

光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置 混合型集合资产管理计划 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：广发银行股份有限公司

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。

集合计划托管人广发银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2022 年 8 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	6
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	11
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	21
§ 7 投资组合报告	51
7.1 期末基金资产组合情况	51
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
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	52
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	68

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	69
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	69
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	69
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	69
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	69
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	69
7.12	市场中性策略执行情况	69
7.13	投资组合报告附注	70
§ 8	基金份额持有人信息	71
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	72
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	72
§ 9	开放式基金份额变动	73
§ 10	重大事件揭示	73
10.1	基金份额持有人大会决议	73
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	73
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	73
10.4	基金投资策略的改变	73
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	73
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	74
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	74
10.8	其他重大事件	74
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	75
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	75
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	75
§ 12	备查文件目录	75
12.1	备查文件目录	75
12.2	存放地点	75
12.3	查阅方式	75

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划		
基金简称	光大阳光对冲 6 个月持有混合		
基金主代码	860010		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2020 年 3 月 25 日		
基金管理人	上海光大证券资产管理有限公司		
基金托管人	广发银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	365,160,363.36 份		
基金合同存续期	3 年		
下属分级基金的基金简称	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C
下属分级基金的交易代码	860010	860028	860029
报告期末下属分级基金的份额总额	2,813,756.51 份	38,364,346.12 份	323,982,260.73 份

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

2.2 基金产品说明

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

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海光大证券资产管理有限公司	广发银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	朱轶	顾洪峰
	联系电话	021-32068300	010-65169885
	电子邮箱	zhuyi1@ebscn.com	guhongfeng@cgbchina.com.cn
客户服务电话		95525	4008308003
传真		021-32068585	010-65169555
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层	广东省广州市越秀区东风东路 713 号
办公地址		中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层	北京市西城区菜市口大街 1 号院 2 号楼信托大厦
邮政编码		200127	100053
法定代表人		熊国兵	王凯

2.4 信息披露方式

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

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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)		
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C
本期已实现收益	35,928.29	575,643.70	3,631,149.58
本期利润	6,916.59	196,009.15	550,945.24
加权平均基金份额本期利润	0.0023	0.0050	0.0015
本期加权平均净值利润率	0.22%	0.49%	0.14%
本期基金份额净值增长率	0.27%	0.50%	0.31%
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	143,112.94	1,535,691.53	10,029,355.64
期末可供分配基金份额利润	0.0509	0.0400	0.0310

期末基金资产净值	2,956,869.45	39,900,037.65	334,011,616.37
期末基金份额净值	1.0509	1.0400	1.0310
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	2.82%	4.00%	3.10%

注：1、表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日，“本期”指 2022 年 1 月 1 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（例如，集合计划的申购赎回费、集合计划转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、本期已实现收益指集合计划本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用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，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰小数（为期末余额，不是当期发生数）。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

光大阳光对冲 6 个月持有混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.34%	0.23%	0.21%	0.01%	0.13%	0.22%
过去三个月	0.32%	0.25%	0.63%	0.01%	-0.31%	0.24%
过去六个月	0.27%	0.22%	1.25%	0.01%	-0.98%	0.21%
过去一年	-3.07%	0.26%	2.53%	0.01%	-5.60%	0.25%
自基金合同生效起至今	2.82%	0.27%	5.83%	0.01%	-3.01%	0.26%

光大阳光对冲 6 个月持有混合 B

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.38%	0.23%	0.21%	0.01%	0.17%	0.22%
过去三个月	0.44%	0.25%	0.63%	0.01%	-0.19%	0.24%
过去六个月	0.50%	0.22%	1.25%	0.01%	-0.75%	0.21%
过去一年	-2.59%	0.26%	2.53%	0.01%	-5.12%	0.25%
自基金合同生效起至今	4.00%	0.27%	5.83%	0.01%	-1.83%	0.26%

