

光大阳光 3 个月持有期混合型基金中基金  
(FOF) 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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
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
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
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	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>45</b>
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48

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 .....	48
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 .....	48
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 .....	48
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 .....	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	49
7.12 本报告期投资基金情况 .....	49
7.13 投资组合报告附注 .....	53
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	55
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 .....	55
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>55</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>56</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	56
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 .....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	56
10.4 基金投资策略的改变 .....	56
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	56
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	56
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	56
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	56
10.9 其他重大事件 .....	57
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>58</b>
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 .....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	58
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>58</b>
12.1 备查文件目录 .....	58
12.2 存放地点 .....	58
12.3 查阅方式 .....	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	光大阳光 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划	
基金简称	光大阳光 3 个月持有 (FOF)	
基金主代码	860022	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 7 月 22 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	698,651,775.85 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 3 个月持有 (FOF) A	光大阳光 3 个月持有 (FOF) C
下属分级基金的交易代码	860022	860063
报告期末下属分级基金的份额总额	428,460,356.77 份	270,191,419.08 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	在控制和分散投资组合风险的前提下,实现组合资产长期稳健增值。
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、债权类资产等各类资产的配置比例。</p> <p>(二) 基金投资策略</p> <p>本集合计划将通过定量分析和定性调研相结合的方法,通过基金季报、中期报告、年报、净值等公开披露信息进行风险、收益以及风险调整后的收益等指标分析,构建基金数据库和基金经理数据库;在定量分析的基础上,结合定性调研,通过基金公司的管理模式、考核机制等信息对基金经理的行为进行进一步验证,跟踪考察基金经理的投资理念、投资行为的变化,全方位审视基金产品。</p> <p>(三) 股票投资策略</p> <p>1、股票组合的构建</p> <p>本集合计划首先通过行业发展前景及竞争格局考察、公司竞争力分析、公司可持续成长潜力评估及投资吸引力评估等四个层面的综合比较初步筛选出投资备选股票。然后,以全球市场为参照,通过对经济发展阶段、行业发展阶段和前景、公司综合竞争能力的逐层分解,形成对公司的相对估值判断。最后,由研究员通过调研、财务分析及量化估值等方法,筛选出质地优良、盈利持续增长、估值具备吸引力和市场预期持续改善的公司构建股票投资组合。</p> <p>2、港股通股票投资策略</p>

	<p>本集合计划将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本集合计划将关注在港股市场上市、具有行业代表性和核心竞争力的优质公司，关注港股市场在行业结构、估值、AH 股折溢价、股息率等方面具有吸引力的投资标的。</p> <p>(四) 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>(五) 资产支持证券投资策略</p> <p>本集合计划将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×65%+中证全债指数收益率×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%
风险收益特征	<p>本集合计划为混合型 FOF，由于本集合计划主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额，持有基金的预期风险和预期收益间接成为本集合计划的风险和预期收益。理论上，本集合计划预期风险和预期收益高于债券型基金、债券型 FOF、债券型集合计划和货币市场基金、货币型 FOF，低于股票型基金、股票型 FOF、股票型集合计划。</p> <p>本集合计划可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本集合计划还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。</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 3 个月持有 (FOF) A	光大阳光 3 个月持有 (FOF) C
本期已实现收益	-65,097,962.36	-17,999,867.97
本期利润	-101,903,450.79	-28,590,059.22
加权平均基金份额本期利润	-0.2336	-0.1026
本期加权平均净值利润率	-11.02%	-11.56%
本期基金份额净值增长率	-9.41%	-9.60%
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	-24,020,070.05
	期末可供分配基金份额利润	-0.0889
	期末基金资产净值	246,171,349.03
期末基金份额净值	2.1787	0.9111
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	-8.89%

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 01 日-2022 年 06 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 3 个月持有 (FOF) 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	6.64%	0.78%	6.33%	0.75%	0.31%	0.03%
过去三个月	4.82%	1.12%	4.76%	0.98%	0.06%	0.14%
过去六个月	-9.41%	1.15%	-5.54%	1.02%	-3.87%	0.13%
自基金合同生效起至今	-7.47%	0.98%	-7.97%	0.88%	0.50%	0.10%

光大阳光 3 个月持有 (FOF) C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.60%	0.78%	6.33%	0.75%	0.27%	0.03%
过去三个月	4.71%	1.12%	4.76%	0.98%	-0.05%	0.14%
过去六个月	-9.60%	1.15%	-5.54%	1.02%	-4.06%	0.13%

自基金合同生效起 至今	-8.89%	0.98%	-7.97%	0.88%	-0.92%	0.10%
----------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

