

光大阳光价值 30 个月持有期混合型集合资产 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：中国光大银行股份有限公司

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光大银行股份有限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 01 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	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
7.3 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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57

7.6 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	57
7.7 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	57
7.8 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	57
7.9 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	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12 投资组合报告附注	57
§ 8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
8.3 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	59
§ 9 开放式基金份额变动	60
§ 10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8 其他重大事件	61
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§ 12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	光大阳光价值 30 个月持有期混合型集合资产管理计划	
基金简称	光大阳光价值 30 个月持有混合	
基金主代码	860007	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 4 月 17 日	
基金管理人	上海光大证券资产管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	238,683,190.10 份	
基金合同存续期	3 年	
下属分级基金的基金简称	光大阳光价值 30 个月持有混合 A	光大阳光价值 30 个月持有混合 B
下属分级基金的交易代码	860007	860027
报告期末下属分级基金的份额总额	32,372,930.73 份	206,310,259.37 份

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

2.2 基金产品说明

投资目标	在深入研究、控制和分散投资组合风险的前提下，实现集合计划资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>（一）资产配置策略</p> <p>本集合计划通过定性与定量研究相结合的方法，确定投资组合中权益类资产和固定收益类资产的配置比例。本集合计划通过动态跟踪海内外主要经济体的 GDP、CPI、利率等宏观经济指标，以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等市场指标，确定未来市场变动趋势。本集合计划通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势，对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。根据上述定性和定量指标的分析结果，运用资产配置优化模型，在目标收益条件下，追求风险最小化目标，最终确定大类资产投资权重，实现资产合理配置。</p> <p>（二）权益类品种的投资策略</p> <p>1、行业配置策略</p> <p>本集合计划重点投资于一些符合转型期中国经济发展趋势的行业或子行业，如由人口老龄化驱动的医疗行业、具有品牌优势的消费品行业、可以替代人工的自动化行业等。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>包括（1）一级市场申购策略；（2）二级市场股票投资策略；（3）港股通股票投资策略（4）参与定向增发投资策略。</p> <p>（三）固定收益类品种投资策略</p>

	<p>在债券投资方面，本集合计划可投资于国债、金融债、企业债和可转换债券等债券品种。本计划将根据对利率走势的预测、债券等级、债券的期限结构、风险结构、不同品种流动性的高低等因素，构造债券组合。</p> <p>（四）资产支持证券投资策略</p> <p>本集合计划将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。</p> <p>（五）衍生品投资策略</p> <p>1、股指期货投资策略</p> <p>管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本集合计划的投资目标。本集合计划在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。</p> <p>2、国债期货的投资策略</p> <p>本集合计划投资国债期货以套期保值为目的，国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。管理人通过动态管理国债期货合约数量，以获取相应债券组合的超额收益。</p>
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×40%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×40%+中债综合指数收益率×20%。
风险收益特征	<p>本集合计划为混合型集合计划，其预期风险和预期收益高于债券型基金、债券型集合计划、货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于股票型基金和股票型集合计划。</p> <p>本集合计划除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内集合计划类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本集合计划还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海光大证券资产管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	朱轶	石立平
	联系电话	021-32068300	010-63639180
	电子邮箱	zhuyi1@ebscn.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		95525	95595
传真		021-32068585	010-63639132
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码		200127	100033
法定代表人		熊国兵	李晓鹏

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ebscn-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01月01日-2022年06月30日)		
	光大阳光价值 30 个月持有混合 A	光大阳光价值 30 个月持有混合 B	
本期已实现收益	-2,570,952.30	-8,574,215.37	
本期利润	-8,474,829.98	-27,504,440.54	
加权平均基金份额本期利润	-0.2583	-0.1333	
本期加权平均净值利润率	-12.03%	-11.40%	
本期基金份额净值增长率	-10.06%	-9.97%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)		
	期末可供分配利润	39,105,329.11	42,103,532.92
	期末可供分配基金份额利润	1.2080	0.2041
	期末基金资产净值	71,478,259.84	248,413,792.29
	期末基金份额净值	2.2080	1.2041
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)		
	基金份额累计净值增长率	20.40%	20.41%

注：1、表中的“期末”均指报告期最后一日，即 2022 年 6 月 30 日；“本期”指 2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日。

2、上述集合计划业绩指标不包括持有人认购或交易集合计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、本期已实现收益指集合计划本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用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。

4、期末可供分配利润，采用期末未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

光大阳光价值 30 个月持有混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	7.82%	1.48%	4.70%	0.90%	3.12%	0.58%
过去三个月	7.68%	1.68%	4.46%	1.09%	3.22%	0.59%
过去六个月	-10.06%	1.90%	-5.75%	1.27%	-4.31%	0.63%
过去一年	-25.35%	1.64%	-13.87%	1.06%	-11.48%	0.58%
自基金合同生效起至今	20.40%	1.50%	6.66%	0.97%	13.74%	0.53%

光大阳光价值 30 个月持有混合 B

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	7.84%	1.48%	4.70%	0.90%	3.14%	0.58%
过去三个月	7.73%	1.68%	4.46%	1.09%	3.27%	0.59%

过去六个月	-9.97%	1.90%	-5.75%	1.27%	-4.22%	0.63%
过去一年	-25.20%	1.64%	-13.87%	1.06%	-11.33%	0.58%
自基金合同生效起至今	20.41%	1.50%	5.76%	0.97%	14.65%	0.53%

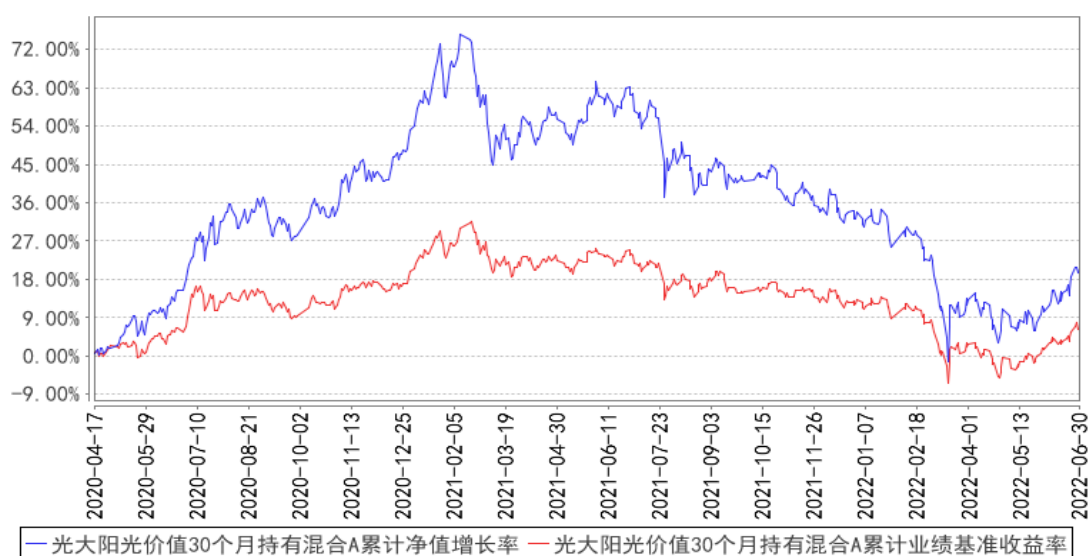
注：1、自基金合同生效日起至至今指 2020 年 4 月 17 日-2022 年 6 月 30 日。