光大阳光对冲 6 个月持有混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.35%	0.23%	0.21%	0.01%	0.14%	0.22%
过去三个月	0.35%	0.25%	0.63%	0.01%	-0.28%	0.24%
过去六个月	0.31%	0.22%	1.25%	0.01%	-0.94%	0.21%
过去一年	-2.98%	0.26%	2.53%	0.01%	-5.51%	0.25%
自基金合同生效起至今	3.10%	0.27%	5.83%	0.01%	-2.73%	0.26%

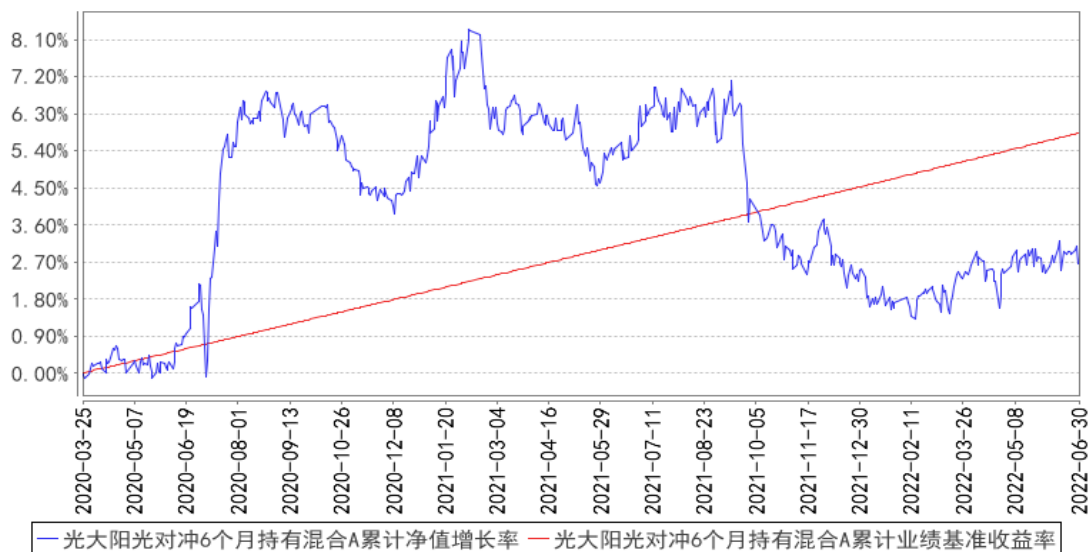
注：1、自基金合同生效日起至今指 2020 年 3 月 25 日-2022 年 6 月 30 日；

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

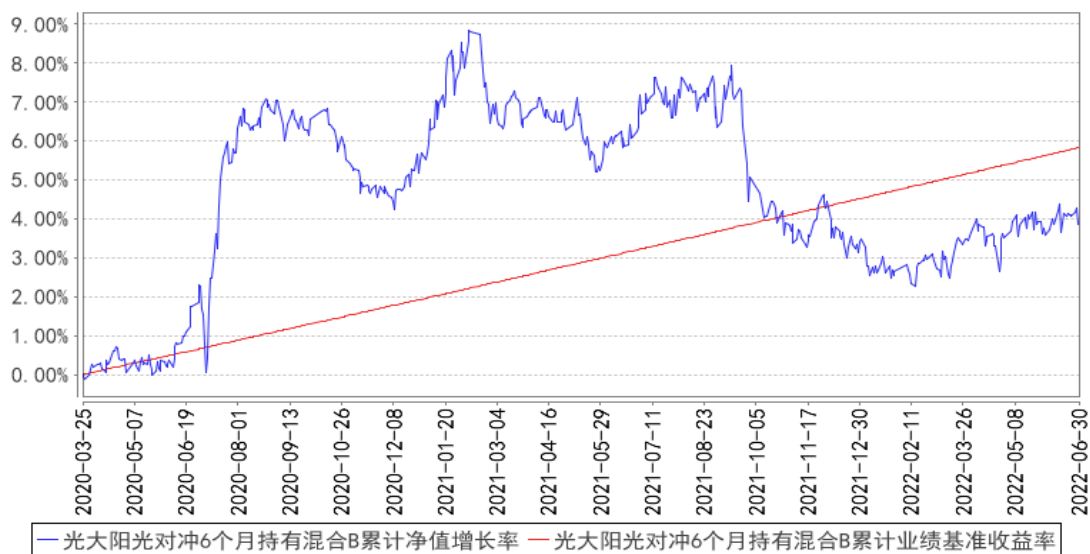
3、B 类份额设立日为 2020 年 3 月 25 日，C 类份额设立日为 2020 年 3 月 25 日。

