# 光大阳光优选一年持有期混合型集合资产 管理计划 2022 年第 1 季度报告

2022年3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: 中国工商银行股份有限公司

报告送出日期: 2022年04月22日

# §1 重要提示

集合计划管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

集合计划托管人中国工商银行股份有限公司根据本集合计划合同规定,于 04 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产,但不保证集合计划一定盈利,也不保证最低收益。投资需谨慎,敬请投资者注意投资风险。投资者欲了解本集合计划的详细情况,请于投资集合计划前认真阅读集合计划的产品合同、更新的招募说明书等法律文件以及相关业务公告。敬请投资者关注适当性管理相关规定,提前做好风险测评,并根据自身的风险承受能力购买风险等级相匹配的产品。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 03 月 31 日止。

# § 2 基金产品概况

基金简称	光大阳光优选一年持有混合
基金主代码	860006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年10月14日
报告期末基金份额总额	45, 781, 043. 18 份
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	(一)资产配置策略 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。 (二)权益类品种的投资策略 本集合计划通过综合比较商业模式、产业生命周期、成长性和估值的匹配度等因素,在全市场优选行业;并通

过量化分析的手段、综合考虑经济意义、商业逻辑和策略实换性,建立宏观指标与行业起额收益之间具有内在逻辑的映射关系,以此作为行业配置收益增强的辅助策略。  (一) 周定收益类品种投资策略 在债券发资方面、本计划率根据对利率 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能等因素、构造债券组合。 (四) 资产支持证券价值的高等码素、 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。 (五) 衍生品投资策略 1、股指期货投资策略 1、股指期货投资策略 1、股指期货投资增格。本集合计划布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。本集合计划在股指期货投资,以管理投资组合的系统性风险。改善组合的风险收益特性。 2、国信期货的投资策略 本集合计划投资国信期货以会期保值为目的,国信期货空头的合约价值主要与债券组合的多统性风险。改善组合的多。外值值对应。管理人通过动态管理国信期货合约数量,以获取相应债券组合的起额收益。 中证 800 指数收益率×60%中中债综合指数收益率×20%中证进股通综合指数(人民币)收益率20%。有关的显额收益。 本集合计划为混合型集合计划,其预期从险和预期收益高于债券型基金、债券型集合计划,使于股资和发布超差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。不集合计划除了投资A股外,还可根据法律法规规定投资资产等理计划。低于股票型基金和股票型集合计划。由于股票的的市场流动风险等一般投资风险之外,本集合计划实面的市场流动风险等一般投资风险之外,本集合计划实面的市场流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之并带来的特有风险。 基金管理人 基金行为		) 1. 目 ル ハ l に 4) - ズ r II	/	ン			
逻辑的映射关系,以此作为行业配置收益增强的辅助策略。  (三)固定收益类品种投资策略 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。 (四)资产支持证券投资策略 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。 (五)衍生品投资策略 (五)衍生为投资的。 本集合计划在股指期货投资产的的前投下,本着谨慎原则,多与股指则货的投资。以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。2、国债期货的投资资,以资理投资组合的多头价值和对应。管理人通过动态管理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量,以获取相应债券组合的超额收益。 中证 800 指数收益率×20%。中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%。中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%。不集合计划形成企业集合计划、货币市场基金和货币建集合资产管理计划、低于股票型基金和股票型集合计划。不集合计划验价投资和股票。除了需要承担与境内集合计划。不集合计划还面临港股通机等全量中划,低于股票型基金和股票是集合计划。有于股票公司,一种工厂股份等现本的特有风险。上海光大证券资产管理有限公司,并有混合及有限公司。光大阳光优选一年,并有混合 8 共和混优选一年,并有混合 8 共和混优选一年,并有混合 8 共和混优选。4 共有混合 8 共和混优选。4 并有混合 8 特有混合 8 860056 860056							
略。			.,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,				
(三)固定收益类品种投资策略 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。 (四)资产支持证券投资策略 本集合计划将重点对市场利率、发行条款、支持资产的特质成质量、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的相对投资价值并做出相应的投资决策。 (五)衍生品投资策略 1、服指期货投资策略 情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策略 情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策略 有工业用股指期货,以费期保值为目的,在风险可控的前域上,本者信证则则。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。 2、阿债期货的投资策略 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外价值对对应。管理人通过动态管理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业价值,以获取相应债券组合的超额收益。 中证 800 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×20%中主递股通综合指数(人尺币)收益率×20%。 本集合计划为混合型集合计划,货币市场基金和股票型集合计划是一个工资。从于股票型基金和股票型集合计划。本集合计划除了,投资入股外,还可根据法律法规规定投资者数分。100%,还可根据法律法规规定投资者数分。100%,还可根据法律法规规定投资者数分。100%,还可根据法律法规规定投资者的产量的所上市的股票。除了需要承担与境内集合计划。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。 基金管理人 基金化管人 中国工商银行股份有限公司 中国工商银行股份有限公司 中国工商银行股份有限公司 中国工商银行股份有限公司 中国工商银行股份有限公司 中国工商银行股份有限公司 中国工商银行股份有限公司 大大阳光优选一年 持有混合 图为程德合 光大阳光优选一年 持有混合 图为程德合 第有混合 1940%组基金的交易代码 860006			以此作为行业配直以	仅益增强的辅助策			