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

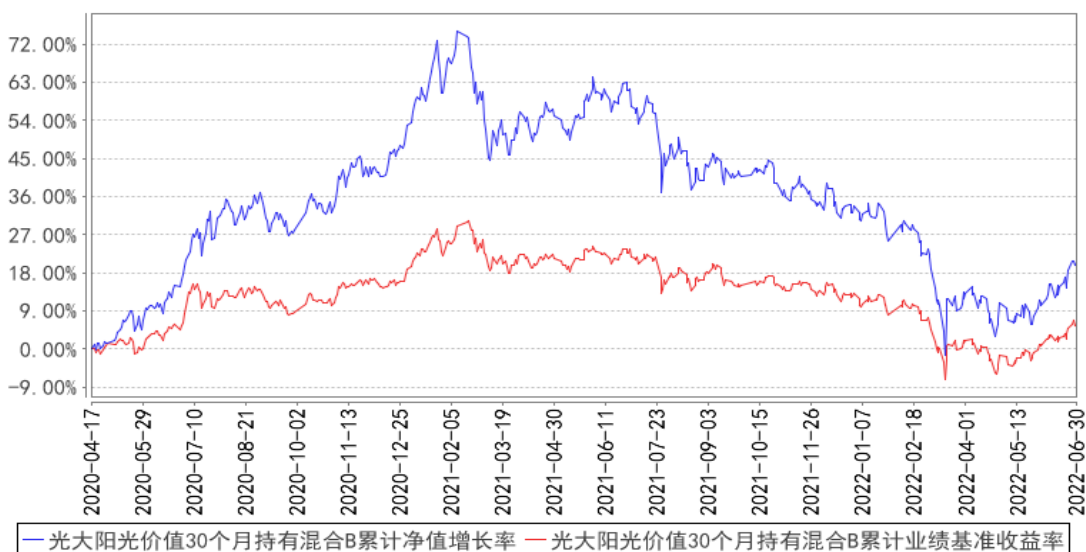
3、B 类份额设立日为 2020 年 4 月 17 日。

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

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



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



3.3 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		
王海涛	权益公募投资部总经理、本集合计划投资经理、光	2020年4月17日	-	16年	王海涛先生，北京师范大学硕士研究生毕业，历任首创

	大阳光生活 18 个月持有期混合型集合资产管理计划投资经理、光大阳光智造混合型集合资产管理计划投资经理、光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划投资经理				证券、华泰证券研究员，太平资管、平安信托高级投资经理，上海人寿保险、华宝证券投资部门总经理，2019 年加入光证资管，现任权益公募投资部总经理。
--	---	--	--	--	--

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的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 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

上半年行情主要反映的是对国内疫情的修复。在 3 月中旬到 4 月中旬，港股市场和 A 股市场分别对国内疫情进行了过度反应。本轮过度的反应，以及其后 5-6 月的大幅反弹，与 2020 年疫情有其相似之处，也有不同之处。本轮反弹的结构性特点更加突出，反弹主要集中在一季度下跌幅

度较大的成长板块，而不像 2020 年是整个市场的大反弹。截止二季度末，反弹幅度和时间都已经比较充分，市场又进入了比较尴尬的阶段。目前的市场与 2021 年底并没有什么不同，仍然是结构分化严重。如果市场没有经历较为充分的调整，就很难指望市场出现较大的行情。目前判断下半年的市场，仍将面临比较大的压力。与调整并不充分的 A 股相比，港股市场的调整无论在时间上，还是幅度上都更为充分，目前我们判断未来一年，港股市场的机会大于 A 股市场。在 A 股市场我们主要配置金融、食品饮料、化工、家电等行业，在港股市场我们主要配置互联网、医药、消费、建材等行业。产品目前主要配置低市盈率，高 ROE 公司，产品目前仍为价值风格。价值风格与成长风格在过去一年半的时间中此消彼长，成长风格明显强于价值风格，但截至 2021 年底，以及 2022 年二季度末两个时点，成长风格都进入了相对困难的阶段。美股与港股成长股的大幅调整，A 股价值股的较大级别低估，以及宏观政策的可能调整，都对 A 股成长股形成了相当大的不确定性，这在未来一年需要密切关注。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日，光大阳光价值 30 个月持有 A 类份额净值为 2.2080 元，本报告期份额净值增长率为-10.06%；光大阳光价值 30 个月持有 B 类份额净值为 1.2041 元，本报告期份额净值增长率为-9.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年下半年市场仍将受宏观事件的影响较大，美国经济面临衰退和滞涨两种可能性，而对于衰退，市场又纠结于是轻度衰退，还是中期衰退。因此美联储货币政策对市场的影响巨大。我国经济虽然仍处于疫情的恢复之中，但是恢复的动能较之 2020 年更为羸弱。同时结构性金融风险的担忧，也不时干扰市场的预期。我们认为在此条件下，A 股市场对于以上宏观事件的预期已经有所反应，自上而下的看待市场，很难期望市场出现整体性的行情。我们对下半年 A 股市场仍然较为谨慎，目前很难找到增长明确，而又低估的方向。对于下半年的港股市场，我们相对乐观，低估值对应的悲观预期，已经在市场价格中充分反应，经历了今年的调整后，无论金融地产、科技，还是消费、医药，港股市场的定价都基本反应了悲观预期。一旦宏观经济的演绎不似市场预期那般悲观，港股市场的估值修复行情会持续演绎至明年。

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

本集合计划报告期内未进行利润分配。

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，中国光大银行股份有限公司在光大阳光价值 30 个月持有期混合型集合资产管理计划（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《光大阳光价值 30 个月持有期混合型集合资产管理计划 2022 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：光大阳光价值 30 个月持有期混合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	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	42,582,019.80	26,304,059.20
结算备付金		5,679.53	60,953.77
存出保证金		26,962.10	18,118.18
交易性金融资产	6.4.7.2	277,645,830.59	333,053,241.60
其中：股票投资		277,645,830.59	333,053,241.60
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
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		1,676,458.68	-
应收股利		1,450,041.47	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	9,207.69
资产总计		323,386,992.17	359,445,580.44
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日

负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,154,995.76	29.54
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		161,536.15	197,594.75
应付托管费		50,111.03	61,174.33
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	801,249.86
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	128,297.10	179,464.82
负债合计		3,494,940.04	1,239,513.30
净 资 产:			
实收基金	6.4.7.10	238,683,190.10	239,830,538.26
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	81,208,862.03	118,375,528.88
净资产合计		319,892,052.13	358,206,067.14
负债和净资产总计		323,386,992.17	359,445,580.44

