款	21,920.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,682,111.10

8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	123111	东财转3	8,040,781.42	1.61
2	113026	核能转债	8,016,763.70	1.61
3	128081	海亮转债	7,958,033.58	1.60
4	110059	浦发转债	3,022,646.50	0.61
5	113042	上银转债	2,999,811.90	0.60
6	113021	中信转债	2,989,222.40	0.60
7	110053	苏银转债	1,988,448.00	0.40

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不存在流通受限情况。

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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
光大阳光 对冲 6 个 月持有混 合 A	24	129,706.93	-	-	3,112,966.42	100.00
光大阳光 对冲 6 个 月持有混 合 B	284	140,293.14	28,146,931.88	70.64	11,696,319.01	29.36
光大阳光 对冲 6 个 月持有混 合 C	53,448	8,257.08	-	-	441,324,525.40	100.00
合计	53,756	9,008.87	28,146,931.88	5.81	456,133,810.83	94.19

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	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	246,554.14	7.92
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	134,668.44	0.34
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C	1,004.04	0.00
	合计	382,226.62	0.08

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	光大阳光对冲 6 个月持有混 合 A	0
	光大阳光对冲 6 个月持有混 合 B	0~10
	光大阳光对冲 6 个月持有混 合 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有 本开放式基金	光大阳光对冲 6 个月持有混 合 A	0
	光大阳光对冲 6 个月持有混 合 B	0
	光大阳光对冲 6 个月持有混	0

	合 C	
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	光大阳光对冲6个月持有混合 A	光大阳光对冲6个月持有混合 B	光大阳光对冲6个月持有混合 C
基金合同生效日（2020年3月25日）基金份额总额	38,874,579.27	-	-
本报告期期初基金份额总额	9,395,579.84	77,046,282.80	1,826,202,835.09
本报告期基金总申购份额	-	1,722,870.68	633,432,687.95
减：本报告期基金总赎回份额	6,282,613.42	38,925,902.59	2,018,310,997.64
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
本报告期末基金份额总额	3,112,966.42	39,843,250.89	441,324,525.40

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重大人事变动。

本集合计划投资经理变动详见“4.1 基金管理人及基金经理情况”章节。

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

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	15,092,109,845.62	100.00%	11,047,938.77	100.00%	-

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	739,342,200.64	100.00%	19,395,000,000.00	100.00%	-	-

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	关于旗下光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划增加代理销售机构的公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 02 月 24 日
2	关于旗下光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划增加代理销售机构并开通定期定额投资业务的公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 03 月 04 日
3	光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划基金经	中国证监会规定的媒介	2021 年 07 月 19 日

	理变更公告		
4	光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书（更新）及产品资料概要更新	中国证监会规定的媒介	2021 年 07 月 21 日
5	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
6	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率优惠的公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 08 月 16 日
7	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

§ 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无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对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划合同变更的函；

2、《光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》；

3、《光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划托管协议》；

4、《光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书》；

5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；

6、集合计划管理人业务资格批件、营业执照；

7、中国证监会要求的其他文件。

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