

光大阳光现金宝货币型集合资产管理计划 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 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：中国证券登记结算有限责任公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

集合计划托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本集合计划合同规定，于 2022 年 08 月 30 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 10 日起至 2022 年 06 月 30 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.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
4.8 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.....	10
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
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.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 债券回购融资情况.....	38
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	38
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39

7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	40
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离	40
7.8 期末按实际利率计算的账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资 明细.....	41
7.9 投资组合报告附注.....	41
§8 基金份额持有人信息.....	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
8.4 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	42
§9 开放式基金份额变动.....	42
§10 重大事件揭示.....	43
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
10.2 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	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	43
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	44
10.9 其他重大事件.....	44
§11 影响投资者决策的其他重要信息	44
11.1 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	44
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	45
§12 备查文件目录.....	45
12.1 备查文件目录.....	45
12.2 存放地点.....	45
12.3 查阅方式.....	45

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	光大阳光现金宝货币型集合资产管理计划
基金简称	光大阳光现金宝货币
基金主代码	863001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 1 月 10 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	中国证券登记结算有限责任公司
报告期末基金份额总额	17,105,938,993.25 份
基金合同存续期	3 年

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

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资组合风险，保持流动性的前提下，力争为投资人提供稳定的收益。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本集合计划通过对国内市场资金供求、利率水平、通货膨胀率、GDP 增长率、就业率水平以及国际市场利率水平等宏观经济指标的跟踪和分析，形成对宏观层面的判研。同时，结合对央行公开市场操作、债券供给等情况，对短期利率走势进行综合判断。基于对货币市场利率趋势变化的合理预测，决定并动态调整投资组合平均剩余期限和比例分布。</p> <p>2、期限配置策略</p> <p>根据对短期利率走势的判断确定并调整组合的平均期限。在预期短期利率上升时，缩短组合的平均期限，以规避资本损失或获得较高的再投资收益；在预期短期利率下降时，延长组合的平均期限，以获得资本利得或锁定较高的利率水平。</p> <p>3、回购策略</p> <p>在有效控制风险的前提下，本集合计划将密切跟踪不同市场和不同期限之间的利率差异，在精确投资收益测算的基础上，积极采取回购杠杆操作，为集合计划资产增加收益。</p> <p>4、个券选择策略</p> <p>在个券选择层面，首先从安全性角度出发，优先选择央票、短期国债等债券品种以规避信用违约风险。</p> <p>5、交易策略</p> <p>（1）收益率曲线分析；（2）套利策略；（3）波动性交易策略</p> <p>6、流动性管理策略</p> <p>根据对市场资金面分析以及对申购、赎回变化的动态预测，通过现金管理、回购的滚动操作和债券品种的期限结构搭配，动态调整并</p>

	有效分配基金的现金流，在保持本集合计划资产充分流动性的基础上，确保稳定收益。
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。
风险收益特征	本集合计划是一只货币市场型集合计划，其预期风险和预期收益低于债券型基金、债券型集合计划、混合型基金、混合型集合计划、股票型基金、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	中国证券登记结算有限责任公司
信息披露 负责人	姓名	朱轶	陈晨
	联系电话	021-32068300	010-50938723
	电子邮箱	zhuyi1@ebcn.com	zctg@chinaclear.com.cn
客户服务电话		95525	4008-058-058
传真		021-32068585	-
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层	北京市西城区太平桥大街 17 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	北京市西城区锦什坊街 26 号
邮政编码		200127	100033
法定代表人		熊国兵	于文强

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ebcsn-am.com
基金中期报告备置地点	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
注册登记机构	中国证券登记结算有限公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2022 年 1 月 10 日(基金合同生效日) - 2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	94,803,491.03
本期利润	94,803,491.03
本期净值收益率	0.6648%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末基金资产净值	17,105,938,993.25
期末基金份额净值	1.0000