注：1、报告截止日 2022 年 6 月 30 日，本集合计划份额总额为 238,683,190.10 份，其中光大阳光价值 30 个月持有混合 A 集合计划份额净值（暂估业绩报酬前）2.2080 元，集合计划份额总额 32,372,930.73 份，集合计划资产净值（暂估业绩报酬前）71,478,259.84 元，暂估业绩报酬金额 3,023,225.21 元，集合计划资产净值（暂估业绩报酬后）68,455,034.63 元；光大阳光价值 30 个月持有混合 B 集合计划份额净值（暂估业绩报酬前）1.2041 元，集合计划份额总额 206,310,259.37 份，集合计划资产净值（暂估业绩报酬前）248,413,792.29 元，暂估业绩报酬金额 1,620,925.34 元，集合计划资产净值（暂估业绩报酬后）246,792,866.95 元。实际计提时的业绩报酬金额可能会与此处暂估业绩报酬金额有差异。其中，集合计划资产净值（暂估业绩报酬后）=集合计划资产净值（暂估业绩报酬前）-暂估业绩报酬金额；暂估业绩报酬为假设本集合计划于本报告期末按照当日的集合计划份额净值（计提业绩报酬前）清算，根据集合计划份额持有人持有的集合计划份额（包括未到期份额）至该日止持有期间的收益情况估算的业绩报酬。该金额是各集合计划份额持有人的暂估业绩报酬的合计，各集合计划份额持有人实际应承担的业绩报酬金额根据其持有期间的实际收益情况计算确认。

2、比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目

的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：光大阳光价值 30 个月持有期混合型集合资产管理计划

本报告期：2022 年 1 月 1 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 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-34,599,778.50	26,572,641.00
1. 利息收入		215,979.54	235,385.24
其中：存款利息收入	6.4.7.13	215,979.54	235,385.24
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-9,981,655.19	25,984,387.90
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-17,466,059.04	23,928,523.12
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
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	7,484,403.85	2,055,864.78
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	-24,834,102.85	352,867.86
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		1,379,492.02	3,136,473.68
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,000,831.09	1,407,332.82

2. 托管费	6.4.10.2.2	310,226.64	432,755.54
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	780,580.95
8. 其他费用	6.4.7.23	68,434.29	515,804.37
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-35,979,270.52	23,436,167.32
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-35,979,270.52	23,436,167.32
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-35,979,270.52	23,436,167.32

注：比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：光大阳光价值 30 个月持有期混合型集合资产管理计划

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 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)	239,830,538.26	-	118,375,528.88	358,206,067.14
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净	239,830,538.26	-	118,375,528.88	358,206,067.14

资产(基金净值)				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,147,348.16	-	-37,166,666.85	-38,314,015.01
(一)、综合收益总额	-	-	-35,979,270.52	-35,979,270.52
(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)	-1,147,348.16	-	-1,187,396.33	-2,334,744.49
其中:1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-1,147,348.16	-	-1,187,396.33	-2,334,744.49
(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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-

四、本期期末净资产(基金净值)	238,683,190.10	-	81,208,862.03	319,892,052.13
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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)	248,582,971.20	-	185,404,077.14	433,987,048.34
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)	248,582,971.20	-	185,404,077.14	433,987,048.34
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-6,361,389.72	-	10,703,271.18	4,341,881.46
(一)、综合收益总额	-	-	23,436,167.32	23,436,167.32
(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)	-6,361,389.72	-	-12,732,896.14	-19,094,285.86
其中:1.基金申购款	-	-	-	-

2 · 基金赎回款	-6,361,389.72	-	-12,732,896.14	-19,094,285.86
(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)	-	-	-	-
(四)、 其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	242,221,581.48	-	196,107,348.32	438,328,929.80

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

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

更生效之日起存续期不得超过 3 年。本集合计划的管理人为上海光大证券资产管理有限公司，托管人为中国光大银行股份有限公司。

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

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

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《光大阳光价值 30 个月持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

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、完整地反映了本基金于 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述变更后的会计政策外，本集合计划报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 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，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

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（含交易性金融负债和衍生金融负债），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。

6.4.4.3 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) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 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；

(6) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

其他收入在本履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

6.4.5 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

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法规的要求，本集合计划自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本集合计划考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本集合计划的影响不重大。

本集合计划将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本集合计划计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本集合计划将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 26,304,059.20 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 9,051.17 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 26,313,110.37 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 60,953.77 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 147.20 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 61,100.97 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 18,118.18 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 9.32 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 18,127.50 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 9,207.69 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 9,051.17 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 147.20 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 9.32 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 0.00 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 333,053,241.60 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.00 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 333,053,241.60 元。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本集合计划金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本集合计划本期期初未分配利润的变化。

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

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) 本基金的城市维护建设税、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	42,582,019.80
等于：本金	42,567,984.85
加：应计利息	14,034.95
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	42,582,019.80

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			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	280,486,298.50	-	277,645,830.59	-2,840,467.91
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	280,486,298.50	-	277,645,830.59	-2,840,467.91

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

本集合计划本报告期末未持有买入返售金融资产。

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

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无其他权益工具投资。

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应收款、待摊费用等其他资产。

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	41,862.81
其中：交易所市场	41,862.81
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,434.29
合计	128,297.10

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

光大阳光价值 30 个月持有混合 A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	33,520,278.89	33,520,278.89
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-1,147,348.16	-1,147,348.16
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	32,372,930.73	32,372,930.73

光大阳光价值 30 个月持有混合 B

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	206,310,259.37	206,310,259.37
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	206,310,259.37	206,310,259.37

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本集合计划本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

光大阳光价值 30 个月持有混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	53,400,953.43	-4,633,398.01	48,767,555.42
本期利润	-2,570,952.30	-5,903,877.68	-8,474,829.98
本期基金份额交易产生的变动数	-1,794,286.53	606,890.20	-1,187,396.33
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-1,794,286.53	606,890.20	-1,187,396.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	49,035,714.60	-9,930,385.49	39,105,329.11

光大阳光价值 30 个月持有混合 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	60,424,015.22	9,183,958.24	69,607,973.46
本期利润	-8,574,215.37	-18,930,225.17	-27,504,440.54
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	-	-	-
本期末	51,849,799.85	-9,746,266.93	42,103,532.92

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	212,460.90
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	3,015.28
其他	503.36
合计	215,979.54

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

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
----	----------------------------

股票投资收益——买卖股票差价收入	-17,466,059.04
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	-17,466,059.04

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	86,346,584.60
减：卖出股票成本总额	103,520,825.54
减：交易费用	291,818.10
买卖股票差价收入	-17,466,059.04