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。 (四) 资产支持证券投资策略 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,并辅助采用定价核型,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。 (五) 衍生品投资策略 1. 服指期货投资策略 1. 服指期货投资策略 1. 服指期货投资策略 1. 服指期货投资策略 2. 国债期货的投资 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,以会期保值为目的,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。 2. 国债期货的投资策略 本集合计划投资销债期货以会期保值为目的,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。 中证 800 指数收益率× 20%。中证 建股通综合指数 (人民币)收益率× 20%。中证 建股通综合指数 (人民币)收益率× 20%。不集合计划方混合型集合计划,低于股票型基金和股票型集合计划,后可要集合计划,低于股票型基金和股票型集合计划。 本集合计划序语分量集合计划,低于股票型基金和股票型集合计划,低于股票型基金和股票型集合计划,成于商场等型基金、债券型集合计划,低于股票型基金和股票型集合计划,在于股票型基金和股票型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。 基金管理人 生活光元证券资产管理有限公司 大下成光改造一年 为有混合 B 为无比优选一年 大用光优选一年 持有混合 B 为无比优选一年 持有混合 B 为无时无优选一年 持有混合 B 860056							
企业债和可转换债券等债券品种。本计划将根据对利率		, ,, = ,, ,	,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,	~ <del>-</del>			
走勢的預測、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。 (四)资产支持证券投资策略 本集合计划将重点对市场利率、及行条款、支持资产的构成及质量、提销偿还率、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。 (五)衍生品投资策略管理人可运用股指期货投资等略管理人可运用股指期货投资策略管理人可运用股指期货投资策略管理人可运用股份的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。2.国债期货的投资策略本集合计划投资国债期货。改善组合的风险收益特性。2.国债期货的投资策略本集合计划投资国债期货合约数量,以获取相应债券组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。2.国债期货的投资策略本集合计划投资国债期货合约数量,以获取相应债券组合的经额收益。本集合计划投资国债期货合约数量,以获取相应债券组合的超额收益。20%中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%。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。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。基金管理人上海光代选一年大大正条资产管理有限公司本集全任任人中国工商银行股份有限公司本集全任任人中国工商银行股份有限公司本集全任人中国工商银行股份可限公司本集全任人中国工商银行股份可限公司本线管价。							
不同品种流动性的高低等因素,构造债券组合。 (四)资产支持证券投资策略 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。 (五)衍生品投资策略 1. 股指期货投资策略 1. 股指期货投资策略 1. 股指期货投资策略 2. 国债期货的投资,以差期保值为目的,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。2. 国债期货的投资策略 本集合计划投资国债期货以衰期保值为目的,国债期货空头的合约价值产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。 中证 800 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×20%-中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%。 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。本集合计划等口投资 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是面临港股通机制下房投资风险之外,本集合计划还面临港股通机制下房投资风险之外,本集合计划还面临港股通机制下房投资风险之外,本集合计划还面临港股通机制下房投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 基金管理人 基金管理人 基金管理人 基金管理人 基金管理人 基金管理人 基金管理人 大阳光优选一年 持有混合 B 光大阳光优选一年 持有混合 C 光大阳光优选一年							
(四)资产支持证券投资策略 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。 (五)衍生品投资策略 1、股指期货投资策略 1、股指期货投资策略 1、股指期货投资策略 1、股指期货投资策略 1、股指期货投资策略 1、股指期货,以提高投资效率更好地达到本集合计划的贷目标。本集合计划也股指期货投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组份的风险收益特性。 2、国债期货的投资策略 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。 2、%中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%。中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%。本集合计划为混合型集合计划,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。 本集合计划定合型集合计划,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。 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还负债格股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易所处市场波动风险等一般投资风险之外,本集合计划还面临路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。基金管理人上海光大证券资产管理有限公司 基金托管人中国工商银行股份有限公司 基金托管人中国工商银行股份有限公司 基金托管人中国工商银行股份有限公司		, = ,	*				
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。 (五) 衍生品投资策略 1. 股指期货投资策略 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。 2. 国债期货的投资策略 本集合计划投资国债期货品约数量,以获取相应债券组合的超额收益。 中证 800 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×20%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%。 本集合计划为混合型集合计划,货币市场基金和发资产债券型基金、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。 本集合计划还面临港股通机等各种发资风险之外,本集合计划还面临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户带来的转有风险。 基金管理人 上海光大证券资产管理有限公司 基金任管人 中国工商银行股份有限公司 光大阳光优选一年持有混合 860006 860055 860056		不同品种流动性的	]高低等因素,构造(	债券组合。			