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)
累计净值收益率	0.6648%

注：1、表中的“期末”均指报告期最后一日，即 2022 年 06 月 30 日；“本期”指 2022 年 01 月 10 日（集合计划合同生效日）-2022 年 06 月 30 日。

2、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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3、本集合计划利润分配是按月结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

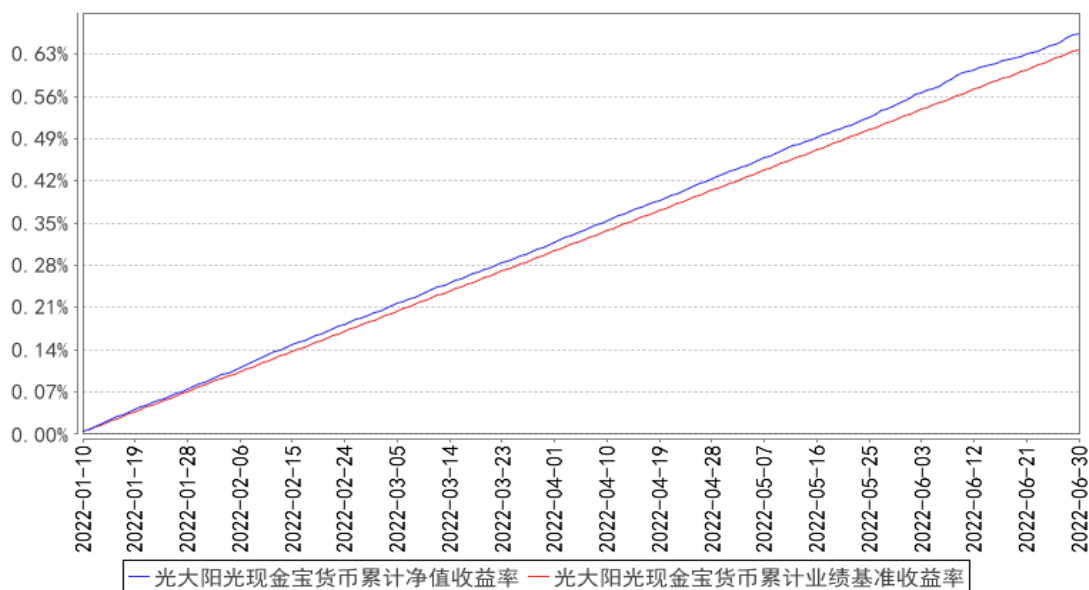
阶段	份额净值收 益率①	份额净值收 益率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.1125%	0.0012%	0.1110%	0.0000%	0.0015%	0.0012%
过去三个月	0.3497%	0.0008%	0.3371%	0.0000%	0.0126%	0.0008%
自基金合同生效起 至今	0.6648%	0.0006%	0.6382%	0.0000%	0.0266%	0.0006%

注：1、自基金合同生效日起至今指 2022 年 1 月 10 日至 2022 年 6 月 30 日；

2、本集合计划的业绩比较基准为同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。

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

光大阳光现金宝货币累计净值收益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2022年6月末，本公司共管理15只参照开放式证券投资基金管理的集合计划，公司在投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

樊亚筠	固定收益公募投资部投资经理、本集合计划投资经理	2022 年 1 月 10 日	-	8 年	樊亚筠女士，硕士学历，曾在富国资产管理有限公司投资部及富国基金管理有限公司固定收益部担任投资经理助理、投资经理。2018 年加入光证资管，现担任固定收益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；

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本集合计划本报告期末投资经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 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

报告期内，本产品秉承稳健投资原则谨慎操作，根据市场情况灵活调整组合资产分布、杠杆比率和剩余期限，严控组合流动性风险、利率风险和信用风险，并根据货币市场收益率走势变化，适度调整投资策略，较好的把握跨季资产配置机会，组合整体运行状况良好。三月末由于疫情抬