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

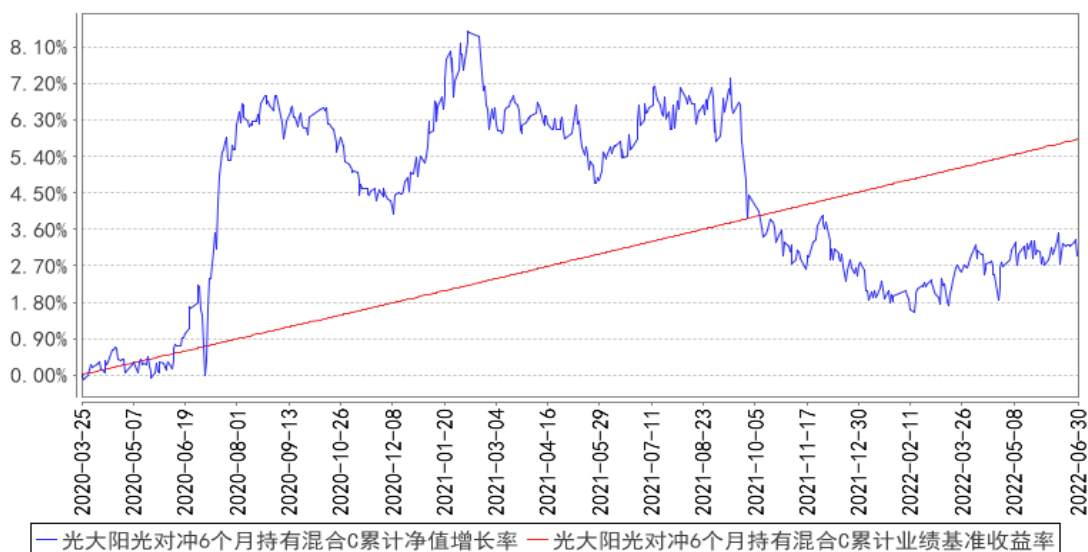
光大阳光对冲6个月持有混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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



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



3.3 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		
李禄俊	量化公募投资部副总经理、本集	2020年3月25日	-	7年	李禄俊先生，本硕博均毕业于北京大学，曾在中金基金管理公司量化投

	合计划投资经理				资部任职，2018 年加入光证资管，现任量化公募投资部副总经理。
--	---------	--	--	--	----------------------------------

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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本集合计划未发生违法违规且对集合计划财产造成损失的异常交易行为。本报告期内未发生管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本产品的投资逻辑是通过量化模型选择盈利优质的上市公司，并结合估值、成长和价量因子等选股模型甄选出胜率较高的个股组合，对冲股指期货以获得绝对收益，再通过配置股票多头、转债等子策略以分散投资风险。

2022 年上半年产品运作主要分为三部分：转债策略、股债多头和对冲策略。报告期内转债市场的整体溢价率仍然较高，因此维持转债较低的仓位配置比例。股票多头部分的持仓均为低估值标的，板块分布以金融基建等稳增长板块为主，尤其偏重估值有吸引力的高股息蓝筹股。量化对