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。							
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。 (五) 衍生品投资策略 1、股指期货投资策略 1、股指期货投资策略 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,在风险可挖的前提下,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。 2、国债期货的投资策略 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。 20%中证港股通综合指数人民币)收益率×20%。  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。本集合计划定可的形数对风险等一般投资风险资格的未发资产管理计划。不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。 基金管理人 上海光大证券资产管理有限公司 基金托管人 中国工商银行股份有限公司  光大阳光优选一年 持有混合 8		本集合计划将重点对市场利率、发行条款、支持资产的					
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。 (五)衍生品投资策略 1、股指期货投资策略 1、股指期货投资策略 1、股指期货投资策略 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。 2、国债期货的投资策略 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。 中证 800 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×20%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%。 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。 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。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。 基金管理人 基金托管人 中国工商银行股份有限公司 光大阳光优选一年 持有混合 B 持有混合 C 下属分级基金的基金简称 下属分级基金的支易代码 860006 860055 860056		构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性					
应的投资决策。 (五)衍生品投资策略 1、股指期货投资策略 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。 2、国债期货的投资策略 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。  业绩比较基准 中证 800 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×20%。 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。 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。 基金管理人 上海光大证券资产管理有限公司 基金社管人 中国工商银行股份有限公司 光大阳光优选一年,持有混合 B 持有混合 C 下属分级基金的基金简称 持有混合 B 持有混合 C 下属分级基金的交易代码		等影响资产支持证	券价值的因素进行。	分析,并辅助采用			
(五) 衍生品投资策略 1、股指期货投资策略 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。 2、国债期货的投资策略 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。 业绩比较基准 中证800指数收益率×60%+中债综合指数收益率×20%-中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%。 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。 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实值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。 基金管理人 基金管理人 基金管理人 基金往管人 中国工商银行股份有限公司 光大阳光优选一年,持有混合 B 持有混合 C 下属分级基金的支易代码 860006 860055 860056		定价模型,评估资	产支持证券的相对	投资价值并做出相			
1、股指期货投资策略 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。 2、国债期货的投资策略 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。  业绩比较基准 中证 800 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×20%。  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。 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实例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。 基金管理人 基金管理人 上海光大证券资产管理有限公司 基金往管人 中国工商银行股份有限公司 光大阳光优选一年,大大阳光优选一年,持有混合 B 持有混合 C 下属分级基金的交易代码 860006 860055 860056		应的投资决策。					
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。 2、国债期货的投资策略本集合计划投资国债期货公套期保值为目的,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。  业绩比较基准 中证 800 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×20%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%。  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。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。  基金管理人 上海光大证券资产管理有限公司 基金托管人 中国工商银行股份有限公司  光大阳光优选一年,持有混合 B		(五) 衍生品投资策略					
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。 2、国债期货的投资策略 本集合计划投资国债期货公套期保值为目的,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。  业绩比较基准 中证 800 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×20%-中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%。  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。 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。  基金管理人 基金管理人 上海光大证券资产管理有限公司 基金托管人 中国工商银行股份有限公司  光大阳光优选一年 持有混合 B		1、股指期货投资领	策略				