头，海外债市弱势拖累，本账户拉长久期，后续货币再现超宽松态势，1Y 以内各品种债券下行空间打开，5 月随着疫情逐渐修复，账户锁定了部分资本利得。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本集合计划本报告期份额净值收益率为 0.6648%，同期业绩比较基准收益率为 0.6382%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，三季度是财政政策发力期，货币政策将保驾护航。7 月政治局会议淡化具体增速，那么财政和货币大概率不会有超强刺激。下半年仍需观察地产、出口和财政政策等边际变化因素对债市的影响。稳增长大背景下，货币预计维持宽松，货币市场利率将维持低位。经济恢复的过程中超低利率不可持续，因此资金利率的抬升造成的阶段性利率走高或是下半年货币类产品配置的机遇。

未来将增强对市场短期波动的敏感性，加强高等级债券波段操作和对资金面的判断来为账户增厚收益。

4.6 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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规及《光大阳光现金宝货币型集合资产管理计划资产管理合同》，本集合计划每日将已实现收益全额分配给基金份额持有人。

4.8 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，本托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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、基金合同和托管协议的有关规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了监督和复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了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、投资组合报告等内容，认为其内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：光大阳光现金宝货币型集合资产管理计划

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	1,001,843,872.55
结算备付金		17,595,589.99
存出保证金		72,710.19
交易性金融资产	6.4.7.2	12,776,427,019.06
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		12,776,427,019.06
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	3,646,961,721.82
债权投资	6.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-

其他投资		-
其他债权投资	6.4.7.6	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-
应收清算款		95,554.78
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		17,442,996,468.39
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		310,036,284.93
应付清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		12,722,075.95
应付托管费		706,781.99
应付销售服务费		7,255,258.60
应付投资顾问费		-
应交税费		774,784.20
应付利润		5,174,189.90
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	388,099.57
负债合计		337,057,475.14
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	17,105,938,993.25
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	-
净资产合计		17,105,938,993.25
负债和净资产总计		17,442,996,468.39

注：1、报告截止日 2022 年 6 月 30 日，集合计划份额总额 17,105,938,993.25 份，集合计划份额净值 1.0000 元。

2、本集合计划合同生效日为 2022 年 1 月 10 日，本财务报表的实际编制期间为 2022 年 1 月 10 日（集合计划合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日，无上年度末对比数据。

6.2 利润表

会计主体：光大阳光现金宝货币型集合资产管理计划

本报告期：2022 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 10 日（基金合同 生效日）至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		183,294,825.56
1. 利息收入		33,304,813.30
其中：存款利息收入	6.4.7.13	23,447,879.42
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		9,856,933.88
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		149,990,012.26
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	149,990,012.26
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	-
以摊余成本计量的金融资产 终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号 填列）	6.4.7.20	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-
减：二、营业总支出		88,491,334.53
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	60,682,415.80
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,371,245.33
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	16,856,226.52
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-
5. 利息支出		7,010,203.40
其中：卖出回购金融资产支出		7,010,203.40
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		437,500.54
8. 其他费用	6.4.7.23	133,742.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号 填列）		94,803,491.03
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		94,803,491.03
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		94,803,491.03

注：本集合计划合同生效日为 2022 年 1 月 10 日，截至报告期末本集合计划合同生效未满一年，

本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：光大阳光现金宝货币型集合资产管理计划

本报告期：2022 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	11,495,242,546.34	-	-	11,495,242,546.34
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	11,495,242,546.34	-	-	11,495,242,546.34
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	5,610,696,446.91	-	-	5,610,696,446.91
(一)、综合收益总额	-	-	94,803,491.03	94,803,491.03
(二)、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)	5,610,696,446.91	-	-	5,610,696,446.91

其中:1. 基金申购款	161,982,847,693.11	-	-	161,982,847,693.11
2. 基金赎回款	-156,372,151,246.20	-	-	-156,372,151,246.20
(三)、 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)	-	-	-94,803,491.03	-94,803,491.03
(四)、 其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	17,105,938,993.25	-	-	17,105,938,993.25