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本集合计划本报告期无股票投资收益-证券出借差价收入。

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

本集合计划本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本集合计划本报告期无买卖债券差价收入。

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收益。

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

本集合计划本报告期未进行贵金属投资。

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收益-其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	7,484,403.85
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	7,484,403.85

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-25,575,758.95
股票投资	-25,575,758.95
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-741,656.10
合计	-24,834,102.85

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 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	8,926.92
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	68,434.29

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30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	151,627,822.64	100.00	277,084,051.79	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

本集合计划本报告期无债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本集合计划本报告期无债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本集合计划本报告期无权证交易。

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1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	112,664.18	100.00	41,862.81	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	206,521.58	100.00	73,475.26	100.00

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

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

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1日至2022年6	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,000,831.09	1,407,332.82
其中：支付销售机构的客户维护费	414,898.57	574,819.27

注：1、本集合计划不同类别份额的管理费分别计算，A 类份额固定年管理费率为 0.8%，B 类份额固定年管理费率为 0.6%，本集合计划固定管理费的计算方法如下：

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

G 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日的集合计划资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	310,226.64	432,755.54

注：集合计划托管费按前一日的集合计划资产净值的 0.2% 的年费率计提。计算方法如下：托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值集合计划托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

本集合计划无销售服务费。

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

本集合计划本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本集合计划本报告期无与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本集合计划本报告期无与关联方通过约定申报方式进行适用市场化费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	光大阳光价值 30 个月持有混合 A	光大阳光价值 30 个月持有混合 B
基金合同生效日（2020 年 4 月 17 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	13,594,670.53
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	13,594,670.53
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	5.6957%
项目	上年度可比期间	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
	光大阳光价值 30 个月持有混合 A	光大阳光价值 30 个月持有混合 B
基金合同生效日（2020 年 4 月 17 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	13,594,670.53
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	13,594,670.53
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	5.6125%

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

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

6.4.10.5.2 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

注：本报告期除基金管理人之外的其他关联方未投资本集合计划。

6.4.10.6 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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	42,582,019.80	212,460.90	39,128,418.55	229,251.51

注：本集合计划的银行存款由集合计划托管人中国光大银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本集合计划本报告期没有需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本集合计划本报告期未进行利润分配。

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300834	星辉环材	2022年1月6日	6个月	新股流通受限	55.57	30.03	190	10,558.30	5,705.70	-
301097	天益医疗	2022年3月25日	6个月	新股流通受限	52.37	47.83	115	6,022.55	5,500.45	-
301103	何氏眼科	2022年3月14日	6个月	新股流通受限	42.50	32.02	99	4,207.50	3,169.98	-
301103	何氏眼科	2022年06月01日	1-6个月(含)	送/配股流通受限	0.00	32.02	30	0.00	960.60	-
301116	益客食品	2022年1月10日	6个月	新股流通受限	11.40	20.46	286	3,260.40	5,851.56	-

301130	西点药业	2022 年 2 月 16 日	6 个月	新股流 通受限	22.55	37.70	87	1,961.85	3,279.90	-
301135	瑞德智能	2022 年 4 月 1 日	6 个月	新股流 通受限	31.98	26.26	119	3,805.62	3,124.94	-
301137	哈焊华通	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股流 通受限	15.37	15.99	210	3,227.70	3,357.90	-
301181	标榜股份	2022 年 2 月 11 日	6 个月	新股流 通受限	40.25	30.59	116	4,669.00	3,548.44	-
301196	唯科科技	2022 年 1 月 4 日	6 个月	新股流 通受限	64.08	37.52	109	6,984.72	4,089.68	-
301206	三元生物	2022 年 1 月 26 日	6 个月	新股流 通受限	109.30	45.69	162	17,706.60	7,401.78	-
301206	三元生物	2022 年 06 月 17 日	1-6 个 月(含)	送/配股 流通受限	0.00	45.69	81	0.00	3,700.89	-
301207	华兰疫苗	2022 年 2 月 10 日	6 个月	新股流 通受限	56.88	56.42	70	3,981.60	3,949.40	-
301212	联盛化学	2022 年 4 月 7 日	6 个月	新股流 通受限	29.67	33.28	180	5,340.60	5,990.40	-
301215	中汽股份	2022 年 2 月 28 日	6 个月	新股流 通受限	3.80	6.39	1,459	5,544.20	9,323.01	-
301216	万凯新材	2022 年 3 月 21 日	6 个月	新股流 通受限	35.68	29.84	262	9,348.16	7,818.08	-
301217	铜冠铜箔	2022 年 1 月 20 日	6 个月	新股流 通受限	17.27	14.83	1,078	18,617.06	15,986.74	-
301219	腾远钴业	2022 年 3 月 10 日	6 个月	新股流 通受限	173.98	87.82	48	8,351.04	4,215.36	-
301219	腾远钴业	2022 年 05 月 24 日	1-6 个 月(含)	送/配股 流通受限	0.00	87.82	38	0.00	3,337.16	-
301222	浙江恒威	2022 年 3 月 2 日	6 个月	新股流 通受限	33.98	28.96	128	4,349.44	3,706.88	-
301228	实朴检测	2022 年 1 月 21 日	6 个月	新股流 通受限	20.08	20.34	210	4,216.80	4,271.40	-

301235	华康医疗	2022 年 1 月 21 日	6 个月	新股流 通受限	39.30	37.93	147	5,777.10	5,575.71	-
301237	和顺科技	2022 年 3 月 16 日	6 个月	新股流 通受限	56.69	41.86	86	4,875.34	3,599.96	-
301256	华融化学	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股流 通受限	8.05	10.08	724	5,828.20	7,297.92	-
301258	富士莱	2022 年 3 月 21 日	6 个月	新股流 通受限	48.30	41.68	88	4,250.40	3,667.84	-
301263	泰恩康	2022 年 3 月 22 日	6 个月	新股流 通受限	19.93	31.38	255	5,082.15	8,001.90	-
301268	铭利达	2022 年 3 月 29 日	6 个月	新股流 通受限	28.50	34.87	164	4,674.00	5,718.68	-
301279	金道科技	2022 年 4 月 6 日	6 个月	新股流 通受限	31.20	22.81	144	4,492.80	3,284.64	-
688237	超卓航科	2022 年 6 月 24 日	1 个月 内(含)	新股流 通受限	41.27	41.27	1,229	50,720.83	50,720.83	-
688400	凌云光	2022 年 6 月 27 日	1 个月 内(含)	新股流 通受限	21.93	21.93	3,120	68,421.60	68,421.60	-

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

本集合计划本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本集合计划本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本集合计划本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

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光大银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