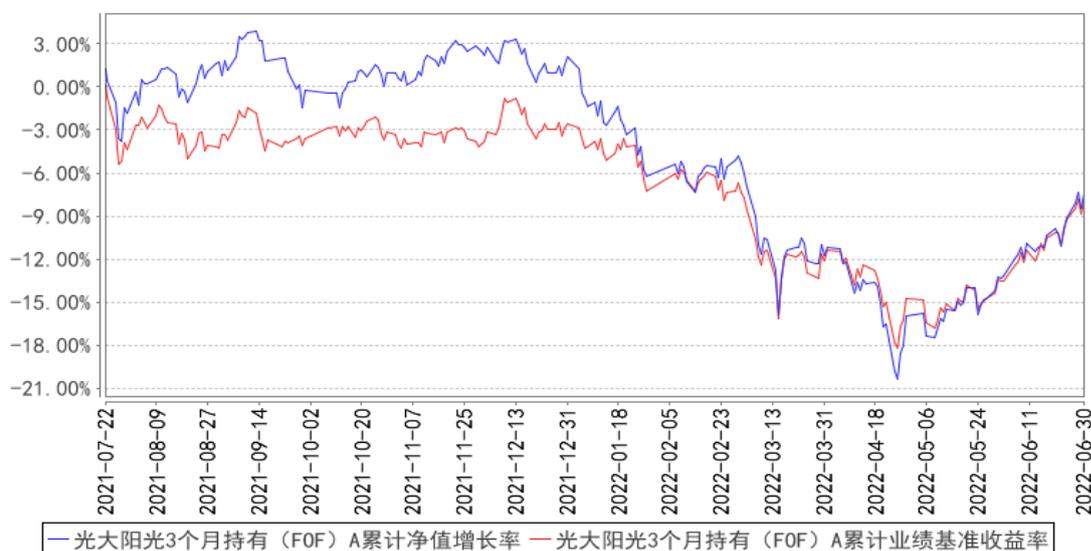
注：1、自基金合同生效日起至今指 2021 年 7 月 22 日-2022 年 06 月 30 日。

2、业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×65%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×5%+中证全债指数收益率×30%。

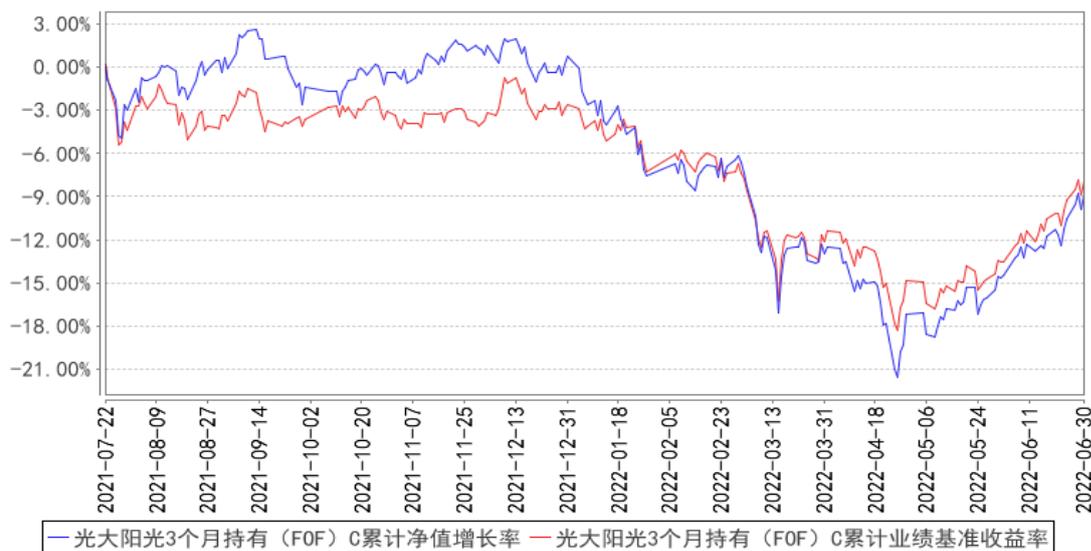
3、C 类份额设立日为 2021 年 7 月 23 日。

### 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3个月持有（FOF）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3个月持有（FOF）C 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### 3.3 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		
沈吟	多策略投资总监兼 FOF 投资部总经理与多策略研究部总经理、本集合计划投资经理	2021 年 7 月 22 日	-	12 年	沈吟女士，同济大学本科、英国拉夫堡大学经济学硕士，曾任职于合众人寿保险股份有限公司、光大证券股份有限公司固定收益总部、证券投资总部、金融市场总部，2014 年加入光大证券资产管理有限公司，现任多策略投资总监兼 FOF 投资部总经理与多策略研究部总经理。

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

2022 年上半年，权益市场经历了 V 型走势。4 月底之前，权益市场明显调整。从基本面来看，外部因素和疫情对市场影响为主要因素。首先地缘风险上升，导致石油价格攀升，并带动通胀预期升温，美国超预期加息节奏，北上资金显著流出，是 2020 年以来首次单季度流出，权益市场情绪和资金面压力较大。之后国内疫情导致供应链的问题，对汽车等产业链形成了较大影响，叠加对需求的悲观预期，市场在 4 月最后一跌，砸出了一个深坑。创成长为代表的指数经历了杀估值、杀基本面两个阶段，形成了较大的回撤。4 月 26 日之后，随着疫情数据的边际变化，国内产业链逐步复工，市场走入超跌反弹的行情。到 6 月，稳增长政策不断加码，投资者情绪和资金重新回到市场。尤其是新能源、汽车为代表制造业领涨市场。6 月 A 股在全球市场走出独立行情，单月涨幅超过 5 月。成长和消费股领涨。大类资产中，商品开始从高位回落，尤其是工业金属。市场按照疫情政策放松、超跌反弹的逻辑继续演绎。背后是流动性持续宽松和基本面环比改善的叠加，行情超预期的放量上涨，成交额较 5 月的平均值增加 30%。一方面得益于国内宽松的流动性。6 月银行间短端虽然有所上行，但是低于预期，季节性来看也是非常宽松的阶段。社融虽然总量数据不错，不管是宏观还是金融市场，资金较为充沛。另一方面，海外的资金加配中国资产，