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

汪沛

詹朋

杨薇

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

光大阳光现金宝货币型集合资产管理计划是由光大阳光现金宝集合资产管理计划转型而来。本集合计划的管理人上海光大证券资产管理有限公司于 2021 年 12 月 9 日发布《关于光大阳光现金宝集合资产管理计划合同变更的公告》。根据公告，光大阳光现金宝集合资产管理计划名称变更为“光大阳光现金宝货币型集合资产管理计划”，光大阳光现金宝集合资产管理计划份额转换为光

大阳光现金宝货币型集合资产管理计划份额。合同变更后，本集合计划的托管人、登记机构不变。自 2022 年 1 月 10 日起《光大阳光现金宝货币型集合资产管理计划资产管理合同》、《光大阳光现金宝货币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日起存续期不得超过 3 年。本集合计划管理人为上海光大证券资产管理有限公司，托管人为中国证券登记结算有限责任公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《光大阳光现金宝货币型集合资产管理计划资产管理合同》的有关规定，本集合计划投资于以下金融工具：

- 1、现金；
- 2、期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、中央银行票据、同业存单；
- 3、期限在 1 个月以内的债券回购；
- 4、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的国债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、超短期融资券；
- 5、中国证监会认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

本集合计划投资于前款第 4 项的，其中企业债、公司债、短期融资券、中期票据的主体信用评级和债项信用评级均应当为最高级，无债项评级参照主体评级；超短期融资券的主体信用评级应当为最高级。信用评级主要参照最近一个会计年度的信用评级，发行人同时有两家以上境内评级机构评级的，按照孰低原则确定评级。

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。

本集合计划的业绩比较基准为：同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 10 日（基金合同生效日）起至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 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。

6.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2022 年 1 月 10 日（集合计划合同生效日）起至 2022 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本集合计划记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本集合计划的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本集合计划的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

本集合计划的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、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本集合计划于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，在初始确认时以公允价值计量；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本集合计划以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本集合计划运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本集合计划在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本集合计划按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本集合计划按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本集合计划按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本集合计划在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本集合计划以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本集合计划计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本集合计划不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本集合计划直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本集合计划已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

本集合计划采用影子定价和偏离度控制确定金融资产的公允价值，即按实际利率法计算金融资产的账面价值，同时为了避免按实际利率法计算的集合计划资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的集合计划资产净值发生重大偏离，从而对集合计划份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，本集合计划的管理人于每一估值日，采用其他可参考公允价值指标，对集合计划持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当按实际利率法计算确定的集合计划资产净值与影子定价确定的集合计划资产净值产生重大偏离，本集合计划的管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使集合计划资产净值更能公允地反映集合计划资产价值。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本集合计划具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本集合计划计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的集合计划份额总额所对应的金额。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确认。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。

6.4.4.8 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集合计划份额

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集合计划净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占集合计划净值比例计算的金额。损益平准金于集合计划申购确认日或集合计划赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

1、存款利息收入按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

2、债券投资和资产支持证券投资按实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，在债券投资和资产支持证券投资的实际持有期内逐日计提；处置债券投资和资产支持证券投资的收益于成交日确认，并按成交金额与其账面价值的差额入账；

3、买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

4、其他收入在本集合计划履行了集合计划合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本集合计划接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本集合计划每份集合计划份额享有同等分配权；

2、本集合计划收益分配方式为红利再投资；

3、当日申购的集合计划份额自下一个工作日起，享有本集合计划的收益分配权益；当日赎回的集合计划份额自下一个工作日起，不享有本集合计划的收益分配权益；

4、“每日计提，按月支付”。本集合计划采用 1.00 元固定份额净值交易方式，自资产管理合同生效日起，本集合计划根据每日收益情况，以每万份集合计划暂估净收益为基准，为投资人每日计算当日暂估收益，并在分红日根据实际净收益按月集中支付；当分红日实际每万份集合计划净收益和七日年化收益率与暂估值有差异时，管理人向投资者说明造成差异的具体原因；