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

本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

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	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	42,582,019.80	-	-	-	42,582,019.80
结算备付金	5,679.53	-	-	-	5,679.53
存出保证金	26,962.10	-	-	-	26,962.10
交易性金融资产	-	-	-	-277,645,830.59	277,645,830.59
应收股利	-	-	-	1,450,041.47	1,450,041.47
应收清算款	-	-	-	1,676,458.68	1,676,458.68
资产总计	42,614,661.43	-	-	-280,772,330.74	323,386,992.17
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	161,536.15	161,536.15
应付托管费	-	-	-	50,111.03	50,111.03
应付清算款	-	-	-	3,154,995.76	3,154,995.76
其他负债	-	-	-	128,297.10	128,297.10
负债总计	-	-	-	3,494,940.04	3,494,940.04
利率敏感度缺口	42,614,661.43	-	-	-277,277,390.70	319,892,052.13
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	26,304,059.20	-	-	-	26,304,059.20
结算备付金	60,953.77	-	-	-	60,953.77
存出保证金	18,118.18	-	-	-	18,118.18
交易性金融资产	-	-	-	-333,053,241.60	333,053,241.60
其他资产	-	-	-	9,207.69	9,207.69
资产总计	26,383,131.15	-	-	-333,062,449.29	359,445,580.44
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	197,594.75	197,594.75
应付托管费	-	-	-	61,174.33	61,174.33

应付证券清算款	-	-	-	29.54	29.54
应交税费	-	-	-	801,249.86	801,249.86
其他负债	-	-	-	179,464.82	179,464.82
负债总计	-	-	-	1,239,513.30	1,239,513.30
利率敏感度缺口	26,383,131.15	-	-	-331,822,935.99	358,206,067.14

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

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。本集合计划持有以非记账本位币人民币计价的资产与负债，因此存在相应的外汇风险。本集合计划管理人每日对本集合计划的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	131,798,511.66	-	131,798,511.66
资产合计	-	131,798,511.66	-	131,798,511.66
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	131,798,511.66	-	131,798,511.66
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资 产	-	138,510,741.02	-	138,510,741.02

资产合计	-	138,510,741.02	-	138,510,741.02
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	138,510,741.02	-	138,510,741.02

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除市场汇率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	港币相对人民币升值 5%	6,589,925.58	6,925,537.05
	港币相对人民币贬值 5%	-6,589,925.58	-6,925,537.05

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是集计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素发生变动时产生的价格波动风险。本集计划主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本集计划严格按照合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，管理人每日对本集计划所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对集计划进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021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	277,645,830.59	86.79	333,053,241.60	92.98
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	277,645,830.59	86.79	333,053,241.60	92.98

6.4.13.4.3.2 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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	沪深 300 指数上升 5%	19,165,064.96	19,146,537.67
	沪深 300 指数下降 5%	-19,165,064.96	-19,146,537.67

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	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	277,381,251.26	332,237,188.00
第二层次	119,142.43	816,053.60
第三层次	145,436.90	-
合计	277,645,830.59	333,053,241.60

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。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

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	权益投资	277,645,830.59	85.86
	其中：股票	277,645,830.59	85.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	42,587,699.33	13.17
8	其他各项资产	3,153,462.25	0.98
9	合计	323,386,992.17	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 131,798,511.66 元人民币，占期末集合计划资产净值比例 41.20%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	785.97	0.00
B	采矿业	338.91	0.00
C	制造业	115,395,953.46	36.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,423.32	0.00
E	建筑业	6,176.15	0.00
F	批发和零售业	29,601.81	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	3,927.89	0.00
H	住宿和餐饮业	1,248.12	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,463.44	0.01
J	金融业	30,300,146.48	9.47
K	房地产业	2,043.36	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	41,792.82	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	17,215.43	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	889.70	0.00
Q	卫生和社会工作	4,884.70	0.00
R	文化、体育和娱乐业	9,427.37	0.00
S	综合	-	-
	合计	145,847,318.93	45.59

7.2.2 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	14,986,777.16	4.68
消费者常用品	4,002,289.20	1.25
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	42,625,876.58	13.33
工业	4,375,152.04	1.37
信息技术	47,472,287.89	14.84
电信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	18,336,128.79	5.73
合计	131,798,511.66	41.20

注：以上行业分类采用港交所二级分类标准。

7.3 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	600309	万华化学	265,000	25,702,350.00	8.03
2	00700	腾讯控股	75,070	22,752,165.75	7.11
3	600036	招商银行	480,000	20,256,000.00	6.33
4	03690	美团-W	105,000	17,438,179.29	5.45
5	000858	五粮液	83,000	16,760,190.00	5.24
6	000333	美的集团	260,000	15,701,400.00	4.91
7	02269	药明生物	230,000	14,122,607.66	4.41
8	03323	中国建材	1,950,000	13,974,659.79	4.37
9	00853	微创医疗	710,000	13,813,456.48	4.32
10	600887	伊利股份	230,000	8,958,500.00	2.80
11	603899	晨光股份	155,000	8,692,400.00	2.72
12	01448	福寿园	1,650,000	7,972,508.78	2.49
13	300285	国瓷材料	210,000	7,543,200.00	2.36
14	000651	格力电器	200,000	6,744,000.00	2.11
15	02020	安踏体育	70,000	5,770,822.12	1.80
16	01302	先健科技	2,200,000	5,437,298.02	1.70
17	002142	宁波银行	150,000	5,371,500.00	1.68
18	600809	山西汾酒	16,000	5,196,800.00	1.62
19	601318	中国平安	100,000	4,669,000.00	1.46
20	01810	小米集团-W	400,000	4,665,916.64	1.46
21	600486	扬农化工	35,000	4,664,800.00	1.46
22	02382	舜宇光学科技	40,000	4,375,152.04	1.37
23	00914	海螺水泥	150,000	4,361,469.00	1.36
24	00291	华润啤酒	80,000	4,002,289.20	1.25
25	600031	三一重工	200,000	3,812,000.00	1.19
26	600426	华鲁恒升	120,000	3,504,000.00	1.10
27	300760	迈瑞医疗	11,000	3,445,200.00	1.08
28	06160	百济神州	40,000	3,369,448.60	1.05
29	01024	快手-W	35,000	2,616,026.21	0.82
30	02359	药明康德	25,000	2,234,183.88	0.70
31	09926	康方生物-B	105,000	2,069,773.60	0.65
32	002507	涪陵榨菜	50,000	1,726,000.00	0.54
33	06618	京东健康	30,000	1,579,108.34	0.49
34	600690	海尔智家	50,000	1,373,000.00	0.43
35	02331	李宁	20,000	1,243,446.26	0.39
36	000786	北新建材	30,000	1,038,600.00	0.32
37	688400	凌云光	3,120	68,421.60	0.02
38	688237	超卓航科	1,229	50,720.83	0.02