中美货币政策、经济周期处于错位阶段，北上资金不断流入 A 股，也对市场起到了推波助澜的作用。我们在年初对组合的波动和风格进行了控制，配置了偏价值的基金，在市场转暖过程中对组合的风格进行了再平衡。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 06 月 30 日，光大阳光 3 个月持有期混合型 (FOF) A 类份额净值为 2.1787 元，本报告期份额净值增长率为-9.41%；光大阳光 3 个月持有期混合型 (FOF) C 类份额净值为 0.9111 元，本报告期份额净值增长率为-9.60%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，市场处于流动性较好且具有赚钱效应的环境。国内的交易资金，从融资杠杆比例来看，处于中枢偏低水平，且基民股民并未大幅入场，流动性整体风险不大。在常态化核酸检测和稳增长两者平衡下，预计 2022Q3 经济将继续改善，但房地产销售和投资修复不明显，意味经济修复斜率偏低，因此宏观宽松周期将持续，稳增长政策加码的力度值得关注。未来非食品价格回落的背景下食品价格走高不构成货币政策的约束，政策松紧的变化主要观察失业率，其次是地产和出口。在信用底向经济低的周期中，从胜率和超额收益来看，消费医药、成长都具有配置价值。一方面，经济环比改善而稳增长加码的阶段，权益资产往往处在一个相对有利的环境之中；另一方面，海外衰退交易降低了未来美债利率和大宗价格冲击的概率，对 A 股成长股也偏利好。结构来看，经济预期环比改善、信用利差收敛带动小盘跑赢大盘，综合来看，小盘成长是需要关注的一类风格。

#### 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 3 个月持有期混合型基金中基金集合资产管理计划（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 3 个月持有期混合型基金中基金集合资产管理计划 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 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	57,972,476.60	45,742,657.82
结算备付金		189,138.98	946,318.70
存出保证金		674,222.66	433,539.01
交易性金融资产	6.4.7.2	1,111,683,539.99	1,284,696,584.65
其中：股票投资		29,733,848.56	83,417,709.11
基金投资		1,026,516,832.53	1,132,885,860.94
债券投资		55,432,858.90	68,393,014.60
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		36,855,793.66	30,000,000.00
应收股利		70,442.40	-
应收申购款		3,608.44	273,190.68
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	842,753.76
资产总计		1,207,449,222.73	1,362,935,044.62
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		24,449,027.87	1.88
应付赎回款		1,751,119.51	490,660.62
应付管理人报酬		936,417.90	1,051,019.81
应付托管费		187,283.57	210,204.02
应付销售服务费		78,160.74	73,531.85
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	396,039.60	798,973.50
负债合计		27,798,049.19	2,624,391.68
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	698,651,775.85	731,434,845.03
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	480,999,397.69	628,875,807.91
净资产合计		1,179,651,173.54	1,360,310,652.94
负债和净资产总计		1,207,449,222.73	1,362,935,044.62

注：1、报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 698,651,775.85 份，其中光大阳光 3 个月持有 (FOF) A 基金份额总额 428,460,356.77 份，基金份额净值 2.1787 元。光大阳光 3 个月持有 (FOF) C 基金份额总额 270,191,419.08 份，基金份额净值 0.9111 元；

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 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 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
<b>一、营业总收入</b>		-122,916,323.77
1. 利息收入		385,767.75
其中：存款利息收入	6.4.7.13	369,332.46
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		16,435.29
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-75,935,308.15
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-20,143,281.32
基金投资收益	6.4.7.15	-74,266,638.37
债券投资收益	6.4.7.16	589,530.62
资产支持证券投资收益	6.4.7.17	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-

衍生工具收益	6.4.7.19	-
股利收益	6.4.7.20	17,885,080.92
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)	6.4.7.21	-47,395,679.68
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6.4.7.22	28,896.31
<b>减: 二、营业总支出</b>		<b>7,577,186.24</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,824,924.42
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,164,984.84
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	491,813.52
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-
5. 利息支出		-
其中: 卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.23	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.24	95,463.46
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>-130,493,510.01</b>
减: 所得税费用		-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		<b>-130,493,510.01</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-130,493,510.01</b>

注: 本集合计划合同生效日为 2021 年 7 月 22 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 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 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)	731,434,845.03	-	628,875,807.91	1,360,310,652.94
加: 会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	731,434,845.03	-	628,875,807.91	1,360,310,652.94
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-32,783,069.18	-	-147,876,410.22	-180,659,479.40
(一)、综合收益总额	-	-	-130,493,510.01	-130,493,510.01
(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)	-32,783,069.18	-	-17,382,900.21	-50,165,969.39
其中:1. 基金申购款	1,176,630.96	-	150,437.99	1,327,068.95
2. 基金赎回款	-33,959,700.14	-	-17,533,338.20	-51,493,038.34
(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)	698,651,775.85	-	480,999,397.69	1,179,651,173.54