5、本集合计划根据每日暂估收益情况，将当日暂估收益计入投资人账户，若当日暂估净收益大于零时，为投资人记正收益；若当日暂估净收益小于零时，为投资人记负收益；若当日暂估净

收益等于零时，当日投资人不记收益；

6、收益月度结转时，每月度累计收益支付方式采用红利再投资方式；若每月度累计收益支付时，投资者累计未结转收益为正值，则为份额持有人增加相应的集合计划份额；如投资者累计未结转收益等于零时，份额持有人的份额保持不变。如投资者累计未结转收益为负值，则为份额持有人缩减相应的集合计划份额，遇投资者剩余集合计划份额不足以扣减的情形，管理人将根据内部应急机制保障集合计划平稳运行；

7、投资者赎回集合计划份额时，按本金支付，赎回份额当期对应的收益，于当期月度分红时支付；

8、投资者解约的情形下，按照当期收益分配期间收益率与解约日银行活期存款利率孰低的原则计付收益；

9、在不违反法律法规、资产管理合同的约定以及对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，管理人可调整集合计划收益的分配原则和支付方式，不需召开集合计划份额持有人大会；

10、如需召开集合计划份额持有人大会，为确保集合计划份额持有人的表决权体现其持有的权益，管理人将于召开集合计划份额持有人大会的权益登记日当日统一为集合计划份额持有人进行累计未结转收益的结转；

11、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

6.4.4.12 分部报告

无。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本集合计划本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本集合计划本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

集合计划目前比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款，

主要税项列示如下：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[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《关于集合计划增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于集合计划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) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，本集合计划运营过程中发生的增值税应税行为，以本集合计划的管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，集合计划管理人运营集合计划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。对集合计划在 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，已纳税额从集合计划管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

(2) 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规

定，对证券投资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，股权的股息、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) 个人所得税

对集合计划取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向集合计划支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(4) 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	1,001,843,872.55
等于：本金	1,000,413,713.72
加：应计利息	1,430,158.83
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,001,843,872.55

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日				
	按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)	
债券	交易所市场	92,725,466.72	92,845,019.18	119,552.46	0.0007
	银行间市场	12,683,701,552.34	12,690,866,783.52	7,165,231.18	0.0419
	合计	12,776,427,019.06	12,783,711,802.70	7,284,783.64	0.0426

资产支持证券	-	-	-	-
合计	12,776,427,019.06	12,783,711,802.70	7,284,783.64	0.0426

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本集合计划本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本集合计划本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本集合计划本报告期末未持有黄金衍生品

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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 2022年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,600,323,082.56	-
银行间市场	2,046,638,639.26	-
合计	3,646,961,721.82	-

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本集合计划本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本集合计划本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本集合计划本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本集合计划本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本集合计划本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本集合计划本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本集合计划本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30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	-
应付交易费用	256,069.03
其中：交易所市场	1,563.15
银行间市场	254,505.88
应付利息	-
预提费用	132,030.54
合计	388,099.57

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月10日（基金合同生效日）至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	11,495,242,546.34	11,495,242,546.34
本期申购	161,982,847,693.11	161,982,847,693.11
本期赎回（以“-”号填列）	-156,372,151,246.20	-156,372,151,246.20
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	17,105,938,993.25	17,105,938,993.25

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本集合计划本报告期内无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	94,803,491.03	-	94,803,491.03
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-94,803,491.03	-	-94,803,491.03
本期末	-	-	-

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月10日（基金合同生效日）至2022年6月30日
活期存款利息收入	20,426,323.13
定期存款利息收入	2,875,806.26
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	145,442.93
其他	307.10
合计	23,447,879.42

注：其他为交易所结算保证金、直销申购款利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

本集合计划本报告期无股票投资收益。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月10日（基金合同生效日）至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	141,231,171.02
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	8,758,841.24
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	149,990,012.26

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月10日（基金合同生效日）至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总	26,544,106,756.00

额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	26,184,671,175.06
减：应计利息总额	350,676,739.70
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	8,758,841.24