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。 2、国债期货的投资策略 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。 中证 800 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×20%。 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。 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,本集合计划交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。 基金管理人  基金管理人  上海光大证券资产管理有限公司  **大阳光优选一年, 光大阳光优选一年, 持有混合 B		管理人可运用股指	期货,以提高投资	效率更好地达到本			
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。 2、国债期货的投资策略 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。 中证 800 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×20%。 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。 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。 基金管理人 上海光大证券资产管理有限公司 上海光大证券资产管理有限公司 上海光大证券资产管理有限公司 大下属分级基金的基金简称 大下阳光优选一年,光大阳光优选一年,持有混合 C		集合计划的投资目标。本集合计划在股指期货投资中将					
理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。 2、国债期货的投资策略 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。 小绩比较基准 中证 800 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×20%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%。 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。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。 基金管理人 基金管理人 基金管理人 基金管理人 基金管理人 基金任管人 中国工商银行股份有限公司 下属分级基金的基金简称 为大阳光优选一年,为有混合 B 持有混合 C 下属分级基金的交易代码		根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控					
理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。 2、国债期货的投资策略 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。 小绩比较基准 中证 800 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×20%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%。 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。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。 基金管理人 基金管理人 基金管理人 基金管理人 基金管理人 基金任管人 中国工商银行股份有限公司 下属分级基金的基金简称 为大阳光优选一年,为有混合 B 持有混合 C 下属分级基金的交易代码		   的前提下,本着谨	慎原则,参与股指	期货的投资,以管			
2、国债期货的投资策略 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。管理人进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。 业绩比较基准 中证 800 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×20%。 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。 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。 基金管理人 基金管理人 上海光大证券资产管理有限公司 ************************************				,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,			
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。  业绩比较基准  中证 800 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×20%。  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。 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。  基金管理人  上海光大证券资产管理有限公司  基金任管人  中国工商银行股份有限公司  光大阳光优选一年 光大阳光优选一年 持有混合 C 下属分级基金的交易代码  860006  860055  860056							
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。 业绩比较基准 中证 800 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×20%。 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。 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。 基金管理人 上海光大证券资产管理有限公司 基金托管人 中国工商银行股份有限公司 光大阳光优选一年,光大阳光优选一年,持有混合 C				为目的, 国债期货			
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。  业绩比较基准  中证 800 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×20%。  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。  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。  基金管理人  基金管理人  上海光大证券资产管理有限公司  基金托管人  中国工商银行股份有限公司  光大阳光优选一年 光大阳光优选一年 光大阳光优选一年 持有混合 B 持有混合 C 持有混合 B 860056							