冲策略和多头持股的风格暴露互为平衡，量化选股相对更偏重高成长属性的制造业和创业板企业。本报告期内量化对冲策略新加入机器学习的预测模型，该模型和传统模型的相关性较低，起到了分散投资收益的风险控制效果。对于产品层面，投资组合使用组合优化器等工具控制板块和大类风格的整体暴露水平，以保持在高波动市场环境下的稳定表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 06 月 30 日，光大阳光对冲策略 6 个月持有混合 A 类份额净值为 1.0509 元，本报告期份额净值增长率为 0.27%；光大阳光对冲策略 6 个月持有混合 B 类份额净值为 1.0400 元，本报告期份额净值增长率为 0.50%。光大阳光对冲策略 6 个月持有混合 C 类份额净值为 1.0310 元，本报告期份额净值增长率为 0.31%。

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 年上半年宏观数据显示基建投资增速显著回升，制造业投资增速从高位回落，房地产投资保持负增长。上半年经济增速下行固然有疫情因素，但不容忽视非疫情因素，即中央经济工作会议所提到的三重压力“需求收缩、供给冲击和预期转弱”对我国经济的抑制因素。

展望下半年，国内大部分地区疫情缓解，经济活动存在自发修复、财政强力稳增长手段逐步落地，经济整体将逐步进入复苏阶段，资金中枢或将逐步回归政策利率中枢。近期受到舆情的影响以及积压需求释放的结束，地产销售将持续偏弱。外部影响除了俄乌冲突、美联储加息，海外需求减少对中国带来的负面影响也将持续存在。

A 股市场自 4 月底以来已经反弹两月有余，接力持续稳定上涨需要看到资金层面更明显的改善以及增长预期更实质性的修复。下半年经济大盘和市场走势可能在较为反复，但也为后续行稳致远奠定扎实的基础。

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

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作方面进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划

报告截止日：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	50,885,566.97	20,675,583.61

结算备付金		17,722,871.74	35,682,420.12
存出保证金		23,446,582.63	20,153,603.81
交易性金融资产	6.4.7.2	274,279,599.99	437,331,324.93
其中：股票投资		205,595,877.62	206,821,340.82
基金投资		-	-
债券投资		68,683,722.37	225,582,484.11
资产支持证券投资		-	4,927,500.00
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	15,000,000.00	20,000,000.00
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		350,363.63	5,816,187.82
应收股利		-	-
应收申购款		300.00	21,920.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	2,690,399.47
资产总计		381,685,284.96	542,371,439.76
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		63,213.89	-
应付赎回款		1,576,347.32	2,339,008.95
应付管理人报酬		317,751.26	442,982.11
应付托管费		63,299.24	88,318.73
应付销售服务费		112,474.17	161,396.67
应付投资顾问费		-	-
应交税费		160,841.83	317.46
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	2,522,833.78	41,257,642.20
负债合计		4,816,761.49	44,289,666.12
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	365,160,363.36	484,280,742.71
其他综合收益	6.4.7.11	-	-

未分配利润	6.4.7.12	11,708,160.11	13,801,030.93
净资产合计		376,868,523.47	498,081,773.64
负债和净资产总计		381,685,284.96	542,371,439.76

注：1、报告截止日 2022 年 6 月 30 日，本集合计划份额总额为 365,160,363.36 份，其中光大阳光对冲 6 个月持有混合 A 集合计划份额总额为 2,813,756.51 份，集合计划份额净值 1.0509 元；光大阳光对冲 6 个月持有混合 B 集合计划份额总额为 38,364,346.12 份，集合计划份额净值 1.0400 元；光大阳光对冲 6 个月持有混合 C 集合计划份额总额为 323,982,260.73 份，集合计划份额净值 1.0310 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：光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划

本报告期：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	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		4,176,814.56	44,445,587.51
1. 利息收入		466,001.90	10,601,065.01
其中：存款利息收入	6.4.7.13	305,354.44	1,230,205.25
债券利息收入		-	3,087,210.17
资产支持证券利息收入		-	4,919,032.05
买入返售金融资产收入		160,647.46	1,364,617.54
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		7,199,663.22	41,681,350.46
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-23,762,898.61	131,374,665.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	1,018,029.85	1,065,719.21
资产支持证券投资	6.4.7.16	34,689.00	525,782.20
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-