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：

<u>汪沛</u>	<u>詹朋</u>	<u>杨薇</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

光大阳光 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划是由光大阳光基中宝 (阳光 2 号二期) 集合资产管理计划转型而来。本集合计划管理人上海光大证券资产管理有限公司于 2021 年 7 月 8 日发布了《光大阳光基中宝集合资产管理计划合同变更公告》，光大阳光基中宝 (阳光 2 号二期) 集合资产管理计划名称变更为“光大阳光 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划”，光大阳光基中宝 (阳光 2 号二期) 集合资产管理计划产品份额变更为光大阳光 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 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 2021 年 7 月 22 日起，《光大阳光 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划资产管理合同》、《光大阳光 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 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，托管人为中国光大银行有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《光大阳光 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 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，包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（包括 QDII 基金和香港互认基金）份额，国内依法发行上市的股票（含创业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）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）、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本集合计划的投资组合比例为：投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额的比例不低于计划资产的 80%，其中，投资于股票、股票型基金和权益类资产比例不低于 60% 的混合型基金合计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%），投资于商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）份额的比例不高于集合计划资产的 10%。本集合计划保留的现金或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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

本集合计划的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率\*65%+中证全债指数收益率\*30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率\*5%

#### 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〈年度报告和中期报告〉》、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 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 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 45,742,657.82 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 20,592.83 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 45,763,250.65 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 946,318.70 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 866.99 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 947,185.69 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 433,539.01 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 210.20 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，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 433,749.21 元。

买入返售金融资产于 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 0.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.00 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，买入返售金融资产于 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 0.00 元。

应收申购款于 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 273,190.68 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.00 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，应收申购款于 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 273,190.68 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 842,753.76 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 20,592.83 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 866.99 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 210.20 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 821,083.74 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 151,810,723.71 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 821,083.74 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 152,631,807.45 元。

以摊余成本计量的金融负债：

卖出回购金融资产款于 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 0.00 元，自应付利息转入的重分类金额为人民币 0.00 元。经上述重分类后，卖出回购金融资产款于 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 0.00 元。

应付利息于 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 0.00 元，转出至卖出回购金融资产款的重分类金额为人民币 0.00 元。经上述重分类后，应付利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

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	57,972,476.60
等于: 本金	57,956,885.31
加: 应计利息	15,591.29
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	57,972,476.60

#### 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	28,886,942.99	-	29,733,848.56	846,905.57
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	54,914,224.00	414,358.90	55,432,858.90
	合计	54,914,224.00	414,358.90	55,432,858.90
资产支持证券	-	-	-	-
基金	984,908,906.53	-	1,026,516,832.53	41,607,926.00
其他	-	-	-	-
合计	1,068,710,073.52	414,358.90	1,111,683,539.99	42,559,107.57

#### 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

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**

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	7.34
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	284,168.80
其中：交易所市场	283,768.80
银行间市场	400.00
应付利息	-
预提费用	111,863.46
合计	396,039.60

**6.4.7.10 实收基金**

金额单位：人民币元

光大阳光 3 个月持有 (FOF) 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	445,971,468.51	445,971,468.51
本期申购	213,131.71	213,131.71
本期赎回 (以“-”号填列)	-17,724,243.45	-17,724,243.45
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	428,460,356.77	428,460,356.77

光大阳光 3 个月持有 (FOF) C

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	285,463,376.52	285,463,376.52
本期申购	963,499.25	963,499.25
本期赎回 (以“-”号填列)	-16,235,456.69	-16,235,456.69
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	270,191,419.08	270,191,419.08

6.4.7.11 其他综合收益

本集合计划本报告期不存在其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

光大阳光 3 个月持有 (FOF) A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	671,968,789.20	-45,318,983.55	626,649,805.65
本期利润	-65,097,962.36	-36,805,488.43	-101,903,450.79
本期基金份额交易产生的变动数	-25,231,355.38	5,504,468.26	-19,726,887.12
其中：基金申购款	304,050.13	-64,097.89	239,952.24
基金赎回款	-25,535,405.51	5,568,566.15	-19,966,839.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	581,639,471.46	-76,620,003.72	505,019,467.74

光大阳光 3 个月持有 (FOF) C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	5,290,812.29	-3,064,810.03	2,226,002.26

本期利润	-17,999,867.97	-10,590,191.25	-28,590,059.22
本期基金份额交易产生的变动数	359,950.04	1,984,036.87	2,343,986.91
其中：基金申购款	-246.56	-89,267.69	-89,514.25
基金赎回款	360,196.60	2,073,304.56	2,433,501.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-12,349,105.64	-11,670,964.41	-24,020,070.05

#### 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		340,356.51
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		23,385.89
其他		5,590.06
合计		369,332.46

注：“其他”为交易所保证金和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		-20,143,281.32
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		-20,143,281.32

##### 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		285,803,358.01
减：卖出股票成本总额		305,157,143.34
减：交易费用		789,495.99
买卖股票差价收入		-20,143,281.32

##### 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 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	1,310,691,854.95
减：卖出/赎回基金成本总额	1,383,099,149.72
减：买卖基金差价收入应缴纳增值 税额	-
减：交易费用	1,859,343.60
基金投资收益	-74,266,638.37