组合的超额收益。  业绩比较基准  中证 800 指数收益率×60%+中债综合指数收益率× 20%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%。  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。 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。 基金管理人  上海光大证券资产管理有限公司  基金托管人  中国工商银行股份有限公司  光大阳光优选一年 光大阳光优选一年 持有混合 B  下属分级基金的基金简称  下属分级基金的交易代码  860006  860055			-2	177			
业绩比较基准 中证 800 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×20%。 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。 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。 基金管理人 上海光大证券资产管理有限公司 上海光大证券资产管理有限公司 光大阳光优选一年 光大阳光优选一年 光大阳光优选一年 持有混合 B 持有混合 C 持有混合 B 860056 860056			. 口以外又口730主,				
20%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%。  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。  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。  基金管理人  基金管理人  上海光大证券资产管理有限公司  基金托管人  中国工商银行股份有限公司  光大阳光优选一年  大大阳光优选一年  持有混合 B  持有混合 C  下属分级基金的基金简称  下属分级基金的交易代码  860006  860055  860056			家×60%+中债综合	·指数收益率×			
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。 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。 基金管理人 上海光大证券资产管理有限公司 上海光大证券资产管理有限公司 中国工商银行股份有限公司  ***********************************	正次记忆至1L	,		,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,			
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。 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。 基金管理人 上海光大证券资产管理有限公司 基金托管人 中国工商银行股份有限公司 ************************************	风险收益特征						
市型集合资产管理计划,低于股票型基金和股票型集合计划。 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。  基金管理人  上海光大证券资产管理有限公司  基金托管人 中国工商银行股份有限公司  光大阳光优选一年 光大阳光优选一年 持有混合 B 持有混合 C 持有混合 C 860006 860055 860056							
计划。     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。     基金管理人    上海光大证券资产管理有限公司     基金托管人    中国工商银行股份有限公司     下属分级基金的基金简称    光大阳光优选一年    光大阳光优选一年    持有混合 B							
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。  基金管理人 上海光大证券资产管理有限公司 基金托管人 中国工商银行股份有限公司  光大阳光优选一年 光大阳光优选一年 光大阳光优选一年 持有混合 B 持有混合 C 持有混合 C 860056			10人11,10人10人不主	坐並作成示主未口			
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。  基金管理人 上海光大证券资产管理有限公司 基金托管人 中国工商银行股份有限公司  **大阳光优选一年 光大阳光优选一年 光大阳光优选一年		1 .,	· 洛 Δ 股 外 -	据注律注扣扣空投			
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。  基金管理人  上海光大证券资产管理有限公司  基金托管人  中国工商银行股份有限公司  大大阳光优选一年 光大阳光优选一年 光大阳光优选一年 持有混合 B 持有混合 C 持有混合 C 860055 860056			->	,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,			
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。         基金管理人       上海光大证券资产管理有限公司         基金托管人       中国工商银行股份有限公司         下属分级基金的基金简称       光大阳光优选一年 持有混合 B       光大阳光优选一年 持有混合 B       光大阳光优选一年 持有混合 C         下属分级基金的交易代码       860006       860055       860056							
基金管理人       上海光大证券资产管理有限公司         基金托管人       中国工商银行股份有限公司         下属分级基金的基金简称       光大阳光优选一年							
基金管理人       上海光大证券资产管理有限公司         基金托管人       中国工商银行股份有限公司         下属分级基金的基金简称       光大阳光优选一年 持有混合 B       光大阳光优选一年 持有混合 B       光大阳光优选一年 持有混合 B       持有混合 C         下属分级基金的交易代码       860006       860055       860056							
基金托管人       中国工商银行股份有限公司         下属分级基金的基金简称       光大阳光优选一年 持有混合 B 持有混合 B 持有混合 C         下属分级基金的交易代码       860006       860055       860056	其全管理人						
下属分级基金的基金简称       光大阳光优选一年 持有混合 A       光大阳光优选一年 持有混合 B       光大阳光优选一年 持有混合 B       持有混合 C         下属分级基金的交易代码       860006       860055       860056							
下属分级基金的基金简称持有混合 A持有混合 B持有混合 C下属分级基金的交易代码860006860055860056			I	光大阳光优选一年			
下属分级基金的交易代码 860006 860055 860056	下属分级基金的基金简称						
	   下属分级基金的交易代码						
- 3K ロガル 円周刀 纵至 起門刀 钡芯 钡 143、144、334、60 77 I 19、819、U3 77 I 18、809、Z9 77	报告期末下属分级基金的份额总额	45, 742, 354. 86 份		18,869.29 份			
- NV 中央EA、CABALLEN 75 表 DETTERM 52 2011 - 143 147 334 AN 70 1 TO XIVEL IS 40 113 40 TO TO XIVEL	基金托管人 下属分级基金的基金简称 下属分级基金的交易代码	合计划还面临港股场制度以及交易规 上海光大证券资产中国工商银行股份 光大阳光优选一年 持有混合 A 860006	通机制下因投资环 则等差异带来的特 管理有限公司 有限公司 光大阳光优选一年 持有混合 B 860055	竟、投资标的、市 有风险。 光大阳光优选一年 持有混合 C 860056			