衍生工具收益	6.4.7.18	27,811,942.97	-98,393,842.05
股利收益	6.4.7.19	2,097,900.01	7,109,025.66
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	-3,488,850.56	-7,836,827.96
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		3,422,943.58	29,887,487.76
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,115,214.17	8,849,820.44
2. 托管费	6.4.10.2.2	421,496.83	1,766,371.95
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	757,004.56	3,394,684.73
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-	-
5. 利息支出		183.57	-
其中：卖出回购金融资产支出		183.57	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		23,671.34	1,392,369.45
8. 其他费用	6.4.7.23	105,373.11	14,484,241.19
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		753,870.98	14,558,099.75
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		753,870.98	14,558,099.75
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		753,870.98	14,558,099.75

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：光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划

本报告期：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)	484,280,742.71	-	13,801,030.93	498,081,773.64
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本年期初净资产(基金净值)	484,280,742.71	-	13,801,030.93	498,081,773.64
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-119,120,379.35	-	-2,092,870.82	-121,213,250.17
(一)、综合收益总额	-	-	753,870.98	753,870.98
(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)	-119,120,379.35	-	-2,846,741.80	-121,967,121.15
其中:1.基金申购款	1,419,010.21	-	32,707.54	1,451,717.75
2.基金赎回款	-120,539,389.56	-	-2,879,449.34	-123,418,838.90
(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)	365,160,363.36	-	11,708,160.11	376,868,523.47
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)	1,912,644,697.73	-	103,686,797.14	2,016,331,494.87
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)	1,912,644,697.73	-	103,686,797.14	2,016,331,494.87
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-705,483,281.75	-	-27,674,752.07	-733,158,033.82
(一)、综合收益总额	-	-	14,558,099.75	14,558,099.75

(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)	-705,483,281.75	-	-42,232,851.82	-747,716,133.57
其中:1. 基金申购款	623,779,197.77	-	43,291,679.87	667,070,877.64
2. 基金赎回款	-1,329,262,479.52	-	-85,524,531.69	-1,414,787,011.21
(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)	1,207,161,415.98	-	76,012,045.07	1,283,173,461.05

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

基金管理人负责人

詹朋

主管会计工作负责人

杨薇

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《光大阳光对冲 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》，本集合计划的投资范围为：具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或同意注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券（含超短期融资券）、公司债、中期票据、可交换债券、可转换债券（含可分离可转换债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、股指期货以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本集合计划可以参与融券业务。如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本集合计划的投资组合比例为：股票资产占集合计划资产的比例为 0%-95%；投资银行存款和同业存单合计占比不超过集合计划资产的 20%；本集合计划权益类多头头寸价值减去权益类空头头寸价值，占集合计划资产净值比例范围 0-10%。其中，权益类多头头寸价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合正风险敞口暴露价值及其他权益类工具多头价值的合计值。权益类空头头寸价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合负风险敞口暴露价值及其他权益类工具空头价值的合计值；每个交易日日终，持有的买入股指期货合约价值和持有价证券市值之和，不得超过集合计划资产净值的 95%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金以及

到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于集合计划资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本集合计划投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。本集合计划的业绩比较基准为：中国人民银行公布的同期 1 年期银行定期存款基准利率（税后）+1%。

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》、《光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》和在财务报表附注 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》的规定和相关法律法规的要求，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20,675,583.61元，自应收利息转入的重分类金额为人民币4,908.32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，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20,680,491.93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35,682,420.12元，自应收利息转入的重分类金额为人民币2,098.60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35,684,518.72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20,153,603.81元，自应收利息转入的重分类金额为人民币305.20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20,153,909.01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2,690,399.47元，转出至银行存款的重分类金额为人民币4,908.32元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币2,098.60元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币305.20元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币2,683,087.35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437,331,324.93元，自应收利息转入的重分类金额为人民币2,683,087.35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440,014,412.28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元，自应付利息转入的重分类金额为人民币0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元，转出至卖出回购金融资产款的重分类金额为人民币0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]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	50,885,566.97
等于：本金	50,875,731.94
加：应计利息	9,835.03
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	50,885,566.97