## 6.4.7.16 债券投资收益

## 6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	680,742.42
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券 到期兑付）差价收入	-91,211.80
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	589,530.62

## 6.4.7.16.2 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1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 额	54,509,925.75
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成 本总额	53,473,226.80
减：应计利息总额	1,127,335.75
减：交易费用	575.00
买卖债券差价收入	-91,211.80

## 6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期内不存在债券投资收益-赎回差价收入。

## 6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期内不存在债券投资收益-申购差价收入。

#### 6.4.7.17 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

本集合计划本报告期内不存在资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.17.2 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内不存在资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

##### 6.4.7.17.3 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内不存在资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

##### 6.4.7.17.4 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内不存在资产支持证券投资收益-申购差价收入。

#### 6.4.7.18 贵金属投资收益

##### 6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

本集合计划本报告期内不存在贵金属投资收益。

##### 6.4.7.18.2 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内不存在贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期内不存在贵金属投资收益-赎回差价收入。

##### 6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期内不存在贵金属投资收益-申购差价收入。

#### 6.4.7.19 衍生工具收益

##### 6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本集合计划本报告期内不存在衍生工具收益-买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

本集合计划本报告期内不存在衍生工具收益-其他投资收益。

#### 6.4.7.20 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	336,538.06
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	17,548,542.86
合计	17,885,080.92

#### 6.4.7.21 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	-47,395,679.68
股票投资	1,645,084.56
债券投资	166,212.20
资产支持证券投资	-
基金投资	-49,206,976.44
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	-
合计	-47,395,679.68

#### 6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	28,896.31
合计	28,896.31

#### 6.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期费用 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	469,532.24
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	6,408,370.53
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	1,085,560.10

注：（1）当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金合同约定的相应费率和计算方法估算得出。

（2）根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本

基金资产。

#### 6.4.7.24 信用减值损失

本集合计划本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.25 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	17,356.09
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
合计	95,463.46

#### 6.4.7.26 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

截至资产负债表日，本集合计划未发生需要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

本集合本报告期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

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
-------	---------------------------------------

	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
光大证券	535,631,556.24	100.00

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本集合计划本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 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1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	205,300,000.00	100.00

#### 6.4.10.1.4 基金交易

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	
	成交金额	占当期基金 成交总额的比例 (%)
光大证券	1,757,419,494.27	100.00

#### 6.4.10.1.5 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。

#### 6.4.10.1.6 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	876,352.48	100.00	283,768.80	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月30日
----	----------------------------

当期发生的基金应支付的管理费	5,824,924.42
其中：支付销售机构的客户维护费	2,431,114.27

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 1%，C 类份额固定年管理费率为 1%，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
当期发生的基金应支付的托管费	1,164,984.84

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。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

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 1 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 3 个月持有 (FOF) A	光大阳光 3 个月持有 (FOF) C	合计
光大银行	-	486,557.09	486,557.09
光大证券	-	6,259.40	6,259.40
光证资管	-	5.79	5.79
合计	-	492,822.28	492,822.28

注：C 类份额集合计划销售服务费按前一日的 C 类份额集合计划资产净值的 0.4% 的年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的集合计划销售服务费

E 为 C 类份额前一日的集合计划资产净值

C 类份额集合计划销售服务费每日计算, 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。

#### 6.4.10.3 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

本报告期内基金管理人未运用自有资金投资本基金。

##### 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

份额单位: 份

光大阳光 3 个月持有 (FOF) A

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)	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	56,857,500.00	8.1382	56,857,500.00	7.7734

份额单位: 份

#### 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	
	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	57,972,476.60	340,356.51

注: 本集合计划的银行存款由基金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

本集合计划在承销期内未参与投资关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

##### 6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本集合计划本报告期末交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理的基金。

#### 6.4.11 利润分配情况

本集合计划本报告期内未进行利润分配。

#### 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

本集合计划本报告期末未持有因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

##### 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。

##### 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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	15,242,568.49	68,393,014.60
合计	15,242,568.49	68,393,014.60

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**

本集合计划本期末不存在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**

本集合计划本期末不存在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**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	40,190,290.41	-
合计	40,190,290.41	-

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**

本集合计划本期末不存在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**

本集合计划本期末不存在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	57,972,476.60	-	-	-	57,972,476.60
结算备付金	189,138.98	-	-	-	189,138.98
存出保证金	674,222.66	-	-	-	674,222.66
交易性金融资产	55,432,858.90	-	-	1,056,250,681.09	1,111,683,539.99
应收股利	-	-	-	70,442.40	70,442.40
应收申购款	-	-	-	3,608.44	3,608.44
应收清算款	-	-	-	36,855,793.66	36,855,793.66
资产总计	114,268,697.14	-	-	1,093,180,525.59	1,207,449,222.73
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,751,119.51	1,751,119.51
应付管理人报酬	-	-	-	936,417.90	936,417.90
应付托管费	-	-	-	187,283.57	187,283.57
应付清算款	-	-	-	24,449,027.87	24,449,027.87
应付销售服务费	-	-	-	78,160.74	78,160.74
其他负债	-	-	-	396,039.60	396,039.60
负债总计	-	-	-	27,798,049.19	27,798,049.19
利率敏感度缺口	114,268,697.14	-	-	-1,065,382,476.40	1,179,651,173.54
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	45,742,657.82	-	-	-	45,742,657.82