39	301217	铜冠铜箔	1,173	17,431.69	0.01
40	301206	三元生物	318	14,659.92	0.00
41	301096	百诚医药	169	13,351.00	0.00
42	301219	腾远钴业	136	12,176.52	0.00
43	301263	泰恩康	346	11,165.06	0.00
44	301221	光庭信息	163	10,567.29	0.00
45	301216	万凯新材	316	9,521.78	0.00
46	301215	中汽股份	1,483	9,489.57	0.00
47	301268	铭利达	238	8,560.28	0.00
48	301089	拓新药业	66	8,290.92	0.00
49	601089	福元医药	382	8,041.10	0.00
50	301258	富士莱	180	7,847.40	0.00
51	605111	新洁能	62	7,800.22	0.00
52	301029	怡合达	94	7,661.00	0.00
53	301127	天源环保	688	7,657.44	0.00
54	301256	华融化学	738	7,449.12	0.00
55	301116	益客食品	360	7,390.76	0.00
56	301097	天益医疗	148	7,242.85	0.00
57	603051	鹿山新材	90	7,110.00	0.00
58	301196	唯科科技	182	6,853.46	0.00
59	301155	海力风电	75	6,825.00	0.00
60	301237	和顺科技	155	6,691.16	0.00
61	301130	西点药业	168	6,519.90	0.00
62	301212	联盛化学	193	6,482.32	0.00
63	603529	爱玛科技	123	6,442.74	0.00
64	301189	奥尼电子	190	6,328.90	0.00
65	301235	华康医疗	164	6,238.37	0.00
66	301228	实朴检测	294	6,008.52	0.00
67	301050	雷电微力	58	5,890.48	0.00
68	300834	星辉环材	195	5,857.00	0.00
69	300910	瑞丰新材	91	5,753.02	0.00
70	301207	华兰疫苗	100	5,731.70	0.00
71	301190	善水科技	236	5,600.28	0.00
72	301279	金道科技	235	5,580.57	0.00
73	301100	风光股份	256	5,524.48	0.00
74	301222	浙江恒威	175	5,153.54	0.00
75	301135	瑞德智能	187	5,076.54	0.00
76	301137	哈焊华通	300	4,935.60	0.00
77	301181	标榜股份	155	4,800.73	0.00
78	301103	何氏眼科	146	4,709.60	0.00
79	301182	凯旺科技	187	4,443.12	0.00
80	001215	千味央厨	71	3,996.59	0.00

81	300860	锋尚文化	83	3,920.09	0.00
82	003021	兆威机电	79	3,773.83	0.00
83	301118	恒光股份	86	3,700.58	0.00
84	001266	宏英智能	72	3,584.88	0.00
85	300973	立高食品	34	3,534.30	0.00
86	300982	苏文电能	75	3,522.00	0.00
87	301177	迪阿股份	45	3,339.00	0.00
88	001317	三羊马	63	3,196.62	0.00
89	003026	中晶科技	52	3,019.64	0.00
90	300937	药易购	92	2,945.84	0.00
91	300979	华利集团	40	2,923.20	0.00
92	301199	迈赫股份	88	2,819.52	0.00
93	603150	万朗磁塑	93	2,768.61	0.00
94	001296	长江材料	108	2,654.64	0.00
95	301052	果麦文化	78	2,568.54	0.00
96	300895	铜牛信息	88	2,553.76	0.00
97	003038	鑫铂股份	50	2,520.00	0.00
98	001219	青岛食品	108	2,467.80	0.00
99	301011	华立科技	75	2,466.75	0.00
100	001234	泰慕士	90	2,437.20	0.00
101	605259	绿田机械	82	2,341.92	0.00
102	301010	晶雪节能	92	2,332.20	0.00
103	605376	博迁新材	40	2,332.00	0.00
104	301026	浩通科技	63	2,323.44	0.00
105	301108	洁雅股份	58	2,295.06	0.00
106	688120	华海清科	9	2,235.60	0.00
107	301198	喜悦智行	96	2,164.80	0.00
108	001210	金房节能	84	2,104.20	0.00
109	001218	丽臣实业	88	2,101.44	0.00
110	301033	迈普医学	49	2,063.39	0.00
111	300917	特发服务	66	2,043.36	0.00
112	300985	致远新能	70	2,009.00	0.00
113	300925	法本信息	163	1,947.85	0.00
114	301133	金钟股份	70	1,943.90	0.00
115	300992	泰福泵业	91	1,939.21	0.00
116	300996	普联软件	65	1,920.75	0.00
117	301099	雅创电子	23	1,920.04	0.00
118	300926	博俊科技	81	1,891.35	0.00
119	300614	百川畅银	75	1,887.00	0.00
120	301018	申菱环境	72	1,858.32	0.00
121	603215	比依股份	88	1,854.16	0.00
122	301015	百洋医药	85	1,834.30	0.00

123	300986	志特新材	49	1,803.20	0.00
124	300886	华业香料	58	1,802.64	0.00
125	301091	深城交	63	1,719.90	0.00
126	300907	康平科技	83	1,715.61	0.00
127	301185	鸥玛软件	92	1,701.08	0.00
128	605058	澳弘电子	88	1,698.40	0.00
129	301002	崧盛股份	68	1,691.16	0.00
130	301092	争光股份	53	1,667.38	0.00
131	301020	密封科技	74	1,665.00	0.00
132	301057	汇隆新材	68	1,655.80	0.00
133	301101	明月镜片	32	1,642.56	0.00
134	603097	江苏华辰	68	1,604.80	0.00
135	605005	合兴股份	92	1,595.28	0.00
136	300930	屹通新材	44	1,580.48	0.00
137	003029	吉大正元	77	1,563.10	0.00
138	003010	若羽臣	93	1,511.25	0.00
139	300861	美畅股份	16	1,483.04	0.00
140	300940	南极光	63	1,482.39	0.00
141	603071	物产环能	80	1,451.20	0.00
142	603191	望变电气	63	1,436.40	0.00
143	301016	雷尔伟	77	1,436.05	0.00
144	605020	永和股份	58	1,427.96	0.00
145	301058	中粮工科	81	1,408.59	0.00
146	301081	严牌股份	93	1,402.44	0.00
147	300913	兆龙互连	88	1,396.56	0.00
148	002996	顺博合金	91	1,383.20	0.00
149	605319	无锡振华	95	1,381.30	0.00
150	605339	南侨食品	54	1,369.98	0.00
151	300864	南大环境	65	1,365.00	0.00
152	300962	中金辐照	90	1,359.00	0.00
153	301030	仕净科技	58	1,352.56	0.00
154	301059	金三江	80	1,344.00	0.00
155	603171	税友股份	48	1,343.04	0.00
156	605179	一鸣食品	93	1,315.02	0.00
157	300922	天秦装备	73	1,311.08	0.00
158	003027	同兴环保	75	1,308.75	0.00
159	001207	联科科技	74	1,258.74	0.00
160	301073	君亭酒店	18	1,248.12	0.00
161	003031	中瓷电子	19	1,227.40	0.00
162	605151	西上海	69	1,225.44	0.00
163	301179	泽宇智能	30	1,224.30	0.00
164	301027	华蓝集团	50	1,214.00	0.00