6.4.7.15.3 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。

6.4.7.15.4 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。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本集合计划本报告期无资产支持证券投资。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本集合计划本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期无资产支持证券赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期无资产支持证券申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本集合计划在本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本集合计划在本报告期无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本集合计划在本报告期无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本集合计划在本报告期无贵金属申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 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。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本集合计划本报告期无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

本集合计划本报告期无股利收益。

6.4.7.20 公允价值变动收益

本集合计划本报告期无公允价值变动收益。

6.4.7.21 其他收入

本集合计划本报告期无其他收入。

6.4.7.22 信用减值损失

本集合计划本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	28,273.36
信息披露费	57,977.76
证券出借违约金	-
银行费用	29,116.82
账户维护费	18,075.00
其他	300.00
合计	133,742.94

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期本集合计划存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

上海光大证券资产管理有限公司(“光证资管”)	集合计划管理人、集合计划销售机构
中国证券登记结算有限责任公司	集合计划托管人
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	集合计划代销机构、集合计划管理人的股东

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本集合计划本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月10日(基金合同生效日)至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例(%)
光大证券	170,739,500.00	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月10日(基金合同生效日)至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例(%)
光大证券	31,314,237,000.00	100.00

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月10日(基金合同生效日)至2022年6月30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	3,311.02	100.00	1,563.15	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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	60,682,415.80
其中：支付销售机构的客户维护费	29,429,174.78

注：1、本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.9%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.9\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日的集合计划资产净值

当以 0.90%的管理费计算的七日化暂估收益率小于或等于 2 倍活期存款利率，管理人将调整管理费为 0.25%，以降低每万份集合计划暂估净收益为负并引发销售机构交收透支的风险，直至该类风险消除，管理人方可恢复计提 0.90%的管理费。

集合计划管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,371,245.33

注：本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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提，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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期
	2022 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至

	2022 年 6 月 30 日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
	光大阳光现金宝货币	
光大证券	16,777,491.98	
合计	16,777,491.98	

注：本集合计划的销售服务费按前一日集合计划资产净值的 0.25% 的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日的集合计划资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本集合计划本期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期管理人未运用固有资金投资本集合计划。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)
光大证券股份有限公司	226,237.37	0.0013

6.4.10.5 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 2022 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国证券登记结算有限责任公司	425,133.13	4,502,439.15

注：本集合计划的银行存款由托管人中国证券登记结算有限责任公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本集合计划本报告期没有需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合计	备注
89,554,221.11	75,080.02	5,174,189.90	94,803,491.03	-

6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本集合计划本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 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的暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本集合计划从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 310,036,284.93 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单 价	数量（张）	期末估值总额
112103141	21 农业银 行 CD141	2022 年 7 月 1 日	99.21	1,000,000	99,205,021.26
210407	21 农发 07	2022 年 7 月 1 日	101.88	315,000	32,093,147.95
220201	22 国开 01	2022 年 7 月 1 日	100.97	500,000	50,483,285.97
2203672	22 进出 672	2022 年 7 月 1 日	99.89	500,000	49,946,991.88
229917	22 贴现国 债 17	2022 年 7 月 1 日	99.34	1,000,000	99,342,479.55
合计				3,315,000	331,070,926.61

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本集合计划从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者集合计划所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。

本集合计划的银行存款存放在本集合计划的托管行中国证券登记结算有限责任公司，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。

6.4.13.2.1 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 2022年6月30日
A-1	143,523,772.85
A-1 以下	-
未评级	7,612,435,301.00
合计	7,755,959,073.85

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。

6.4.13.2.2 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。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	2,970,510,510.19
合计	2,970,510,510.19

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。

6.4.13.2.4 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 2022年6月30日
AAA	2,049,957,435.02
AAA 以下	-
未评级	-
合计	2,049,957,435.02