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

# §3主要财务指标和基金净值表现

# 3.1 主要财务指标

单位: 人民币元

主要财务指标	报告期(2022年1月1日-2022年3月31日)					
	光大阳光优选一年持有混	光大阳光优选一年持有				
	合A	混合 B	混合 C			
1. 本期已实现收益	-8, 138, 582. 33	-1, 178. 91	-1, 272. 48			
2. 本期利润	-21, 692, 336. 09	-3, 171. 46	-3, 483. 13			
3. 加权平均基金份额	0.4724	0.1554	0 1551			
本期利润	-0. 4734	-0. 1554	-0. 1551			
4. 期末基金资产净值	108, 554, 588. 45	15, 628. 03	14, 756. 14			
5. 期末基金份额净值	2. 3732	0. 7885	0. 7820			

- 注:(1)本期已实现收益指集合本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益) 扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;
- (2)上述业绩指标不包括持有人认购或交易集合的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

光大阳光优选一年持有混合 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标 准差②	业绩比较基准	业绩比较基准 收益率标准差 ④	1)-3)	2-4
过去三个月	-16. 62%	1. 45%	-10. 68%	1. 27%	-5. 94%	0. 18%
过去六个月	-17. 26%	1. 24%	-10. 68%	0. 97%	-6. 58%	0. 27%
过去一年	-13. 23%	1. 25%	-12.68%	0.89%	-0. 55%	0. 36%
自基金合同	-12. 96%	1.31%	-9.06%	0. 90%	-3. 90%	0. 41%
生效起至今		1. 3170	9.00%	0. 90%	-3. 9070	0.4170

光大阳光优选一年持有混合 B

阶段 净值增长率①净值增长率标业绩比较基准业绩比较基准	1)-3	2-4
-----------------------------	------	-----

		准差②	收益率③	收益率标准差		
				4		
过去三个月	-16. 58%	1. 45%	-10.68%	1. 27%	-5. 90%	0. 18%
过去六个月	-17. 18%	1. 24%	-10. 68%	0. 97%	-6. 50%	0. 27%
过去一年	-13. 07%	1. 25%	-12.68%	0.89%	-0.39%	0. 36%
自基金合同	-21. 15%	1. 20%	-8. 67%	0. 90%	-12. 48%	0. 30%
生效起至今		1. 20%	-8.07%	0.90%	-12.48%	0. 30%

光大阳光优选一年持有混合 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标 准差②	业绩比较基准	业绩比较基准 收益率标准差 ④		2-4
过去三个月	-16. 75%	1. 45%	-10. 68%	1. 27%	-6. 07%	0. 18%
过去六个月	-17. 51%	1. 24%	-10. 68%	0. 97%	-6.83%	0. 27%
过去一年	-13. 74%	1. 25%	-12. 68%	0.89%	-1.06%	0. 36%
自基金合同	-21. 80%	1. 20%	-8. 67%	0. 90%	-13. 13%	0.209/
生效起至今		1. 20%	-8. 67%	0. 90%	-13. 13%	0. 30%

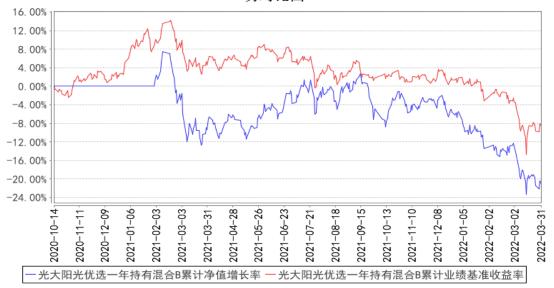
注: B 类份额、C 类份额设立日均为 2020 年 10 月 14 日, 自 2021 年 2 月 2 日开始有实际份额。

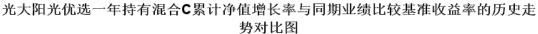
# 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

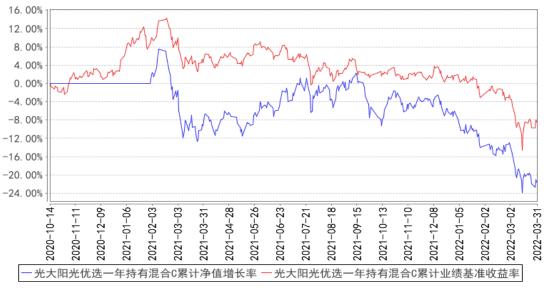
# 光大阳光优选一年持有混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



# 光大阳光优选一年持有混合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







# 3.3 其他指标

无。

# §4管理人报告

# 4.1基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金	金经理期限	证券从业	3H HH	
灶石		任职日期	离任日期	年限	说明 	
应超	多募投理合资光稳混合理资光智型产划理策投资、计经大健合资计经大选集管投略资经本划理阳增型产划理阳混合理资公部 集投、光长集管投、光合资计经	2020 年 12 月 15 日	1	6年	应超先生,浙江大学金融学学士、经济学硕士。2016年9月入职光大证券资产管理有限公司,先后负责多个行业的研究,具备较强的跨行业研究能力,现任公司多策略公募投资部投资经理。	