结算备付金	946,318.70	-	-	-	946,318.70
存出保证金	433,539.01	-	-	-	433,539.01
交易性金融资产	68,393,014.60	-	-	-1,216,303,570.05	1,284,696,584.65
其他资产	-	-	-	842,753.76	842,753.76
应收申购款	-	-	-	273,190.68	273,190.68
应收证券清算款	-	-	-	30,000,000.00	30,000,000.00
资产总计	115,515,530.13	-	-	-1,247,419,514.49	1,362,935,044.62
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	490,660.62	490,660.62
应付管理人报酬	-	-	-	1,051,019.81	1,051,019.81
应付托管费	-	-	-	210,204.02	210,204.02
应付证券清算款	-	-	-	1.88	1.88
应付销售服务费	-	-	-	73,531.85	73,531.85
其他负债	-	-	-	798,973.50	798,973.50
负债总计	-	-	-	2,624,391.68	2,624,391.68
利率敏感度缺口	115,515,530.13	-	-	-1,244,795,122.81	1,360,310,652.94

#### 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)	上年度末 (2021 年 12 月 31 日)
分析	市场利率上升 25 个基点	-89,514.14	-85,352.18
	市场利率下降 25 个基点	89,514.14	85,352.18

#### 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	-	7,765,843.56	-	7,765,843.56
资产合计	-	7,765,843.56	-	7,765,843.56
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	-	7,765,843.56	-	7,765,843.56
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	-	9,003,918.11	-	9,003,918.11
资产合计	-	9,003,918.11	-	9,003,918.11
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	-	9,003,918.11	-	9,003,918.11

#### 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%	388,292.18	450,195.91
	港币相对人民币贬值 5%	-388,292.18	-450,195.91

### 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公开募集的基金和上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于证券市场整体波动的影响，也可能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。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	29,733,848.56	2.52	83,417,709.11	6.13
交易性金融资产—基金投资	1,026,516,832.53	87.02	1,132,885,860.94	83.28
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	1,056,250,681.09	89.54	1,216,303,570.05	89.41

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准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	业绩基准上升 5%	63,701,163.37	56,452,892.10
	业绩基准下降 5%	-63,701,163.37	-56,452,892.10

## 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	1,056,250,681.09	318,318,500.62
第二层次	55,432,858.90	966,378,084.03
第三层次	-	-
合计	1,111,683,539.99	1,284,696,584.65

#### 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	29,733,848.56	2.46
	其中：股票	29,733,848.56	2.46
2	基金投资	1,026,516,832.53	85.02
3	固定收益投资	55,432,858.90	4.59
	其中：债券	55,432,858.90	4.59
	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	58,161,615.58	4.82
8	其他各项资产	37,604,067.16	3.11
9	合计	1,207,449,222.73	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：7,765,843.56 元人民币，占期末集合计划资产净值比例 0.66%。

### 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	-	-
B	采矿业	3,569,760.00	0.30
C	制造业	11,459,663.00	0.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,435,632.00	0.29
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,502,950.00	0.30
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	21,968,005.00	1.86

### 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	-	-
消费者常用品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公用事业	7,765,843.56	0.66
房地产	-	-
合计	7,765,843.56	0.66

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	000683	远兴能源	931,700	9,792,167.00	0.83
2	00916	龙源电力	599,000	7,765,843.56	0.66
3	601088	中国神华	107,200	3,569,760.00	0.30
4	600941	中国移动	57,900	3,502,950.00	0.30
5	600900	长江电力	148,600	3,435,632.00	0.29
6	002984	森麒麟	53,600	1,667,496.00	0.14

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	601398	工商银行	30,756,375.00	2.26
2	600519	贵州茅台	20,703,908.08	1.52
3	00916	龙源电力	18,212,678.11	1.34

4	300750	宁德时代	14,800,883.00	1.09
5	02318	中国平安	5,484,039.09	0.40
6	601318	中国平安	6,246,154.00	0.46
7	002028	思源电气	10,372,208.77	0.76
8	000683	远兴能源	8,877,301.00	0.65
9	601888	中国中免	7,585,366.80	0.56
10	600600	青岛啤酒	6,614,865.00	0.49
11	300059	东方财富	6,537,707.93	0.48
12	600048	保利发展	6,457,740.84	0.47
13	600585	海螺水泥	6,251,964.00	0.46
14	600029	南方航空	5,953,428.00	0.44
15	002705	新宝股份	5,878,699.00	0.43
16	000001	平安银行	5,751,497.70	0.42
17	000830	鲁西化工	5,721,244.00	0.42
18	03690	美团-W	5,508,602.57	0.40
19	002594	比亚迪	5,148,065.00	0.38
20	300308	中际旭创	4,981,434.00	0.37