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。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本集合计划所持有的的证券大部分具有良好的流动性，部分证券流通暂时受限的情况参见附注 6.4.12“期末(2022 年 6 月 30 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
银行存款	1,001,843,872.55	-	-	-	1,001,843,872.55

结算备付金	17,595,589.99	-	-	-	17,595,589.99
存出保证金	72,710.19	-	-	-	72,710.19
交易性金融资产	9,708,388,745.81	3,068,038,273.25	-	-	12,776,427,019.06
买入返售金融资产	3,646,961,721.82	-	-	-	3,646,961,721.82
应收清算款	-	-	-	95,554.78	95,554.78
资产总计	14,374,862,640.36	3,068,038,273.25	-	95,554.78	17,442,996,468.39
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	12,722,075.95	12,722,075.95
应付托管费	-	-	-	706,781.99	706,781.99
卖出回购金融资产款	310,036,284.93	-	-	-	310,036,284.93
应付销售服务费	-	-	-	7,255,258.60	7,255,258.60
应付利润	-	-	-	5,174,189.90	5,174,189.90
应交税费	-	-	-	774,784.20	774,784.20
其他负债	-	-	-	388,099.57	388,099.57
负债总计	310,036,284.93	-	-	27,021,190.21	337,057,475.14
利率敏感度缺口	14,064,826,355.43	3,068,038,273.25	-	-26,925,635.43	17,105,938,993.25

6.4.13.4.1.2 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（2022年6月30日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-11,288,211.19
	市场利率下降 25 个基点	11,288,211.19

6.4.13.4.2 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，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本集合计划本报告期末无其他价格风险敞口。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本集合计划本报告期末无其他价格风险敞口。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本集合计划本报告期末采用风险价值法管理风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日
第一层次	-
第二层次	12,776,427,019.06
第三层次	-
合计	12,776,427,019.06

6.4.14.2.2 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。本集合计划本报告期持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本集合计划本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本集合计划持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负

债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	固定收益投资	12,776,427,019.06	73.25
	其中：债券	12,776,427,019.06	73.25
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	3,646,961,721.82	20.91
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备 付金合计	1,019,439,462.54	5.84
4	其他各项资产	168,264.97	0.00
5	合计	17,442,996,468.39	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	5.96	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值 的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	310,036,284.93	1.81
	其中：买断式回购融资	-	-

注：上表中报告期内债券回购融资余额占集合计划资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占集合计划资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本报告期内本集合计划债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	96
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	105
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	69

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本集合计划投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	32.18	1.81
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	13.74	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	10.52	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	10.11	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	34.79	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	101.34	1.81

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本集合计划投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

7.5 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	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	99,342,479.55	0.58
2	央行票据	-	-
3	金融债券	151,371,782.53	0.88
	其中：政策性金融债	151,371,782.53	0.88
4	企业债券	103,208,991.23	0.60
5	企业短期融资券	7,505,244,811.77	43.88
6	中期票据	1,946,748,443.79	11.38
7	同业存单	2,970,510,510.19	17.37
8	其他	-	-
9	合计	12,776,427,019.06	74.69
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

	券		
--	---	--	--

7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	按实际利率计算的账面价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112220094	22 广发银行 CD094	3,000,000	297,739,633.11	1.74
2	012280827	22 临港经济 SCP002	2,000,000	201,417,093.42	1.18
3	012281725	22 粤铁建 SCP002	2,000,000	200,174,374.72	1.17
4	112108160	21 中信银行 CD160	2,000,000	198,632,619.78	1.16
5	112292259	22 南京银行 CD027	2,000,000	198,559,673.13	1.16
6	112220121	22 广发银行 CD121	2,000,000	195,673,747.67	1.14
7	101756028	17 河钢集 MTN012	1,500,000	157,653,645.84	0.92
8	012280668	22 太原钢铁 SCP001	1,500,000	151,252,067.16	0.88
9	012280504	22 陕煤化 SCP002	1,500,000	151,215,358.40	0.88
10	012280931	22 广州工控 SCP001	1,500,000	150,875,179.42	0.88