注: 1、集合计划的首任投资经理,其"任职日期"为集合计划合同生效日,其"离任日期"为根据公

司决议确定的解聘日期:

2、非首任投资经理,其"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期:

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本集合计划存在异常交易行为。报告期内,未出现涉及本集合计划的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

宏观方面,1-2月经济数据迎来开门红,生产端工业增加值好于去年四季度主要得益于供给约束和限产的进一步放松;需求端出口韧性仍在,房地产投资有所回暖,基建投资、制造业投资得益于低基数亦出现回升。但3月国内外宏观环境都出现突发性变化,首先是海外俄乌冲突发酵,供给收缩推升大宗商品价格,预计制造业成本压力、产业链扰动和外需拖累等影响将逐渐体现;其次国内以上海、深圳为代表城市的疫情爆发,从扩散面、封锁措施和交通出行等情况看,经济冲击程度仅次于2020年初。已公布的3月PMI大幅回落,预计一季度经济是前高后低的态势。

权益市场方面,一季度整体表现较弱,上证综指下跌 10.65%,恒生指数下跌 5.99%。主要是市场对宏观经济的预期比较悲观,同时叠加俄乌冲突、美国加息等外部因素。站在当前时点,权益估值已逐渐回落到合理偏低水平,自 3 月 15 日的政策底以来的市场情绪也有所改善。我们认为权益市场正逐步进入底部区域。

目前,整个产品在股票仓位上一直维持相对稳健的操作,持股结构也相对均衡,并没有在单一行业上暴露太大的风险。我们依旧坚持聚焦在具有长期竞争优势的企业,不断加深理解,希望和优秀企业一起,共同成长,穿越周期。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 3 月 31 日,光大阳光优选一年持有混合持有 A 类份额净值为 2.3732 元,本报告期份额净值增长率为-16.62%;光大阳光优选一年持有混合持有 B 类份额净值为 0.7885 元,本报告期份额净值增长率为-16.58%;光大阳光优选一年持有混合持有 C 类份额净值为 0.7820 元,本报告期份额净值增长率为-16.75%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内,本集合计划未出现连续二十个工作日集合计划份额持有人数量不满二百人或集合计划资产净值低于五千万元的情形。

# §5投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	87, 406, 538. 44	80. 12
	其中: 股票	87, 406, 538. 44	80. 12
2	基金投资	_	_
3	固定收益投资	6, 743, 998. 09	6. 18
	其中:债券	6, 743, 998. 09	6. 18
	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	14, 909, 481. 67	13. 67
8	其他资产	31, 886. 11	0.03
9	合计	109, 091, 904. 31	100.00

注:本集合计划本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 4,252,605.78 元人民币, 占期末集合计划资产净值比例 3.92%。

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	_
В	采矿业	_	-
С	制造业	69, 083, 593. 48	63. 62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应 业	-	-
Е	建筑业	-	_
F	批发和零售业	1, 005, 268. 16	0. 93
G	交通运输、仓储和邮政业	641, 903. 00	0. 59
Н	住宿和餐饮业	_	_
Ι	信息传输、软件和信息技术服务业	2, 532, 945. 02	2. 33
J	金融业	7, 001, 694. 00	6. 45
K	房地产业	_	_
L	租赁和商务服务业	1, 214, 067. 00	1.12
M	科学研究和技术服务业	1, 674, 462. 00	1.54
N	水利、环境和公共设施管理业	0.00	0.00
0	居民服务、修理和其他服务业	_	_
Р	教育	_	_
Q	卫生和社会工作	0.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	0.00	0.00
S	综合		
	合计	83, 153, 932. 66	76. 58

# 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值 (人民币)	占基金资产净值比例(%)
基础材料	_	_
消费者非必需品	-	_
消费者常用品	-	_
能源	_	_
金融	_	_
医疗保健	903, 819. 23	0.83
工业	_	_
信息技术	1, 601, 643. 54	1. 48
电信服务	-	_
公用事业	1, 747, 143. 01	1.61
房地产	_	_
合计	4, 252, 605. 78	3. 92