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	601398	工商银行	31,623,459.00	2.32
2	600519	贵州茅台	18,131,160.00	1.33
3	300750	宁德时代	14,179,947.00	1.04
4	600029	南方航空	14,161,337.00	1.04
5	00916	龙源电力	13,855,106.13	1.02
6	002705	新宝股份	11,782,605.40	0.87
7	02318	中国平安	5,456,162.96	0.40
8	601318	中国平安	5,399,953.00	0.40
9	300059	东方财富	10,837,202.60	0.80
10	002028	思源电气	9,529,742.00	0.70
11	002594	比亚迪	9,402,941.00	0.69
12	601872	招商轮船	7,516,388.00	0.55
13	603799	华友钴业	7,499,244.00	0.55
14	002078	太阳纸业	6,748,848.00	0.50
15	002311	海大集团	6,716,036.00	0.49
16	002648	卫星化学	6,636,882.03	0.49
17	600600	青岛啤酒	6,315,444.00	0.46
18	600048	保利发展	6,273,681.00	0.46
19	09992	泡泡玛特	6,113,935.51	0.45
20	601888	中国中免	6,101,266.00	0.45

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	249,828,198.23
卖出股票收入（成交）总额	285,803,358.01

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	55,432,858.90	4.70
	其中：政策性金融债	55,432,858.90	4.70
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	55,432,858.90	4.70

#### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	200402	20 农发 02	200,000	20,131,698.63	1.71
2	200202	20 国开 02	200,000	20,058,591.78	1.70
3	210216	21 国开 16	150,000	15,242,568.49	1.29

#### 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

本集合计划投资范围不包括股指期货。

## 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

本集合计划投资范围不包括国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本集合计划投资范围不包括国债期货。

## 7.12 本报告期投资基金情况

### 7.12.1 投资政策及风险说明

#### (1) 投资政策：

本集合计划通过定量分析和定性调研相结合的方法，通过基金季报、中期报告、年报、净值等公开披露信息进行风险、收益以及风险调整后的收益等指标分析，构建基金数据库和基金经理数据库；在定量分析的基础上，结合定性调研，通过基金公司的管理模式、考核机制等信息对基金经理的行为进行进一步验证，跟踪考察基金经理的投资理念、投资行为的变化，全方位审视基金产品。

本集合计划的投资组合比例为：投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额的比例不低于计划资产的 80%，其中，投资于股票、股票型基金和权益类资产比例不低于 60% 的混合型基金合计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%），投资于商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）份额的比例不高于集合计划资产的 10%。

报告期内，本集合计划投资运作符合合同约定的投资政策、投资限制等要求。

#### (2) 本集合计划特定风险：

1) 资产管理合同生效后，原光大阳光基中宝（阳光 2 号二期）集合资产管理计划份额变更为 A 类份额。集合计划 A 类份额、C 类份额设置锁定持有期，锁定持有期为 3 个月，在锁定持有期内不办理赎回业务。锁定持有期结束后即进入开放持有期，每份 A 类份额、C 类份额在开放持有期期间的开放日可以办理赎回业务。因此 A 类份额、C 类份额的份额持有人面临在锁定持有期内不能赎回资产管理计划份额的风险。

2) 本集合计划为混合型 FOF，由于本集合计划主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额，持有基金的预期风险和预期收益间接成为本集合计划的风险和预期收益。理论上，本集合计划预期风险和预期收益高于债券型基金、债券型 FOF、债券型集合计划和货币市场基金、货币型 FOF，低于股票型基金、股票型 FOF、股票型集合计划。

## 7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	010709	安信医药健康股票 A	契约型开放式	45,172,644.22	59,650,476.69	5.06	否
2	004868	交银股息优化	契约型开放式	20,239,918.59	57,106,930.30	4.84	否
3	519702	交银趋势优先	契约型开放式	12,447,437.03	53,802,801.82	4.56	否
4	013511	汇丰晋信低碳先锋股票 C	契约型开放式	11,300,079.30	49,298,855.96	4.18	否
5	006551	中庚价值领航	契约型开放式	19,685,383.13	48,426,042.50	4.11	否
6	450001	国富中国收益混合	契约型开放式	29,525,751.24	41,781,890.58	3.54	否
7	010696	工银金融地产混合 C	契约型开放式	16,000,000.00	41,376,000.00	3.51	否
8	003435	博时鑫泽灵活配置混合 C	契约型开放式	18,772,989.21	40,042,785.98	3.39	否
9	166001	中欧新趋势混合 (LOF) A	上市契约型开放式 (LOF)	26,814,580.36	38,867,734.23	3.29	否

10	260112	景顺长城能源基建混合	契约型开放式	21,378,179.19	38,352,453.47	3.25	否
11	511990	华宝添益	交易型开放式 (ETF)	374,609.00	37,460,525.39	3.18	否
12	009300	西部利得中证 500 指数增强 (LOF)C	上市契约型开放式 (LOF)	19,900,000.00	34,395,160.00	2.92	否
13	003299	嘉实物流产业股票 C	契约型开放式	12,654,193.41	32,774,360.93	2.78	否
14	540003	汇丰晋信动态策略 A	契约型开放式	6,500,000.00	31,731,050.00	2.69	否
15	009846	国富港股通远见价值混合	契约型开放式	38,000,000.00	31,289,200.00	2.65	否
16	001736	圆信永丰优加生活股票	契约型开放式	9,617,515.46	30,399,042.87	2.58	否
17	750001	安信策略精选灵活配置混合	契约型开放式	11,339,623.16	29,698,473.06	2.52	否
18	001882	中欧价值发现	契约型开放式	10,434,098.06	26,030,987.84	2.21	否
19	000566	华泰柏瑞创新升级混合	契约型开放式	8,363,952.79	25,953,345.51	2.20	否