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	196,275,835.25	-	205,595,877.62	9,320,042.37	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	17,200,734.33	69,274.94	17,320,064.84	50,055.57
	银行间市场	50,335,421.92	912,657.53	51,363,657.53	115,578.08
	合计	67,536,156.25	981,932.47	68,683,722.37	165,633.65
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	263,811,991.50	981,932.47	274,279,599.99	9,485,676.02	

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

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-164,712,600.00	-	-	
其中：股指期货投资	-164,712,600.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-164,712,600.00	-	-	

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

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2207	IC2207	-42.00	-54,050,640.00	-2,778,120.00
IC2209	IC2209	-30.00	-38,184,000.00	-3,603,600.00
IF2207	IF2207	-34.00	-45,626,640.00	-3,214,140.00
IF2209	IF2209	-30.00	-40,024,800.00	-3,577,620.00
合计				-13,173,480.00
减：可抵销期货暂收款				-13,173,480.00
净额				-

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本期末本集合计划未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	15,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	15,000,000.00	-

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

本集合计划本期末未持有其他权益工具。

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。

6.4.7.8 其他资产

本集合计划本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,436,399.49

其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,434.29
合计	2,522,833.78

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

光大阳光对冲 6 个月持有混合 A

项目	本期 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	3,112,966.42	3,112,966.42
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-299,209.91	-299,209.91
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	2,813,756.51	2,813,756.51

光大阳光对冲 6 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	39,843,250.89	39,843,250.89
本期申购	114.28	114.28
本期赎回（以“-”号填列）	-1,479,019.05	-1,479,019.05
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	38,364,346.12	38,364,346.12

光大阳光对冲 6 个月持有混合 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	441,324,525.40	441,324,525.40
本期申购	1,418,895.93	1,418,895.93
本期赎回（以“-”号填列）	-118,761,160.60	-118,761,160.60
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	323,982,260.73	323,982,260.73
-----	----------------	----------------

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

光大阳光对冲 6 个月持有混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	464,787.24	-314,903.72	149,883.52
本期利润	35,928.29	-29,011.70	6,916.59
本期基金份额交易产生的变动数	130,161.80	-143,848.97	-13,687.17
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	130,161.80	-143,848.97	-13,687.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	630,877.33	-487,764.39	143,112.94

光大阳光对冲 6 个月持有混合 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	2,320,976.21	-935,538.40	1,385,437.81
本期利润	575,643.70	-379,634.55	196,009.15
本期基金份额交易产生的变动数	-49,384.00	3,628.57	-45,755.43
其中：基金申购款	4.74	-0.17	4.57
基金赎回款	-49,388.74	3,628.74	-45,760.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,847,235.91	-1,311,544.38	1,535,691.53

光大阳光对冲 6 个月持有混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	22,336,881.11	-10,071,171.51	12,265,709.60
本期利润	3,631,149.58	-3,080,204.34	550,945.24
本期基金份额交易产生的变动数	-5,115,544.29	2,328,245.09	-2,787,299.20
其中：基金申购款	62,078.83	-29,375.86	32,702.97
基金赎回款	-5,177,623.12	2,357,620.95	-2,820,002.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	20,852,486.40	-10,823,130.76	10,029,355.64

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	110,980.91

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	190,784.68
其他	3,588.85
合计	305,354.44

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	-23,762,898.61
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	-23,762,898.61

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	1,282,997,385.99
减：卖出股票成本总额	1,303,934,286.30
减：交易费用	2,825,998.30
买卖股票差价收入	-23,762,898.61

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

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	2,113,623.11
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,095,593.26
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	1,018,029.85