注: 以上行业分类采用港交所二级分类标准。

# 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	002648	卫星化学	141, 920	5, 591, 648. 00	5. 15
2	300750	宁德时代	9, 400	4, 815, 620. 00	4. 43
3	600690	海尔智家	203, 700	4, 705, 470. 00	4. 33
4	002129	中环股份	104, 400	4, 457, 880. 00	4. 11
5	600600	青岛啤酒	49, 500	3, 910, 995. 00	3.60
6	002594	比亚迪	15, 400	3, 538, 920. 00	3. 26
7	600884	杉杉股份	106, 900	2, 984, 648. 00	2.75
8	600519	贵州茅台	1,700	2, 922, 300. 00	2.69
9	002415	海康威视	66, 100	2, 710, 100. 00	2. 50
10	600486	扬农化工	21, 900	2, 644, 206. 00	2. 44

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

# 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	_	-
2	央行票据	_	_
3	金融债券	_	_
	其中: 政策性金融债	_	-
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)	6, 743, 998. 09	6. 21
8	同业存单	_	-
9	其他	_	_
10	合计	6, 743, 998. 09	6. 21

# 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)
1	128021	兄弟转债	9, 030	1, 096, 798. 89	1.01
2	113605	大参转债	9, 920	1, 067, 012. 32	0. 98
3	113516	苏农转债	7, 130	840, 239. 25	0.77
4	127032	苏行转债	7, 440	831, 570. 12	0.77
5	128048	张行转债	6, 790	828, 381. 86	0. 76

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

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

# 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本集合计划本报告期末未持有贵金属。

# 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细本集合计划本报告期末未持有权证。

- 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
- 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末未持有股指期货持仓。

#### 5.9.2 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。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本集合计划投资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。

#### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末未持有国债期货持仓。

#### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本集合计划本报告期末未持有国债期货持仓。

### 5.11 投资组合报告附注

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

本集合计划投资的前十名证券的发行主体本报告期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制目前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本集合计划投资的前十名股票未超出集合计划合同规定的备选股票库。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	31, 886. 11
2	应收证券清算款	_
3	应收股利	_
4	应收利息	_
5	应收申购款	_
6	其他应收款	-
7	其他	_
8	合计	31, 886. 11

# 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128021	兄弟转债	1, 096, 798. 89	1.01
2	113605	大参转债	1, 067, 012. 32	0. 98
3	113516	苏农转债	840, 239. 25	0. 77
4	127032	苏行转债	831, 570. 12	0. 77
5	128048	张行转债	828, 381. 86	0. 76
6	110043	无锡转债	795, 433. 93	0. 73
7	110081	闻泰转债	730, 985. 43	0. 67
8	110079	杭银转债	553, 576. 29	0. 51

## 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

# 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

# §6开放式基金份额变动

单位: 份

项目	光大阳光优选一年	光大阳光优选	光大阳光优选
· 坝 曰	持有混合 A	一年持有混合 B	一年持有混合 C
报告期期初基金份额总额	46, 163, 213. 53	20, 756. 30	24, 076. 48
报告期期间基金总申购份额	_	69. 59	11. 09
减:报告期期间基金总赎回份额	420, 858. 67	1, 006. 86	5, 218. 28
报告期期间基金拆分变动份额(份额减	_	_	
少以"-"填列)			
报告期期末基金份额总额	45, 742, 354. 86	19, 819. 03	18, 869. 29

# §7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内集合计划管理人未持有本集合计划份额。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内集合计划管理人未新增固有资金投资本集合计划。

# §8影响投资者决策的其他重要信息

#### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

#### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

- 1) 2022 年 1 月 4 日,关于旗下参公集合资产管理计划增加上海万得基金销售有限公司为代理销售机构并开通定期定额投资业务的公告。
- 2) 2022年2月8日,关于旗下参公集合资产管理计划增加上海好买基金销售有限公司为代理销售机构并开通定期定额投资业务的公告。

# §9 备查文件目录

#### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予《光大阳光优选一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》变更 批复的文件;
  - 2、《光大阳光优选一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》:
  - 3、《光大阳光优选一年持有期混合型集合资产管理计划托管协议》:
  - 4、《光大阳光优选一年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

#### 9.2 存放地点

备查文件存放于集合计划管理人的办公场所:

1、中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号3号楼26层

#### 9.3 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04月22日