165	001313	粤海饲料	99	1,213.74	0.00
166	600955	维远股份	42	1,211.28	0.00
167	300943	春晖智控	77	1,209.67	0.00
168	605177	东亚药业	57	1,187.88	0.00
169	605068	明新旭腾	50	1,167.50	0.00
170	605337	李子园	42	1,162.56	0.00
171	301188	力诺特玻	65	1,157.00	0.00
172	605580	恒盛能源	84	1,132.32	0.00
173	301053	远信工业	48	1,121.28	0.00
174	301138	华研精机	36	1,107.00	0.00
175	603230	内蒙新华	88	1,100.88	0.00
176	603122	合富中国	85	1,058.25	0.00
177	301028	东亚机械	97	1,049.54	0.00
178	300958	建工修复	53	1,048.34	0.00
179	003020	立方制药	35	1,029.70	0.00
180	300987	川网传媒	61	1,029.07	0.00
181	605136	丽人丽妆	64	1,012.48	0.00
182	301017	漱玉平民	54	1,001.16	0.00
183	301012	扬电科技	24	984.24	0.00
184	301007	德迈仕	65	979.55	0.00
185	003037	三和管桩	79	966.17	0.00
186	301041	金百泽	49	965.79	0.00
187	605277	新亚电子	47	962.09	0.00
188	301111	粤万年青	35	959.70	0.00
189	605028	世茂能源	48	956.64	0.00
190	600927	永安期货	47	947.99	0.00
191	003040	楚天龙	46	945.76	0.00
192	603219	富佳股份	47	936.24	0.00
193	300868	杰美特	52	929.76	0.00
194	605598	上海港湾	50	903.00	0.00
195	605122	四方新材	50	900.00	0.00
196	603070	万控智造	43	898.70	0.00
197	003032	传智教育	62	889.70	0.00
198	300774	倍杰特	44	887.04	0.00
199	300994	久祺股份	27	885.87	0.00
200	600032	浙江新能	59	864.35	0.00
201	300814	中富电路	47	860.10	0.00
202	605303	园林股份	65	835.25	0.00
203	301025	读客文化	63	830.34	0.00
204	300890	翔丰华	15	829.80	0.00
205	605133	嵘泰股份	36	823.68	0.00
206	605577	龙版传媒	72	820.80	0.00

207	301193	家联科技	30	814.50	0.00
208	603206	嘉环科技	42	810.60	0.00
209	003030	祖名股份	29	805.04	0.00
210	605069	正和生态	52	797.68	0.00
211	001216	华瓷股份	60	771.00	0.00
212	605167	利柏特	97	769.21	0.00
213	300891	惠云钛业	62	748.34	0.00
214	300997	欢乐家	56	748.16	0.00
215	003013	地铁设计	44	741.84	0.00
216	301136	招标股份	37	738.15	0.00
217	300963	中洲特材	38	736.44	0.00
218	605338	巴比食品	24	732.24	0.00
219	605011	杭州热电	45	730.80	0.00
220	600906	财达证券	81	728.19	0.00
221	300966	共同药业	24	716.40	0.00
222	605208	永茂泰	45	712.35	0.00
223	605258	协和电子	29	700.35	0.00
224	300892	品渥食品	23	688.85	0.00
225	301079	邵阳液压	27	669.60	0.00
226	300882	万胜智能	47	669.28	0.00
227	605077	华康股份	30	661.50	0.00
228	300929	华骐环保	44	605.00	0.00
229	003006	百亚股份	48	592.32	0.00
230	300931	通用电梯	76	587.48	0.00
231	605555	德昌股份	22	560.34	0.00
232	001208	华菱线缆	45	558.90	0.00
233	003025	思进智能	27	558.63	0.00
234	300942	易瑞生物	24	554.40	0.00
235	301126	达嘉维康	32	548.16	0.00
236	605365	立达信	33	546.81	0.00
237	300893	松原股份	27	545.40	0.00
238	605183	确成股份	28	540.40	0.00
239	300967	晓鸣股份	30	540.30	0.00
240	300948	冠中生态	34	539.58	0.00
241	300854	中兰环保	27	536.76	0.00
242	300975	商络电子	61	534.97	0.00
243	301098	金埔园林	22	533.50	0.00
244	601156	东航物流	26	514.80	0.00
245	600935	华塑股份	98	513.52	0.00
246	301078	孩子王	35	513.10	0.00
247	301037	保立佳	23	502.32	0.00
248	605299	舒华体育	46	502.32	0.00

249	605186	健麾信息	16	491.84	0.00
250	300960	通业科技	26	486.72	0.00
251	001227	兰州银行	98	482.16	0.00
252	605566	福莱茵特	21	479.22	0.00
253	301062	上海艾录	39	455.13	0.00
254	003019	宸展光电	18	454.32	0.00
255	300991	创益通	31	445.78	0.00
256	301035	润丰股份	5	412.25	0.00
257	001308	康冠科技	14	408.38	0.00
258	301036	双乐股份	18	404.64	0.00
259	301006	迈拓股份	21	394.80	0.00
260	300918	南山智尚	46	393.30	0.00
261	003028	振邦智能	8	390.88	0.00
262	601825	沪农商行	62	388.74	0.00
263	603216	梦天家居	24	388.56	0.00
264	301009	可靠股份	31	386.88	0.00
265	603176	汇通集团	40	382.40	0.00
266	001209	洪兴股份	25	380.50	0.00
267	605377	华旺科技	21	376.11	0.00
268	301032	新柴股份	40	372.00	0.00
269	601187	厦门银行	61	363.56	0.00
270	001288	运机集团	23	359.03	0.00
271	601665	齐鲁银行	72	351.36	0.00
272	603272	联翔股份	16	351.20	0.00
273	605228	神通科技	45	347.85	0.00
274	603213	镇洋发展	23	344.31	0.00
275	003018	金富科技	37	342.25	0.00
276	300955	嘉亨家化	13	318.76	0.00
277	300961	深水海纳	22	298.32	0.00
278	300945	曼卡龙	18	289.44	0.00
279	301049	超越科技	12	284.52	0.00
280	605162	新中港	30	271.50	0.00
281	603132	金徽股份	21	271.11	0.00
282	601686	友发集团	35	267.40	0.00
283	301090	华润材料	24	261.84	0.00
284	003023	彩虹集团	15	258.00	0.00
285	003004	声迅股份	12	250.32	0.00
286	300972	万辰生物	19	245.67	0.00
287	605507	国邦医药	10	241.50	0.00
288	601528	瑞丰银行	28	225.68	0.00
289	300978	东箭科技	17	221.85	0.00
290	603759	海天股份	21	212.31	0.00