		合 A					
20	519003	海富通 收益增 长混合	契约 型开 放式	9,061,622.11	22,681,240.14	1.92	否
21	007130	中庚小 盘价值 股票	契约 型开 放式	9,726,193.95	21,849,894.71	1.85	否
22	001763	广发多 策略混 合	契约 型开 放式	11,320,735.07	21,792,415.01	1.85	否
23	005445	华宝价 值发现 混合	契约 型开 放式	13,486,859.33	21,694,961.92	1.84	否
24	001445	华安国 企改革 主题灵 活配置 混合	契约 型开 放式	5,142,453.07	20,106,991.50	1.70	否
25	001347	富国新 收益灵 活配置 混合 C	契约 型开 放式	9,982,552.42	19,695,575.92	1.67	否
26	159905	深红利	交易 型开 放式 (ETF)	9,190,000.00	19,666,600.00	1.67	否
27	009886	新华景 气行业 混合 C	契约 型开 放式	15,521,930.88	17,527,364.35	1.49	否
28	040015	华安动 态灵活 配置混 合	契约 型开 放式	2,930,000.00	14,688,090.00	1.25	否
29	159920	恒生 ETF	交易 型开 放式	11,790,800.00	13,972,098.00	1.18	否

			(ETF)				
30	515650	富国中证消费 50ETF	交易型开放式 (ETF)	8,202,400.00	11,688,420.00	0.99	否
31	011127	富国清洁能源产业灵活配置混合 C	契约型开放式	4,846,459.64	11,438,614.04	0.97	否
32	005001	交银持续成长主题混合	契约型开放式	4,686,225.80	10,734,737.44	0.91	否
33	007455	富国蓝筹精选股票 (QDII)	契约型开放式	5,234,530.42	10,495,233.49	0.89	否
34	002556	博时丝路主题股票 C	契约型开放式	4,868,549.17	10,238,558.90	0.87	否
35	001508	富国新动力灵活配置混合 A	契约型开放式	3,210,982.66	10,207,713.88	0.87	否
36	570001	诺德价值优势混合	契约型开放式	3,152,866.24	10,161,687.89	0.86	否
37	288001	华夏经典配置混合	契约型开放式	4,498,817.07	9,438,518.21	0.80	否

## 7.13 投资组合报告附注

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

本集合计划投资的前十名证券的发行主体本报告期未出现被监管部门立案调查，或在报告编

制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本集合计划投资的前十名股票未超出集合计划合同规定的备选股票库。

### 7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	674,222.66
2	应收清算款	36,855,793.66
3	应收股利	70,442.40
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,608.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,604,067.16

### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本集合计划本期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

### 7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

## § 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)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
光大阳光 3 个月持有 (FOF) A	3,383	126,651.01	56,857,978.42	13.27	371,602,378.35	86.73
光大阳光	1,712	157,822.09	-	-	270,191,419.08	100.00

3 个月持有 (FOF) C						
合计	5,095	137,124.98	56,857,978.42	8.14	641,793,797.43	91.86

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 3 个月持有 (FOF) A	242,050.52	0.0565
	光大阳光 3 个月持有 (FOF) C	5,336.78	0.0020
	合计	247,387.30	0.0354

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 3 个月持有 (FOF) A	0~10
	光大阳光 3 个月持有 (FOF) C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	光大阳光 3 个月持有 (FOF) A	0
	光大阳光 3 个月持有 (FOF) C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	光大阳光 3 个月持有 (FOF) A	光大阳光 3 个月持有 (FOF) C
基金合同生效日 (2021 年 7 月 22 日) 基金份额总额	368,217,027.83	-
本报告期期初基金份额总额	445,971,468.51	285,463,376.52

本报告期基金总申购份额	213,131.71	963,499.25
减：本报告期基金总赎回份额	17,724,243.45	16,235,456.69
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	428,460,356.77	270,191,419.08

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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期持有的基金未发生重大影响事件。

### 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本集合计划报告期未改聘会计师事务所。

### 10.7 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。

### 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.8.1 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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	535,631,556.24	100.00	876,352.48	100.00	-

注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易（如有）而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

2、交易单元的选择标准和程序

(1) 选择标准

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

(2) 选择程序

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

3、本报告期内无新增券商交易单元。

10.8.2 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		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
光大证券	-	-	205,300,000.00	100.00	-	-	1,757,419,494.27	100.00

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	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	关于旗下参公集合资产管理计划增加上海好买基金销售有限公司为代理销售机构并开通定期定额投资业务的公告	中国证监会规定的媒介	2022年02月08日
3	关于旗下参公集合资产管理计划增加北京汇成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06月13日

	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

本集合计划本报告期内不存在单一投资者持有基金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 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 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 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划资产管理合同》；

3、《光大阳光 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划托管协议》；

4、《光大阳光 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 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](http://www.ebscn-am.com)

上海光大证券资产管理有限公司

2022 年 8 月 31 日