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1112%
报告期内偏离度的最低值	-0.0089%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0442%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本集合计划本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本集合计划本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

7.8 期末按实际利率计算的账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本集合计划本期末未持有资产支持证券投资。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本集合计划采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按实际利率或商定利率每日计提利息，并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

7.9.2 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“22 广发银行 CD094”、“22 广发银行 CD121”，发行主体因违规经营，于 2022 年 3 月 21 日被银保监会处罚，罚款 420 万元；
- 2) 本集合计划持有的“22 临港经济 SCP002”，发行主体因未依法履行职责，于 2022 年 1 月 24 日被国家税务总局上海市浦东新区临港税务局第三税务所处罚；
- 3) 本集合计划持有的“21 中信银行 CD160”，发行主体因违规提供担保及财务资助，于 2022 年 3 月 21 日被银保监会处罚 290 万元；发行主体因未依法履行职责，于 2021 年 11 月 20 日被国家市场监督管理总局处罚 50 万元。
- 4) 本集合计划持有的“22 南京银行 CD027”发行主体因价格垄断，于 2021 年 7 月 7 日被国家市场监督管理总局处罚 50 万元；
- 5) 本集合计划持有的“22 太原钢铁 SCP001”发行主体因涉嫌违反法律法规，于 2022 年 2 月 18 日被太原市规划和自然资源局罚款；

该类情形对上市公司的经营和财务没有重大影响，该证券的投资决策程序符合相关法律法规以及产品合同的要求。

7.9.3 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	72,710.19
2	应收清算款	95,554.78
3	应收利息	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-

7	其他	-
8	合计	168,264.97

7.9.4 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
175,322	97,568.70	1,063,622,800.70	6.22	16,042,316,192.55	93.78

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	个人	291,532,866.26	1.70
2	其他机构	178,610,609.10	1.04
3	其他机构	140,017,733.31	0.82
4	其他机构	128,531,555.41	0.75
5	基金类机构	104,024,920.13	0.61
6	基金类机构	59,905,617.21	0.35
7	其他机构	57,249,228.90	0.33
8	基金类机构	55,628,016.89	0.33
9	个人	40,346,379.35	0.24
10	个人	39,219,027.88	0.23

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	10,423.47	0.0001

8.4 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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2022年1月10日）	11,495,242,546.34
---------------------	-------------------

基金份额总额	
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	161,982,847,693.11
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	156,372,151,246.20
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	17,105,938,993.25

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本集合计划管理人、托管人均无重大人事变动。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本集合计划本报告期未改聘会计师事务所。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	-	-	3,311.02	100.00	-

注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票而合计支付该券商的佣金合计。

2、交易单元的选择标准和程序

(1) 选择标准

券商财务状况良好、经营行为规范，最近一年无重大违规行为；具有较强的研究服务能力；交易佣金收费合理。

(2) 选择程序

集合计划管理人根据以上标准对不同券商进行综合评价，然后根据评价选择券商，与其签订协议租用交易单元。

3、本报告期内无新增券商交易单元。

10.7.2 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	170,739,500.00	100.00	31,314,237,000.00	100.00	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本集合计划本报告期内不存在偏离度的绝对值超过 0.5%的情况。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	光大阳光现金宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会规定的媒介	2022 年 01 月 26 日
2	光大阳光现金宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会规定的媒介	2022 年 02 月 25 日
3	光大阳光现金宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会规定的媒介	2022 年 03 月 25 日
4	光大阳光现金宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会规定的媒介	2022 年 04 月 27 日
5	光大阳光现金宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会规定的媒介	2022 年 05 月 25 日
6	光大阳光现金宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会规定的媒介	2022 年 06 月 27 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予《光大阳光现金宝货币型集合资产管理计划资产管理合同》变更批复的文件；
- 2、《光大阳光现金宝货币型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《光大阳光现金宝货币型集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《光大阳光现金宝货币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。

12.2 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

12.3 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 8 月 31 日