291	605298	必得科技	14	190.40	0.00
292	601921	浙版传媒	24	186.72	0.00
293	301060	兰卫医学	5	175.10	0.00
294	001212	中旗新材	4	168.52	0.00
295	003036	泰坦股份	15	160.65	0.00
296	603209	兴通股份	7	159.04	0.00
297	601963	重庆银行	20	158.80	0.00
298	300876	蒙泰高新	7	156.73	0.00
299	600916	中国黄金	13	152.10	0.00
300	605368	蓝天燃气	12	151.20	0.00
301	605138	盛泰集团	12	149.76	0.00
302	605055	迎丰股份	22	147.18	0.00
303	001217	华尔泰	10	135.40	0.00
304	301039	中集车辆	12	129.96	0.00
305	301168	通灵股份	2	90.16	0.00
306	300950	德固特	5	81.50	0.00
307	605268	王力安防	7	76.79	0.00
308	301088	戎美股份	4	74.64	0.00
309	301046	能辉科技	2	69.22	0.00
310	001203	大中矿业	6	67.80	0.00
311	301066	万事利	4	57.04	0.00
312	605180	华生科技	3	52.17	0.00
313	300933	中辰股份	6	48.90	0.00
314	603565	中谷物流	3	47.61	0.00
315	003035	南网能源	7	44.45	0.00
316	605599	菜百股份	4	43.52	0.00
317	601728	中国电信	11	41.03	0.00
318	301048	金鹰重工	3	33.03	0.00
319	300932	三友联众	1	18.39	0.00
320	605060	联德股份	1	18.15	0.00
321	605196	华通线缆	2	15.76	0.00
322	001213	中铁特货	2	9.82	0.00

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。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	00914	海螺水泥	5,437,590.45	1.52
2	03690	美团-W	4,805,420.34	1.34
3	600426	华鲁恒升	3,894,768.30	1.09

4	600031	三一重工	3,737,188.00	1.04
5	300760	迈瑞医疗	3,454,873.00	0.96
6	600309	万华化学	3,411,563.00	0.95
7	00688	中国海外发展	3,409,064.68	0.95
8	00700	腾讯控股	3,186,064.12	0.89
9	00587	海螺环保	2,771,023.05	0.77
10	01024	快手-W	2,539,172.77	0.71
11	600009	上海机场	2,492,986.00	0.70
12	02269	药明生物	2,345,933.97	0.65
13	600036	招商银行	2,179,288.00	0.61
14	00853	微创医疗	2,072,093.61	0.58
15	02359	药明康德	2,061,144.95	0.58
16	02020	安踏体育	2,023,514.17	0.56
17	601668	中国建筑	1,633,000.00	0.46
18	06618	京东健康	1,539,266.22	0.43
19	03323	中国建材	1,291,926.04	0.36
20	600690	海尔智家	1,275,766.00	0.36

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000002	万科A	10,348,162.80	2.89
2	600585	海螺水泥	6,407,209.00	1.79
3	600276	恒瑞医药	6,196,401.00	1.73
4	002507	涪陵榨菜	6,063,982.84	1.69
5	600009	上海机场	5,778,014.00	1.61
6	601318	中国平安	5,481,292.47	1.53
7	00586	海螺创业	5,379,499.65	1.50
8	300285	国瓷材料	4,049,972.00	1.13
9	00688	中国海外发展	3,851,730.78	1.08
10	000651	格力电器	3,606,915.00	1.01
11	600486	扬农化工	3,299,973.00	0.92
12	01810	小米集团-W	2,627,344.29	0.73
13	01521	方达控股	2,422,205.75	0.68
14	002304	洋河股份	1,644,313.00	0.46
15	601668	中国建筑	1,549,033.00	0.43
16	00587	海螺环保	1,409,139.12	0.39
17	02382	舜宇光学科技	1,123,693.08	0.31
18	03606	福耀玻璃	1,032,660.23	0.29
19	002142	宁波银行	986,745.00	0.28
20	01177	中国生物制药	885,541.16	0.25

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。

7.4.3 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	70,102,957.93
卖出股票收入（成交）总额	86,346,584.60

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本集合计划本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本集合计划本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本集合计划本报告期末进行国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

本报告编制日前一年内：

本集合计划持有的“招商银行”因未依法履行其他职责，于 2021 年 5 月 21 日被中国银行保险监督管理委员会公开处罚 7170 万元；因未依法履行其他职责，于 2022 年 3 月 25 日被中国银行保险监督管理委员会公开处罚 300 万元。

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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

集合计划的前十名股票未超出集合计划合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	26,962.10
2	应收清算款	1,676,458.68
3	应收股利	1,450,041.47
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,153,462.25

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本集合计划本报告期末未持有可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 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

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 价值 30 个 月持有混 合 A	275	117,719.75	-	-	32,372,930.73	100.00
光大阳光 价值 30 个 月持有混 合 B	2,914	70,799.68	13,746,516.18	6.66	192,563,743.19	93.34
合计	3,189	74,845.78	13,746,516.18	5.76	224,936,673.92	94.24

注：分级集合机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级集合，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级集合份额的合计数（即期末集合份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管 理人 所 有 从 业 人 员 持 有 本 基 金	光大阳光价值 30 个月持有混合 A	0.00	0.0000
	光大阳光价值 30 个月持有混合 B	3,046,338.39	1.4766
	合计	3,046,338.39	1.2763

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）。

8.3 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	光大阳光价值 30 个月持有混合 A	0
	光大阳光价值 30 个月持有混合 B	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有 本开放式基金	光大阳光价值 30 个月持有混合 A	0
	光大阳光价值 30 个月持有混合 B	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	光大阳光价值 30 个月持有混合 A	光大阳光价值 30 个月持有混合 B
基金合同生效日 (2020 年 4 月 17 日) 基金份额总额	57,469,244.51	-
本报告期期初基金份 额总额	33,520,278.89	206,310,259.37
本报告期基金总申购 份额	-	-
减：本报告期基金总 赎回份额	1,147,348.16	-
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	32,372,930.73	206,310,259.37

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 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，本集合计划管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚情况；

本报告期内，本集合计划托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

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	151,627,822.64	100.00	112,664.18	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	-	-	-	-	-	-

注：本集合计划本报告期未进行债券交易、债券回购交易以及权证交易。

10.8 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	中国证监会规定的媒介	2022 年 01 月 04 日
2	关于旗下光大阳光价值 30 个月持有期混合型集合资产管理计划 2022 年部分港股通非交易日暂停开放公告	中国证监会规定的媒介	2022 年 01 月 24 日
3	关于旗下光大阳光价值 30 个月持有期混合型集合资产管理计划 2022 年	中国证监会规定的媒介	2022 年 04 月 25 日

	部分港股通非交易日暂停开放公告	
--	-----------------	--

§ 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

本报告期内，本集合计划未发生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《光大阳光价值 30 个月持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》变更批复的文件；

2、《光大阳光价值 30 个月持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》；

3、《光大阳光价值 30 个月持有期混合型集合资产管理计划托管协议》；

4、《光大阳光价值 30 个月持有期混合型集合资产管理计划招募说明书》；

5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；

6、集合计划管理人业务资格批件、营业执照；

7、中国证监会要求的其他文件

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