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月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	339,844,604.82
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	336,212,958.89
减：应计利息总额	4,719,041.15
减：交易费用	8,198.04
买卖债券差价收入	-1,095,593.26

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

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	34,689.00
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	34,689.00

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

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	4,960,597.18
减：卖出资产支持证券成本总额	4,927,500.00
减：应计利息总额	33,097.18
减：交易费用	0.00
资产支持证券投资收益	0.00

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

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	27,811,942.97

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	2,097,900.01
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	2,097,900.01

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	8,336,573.55
股票投资	10,123,176.25
债券投资	-1,786,602.70
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-

2. 衍生工具	-11,825,424.11
权证投资	-
期货投资	-11,825,424.11
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	-3,488,850.56

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	-
账户维护费	18,600.00
其他	18,338.82
合计	105,373.11

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者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
广发银行股份有限公司	集合计划托管人、集合计划代销机构

光大证券股份有限公司(“光大证券”)	集合计划销售机构、集合计划管理人的股东
--------------------	---------------------

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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(%)
光大证券股份有限公司	2,568,128,451.46	100.00	10,472,585,328.61	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月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	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)
光大证券股份有限公司	262,981,109.60	100.00	141,241,558.09	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月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	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)
光大证券股份有限公司	1,733,500,000.00	100.00	15,139,000,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月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(%)

光大证券股份有限公司	1,307,122.29	100.00	2,436,224.49	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(%)
光大证券股份有限公司	7,661,254.20	100.00	2,791,439.94	100.00

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,115,214.17	8,849,820.44
其中：支付销售机构的客户维护费	1,016,831.62	4,379,825.22

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

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

H为每日应计提的集合计划A类份额管理费

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

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

H为每日应计提的集合计划B类份额管理费

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

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

H为每日应计提的集合计划C类份额管理费

E为前一日的集合计划C类份额的资产净值，C类份额管理费每日计算，逐日累计至每月月末，

按月支付。若遇法定节假日、公休日等, 支付日期顺延。

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

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	421, 496. 83	1, 766, 371. 95

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

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

H 为每日应计提的集合计划托管费

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

若遇法定节假日、公休日等, 支付日期顺延。

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			
	光大阳光对冲 6 个 月持有混合 A	光大阳光对冲 6 个 月持有混合 B	光大阳光对冲 6 个 月持有混合 C	合计
光大证券	-	-	2, 188. 84	2, 188. 84
光证资管	-	-	1. 81	1. 81
合计	-	-	2, 190. 65	2, 190. 65
获得销售服务费的各 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			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	光大阳光对冲 6 个 月持有混合 A	光大阳光对冲 6 个 月持有混合 B	光大阳光对冲 6 个 月持有混合 C	合计
光大证券	-	-	33, 779. 11	33, 779. 11
光证资管	-	-	277. 47	277. 47
合计	-	-	34, 056. 58	34, 056. 58

注：1、销售服务费仅对 C 类份额收取。

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

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

H 为每日应计提的集合计划销售服务费

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本集合计划本期未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

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

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

本集合计划本期未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

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

本报告期管理人未持有本集合计划份额。

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：本报告期除管理人之外的其他关联方未持有本集合计划份额。

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
广发银行股份有限公司	50,885,566.97	110,980.91	41,892,310.59	286,243.80

注：本集合计划的银行存款由基金托管人广发银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

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

本集合计划支付给光大期货的股指期货交易手续费参考市场价格经本集合的管理人与对方协商确定，以包括中国金融期货交易所收取的上交手续费的全额列示。于2022年6月30日，本集合无应付交易手续费余额。于2022年1月1日-2022年6月30日期间，本集合期间交易手续费支出41,441.14元。

本集合计划用于期货交易结算的资金分别存放于光大期货的结算账户和保证金账户中，结算备付金按银行同业利率计息，由光大期货进行结息处理，存出保证金不计息。于2022年6月30日，本集合的结算备付金余额为13,473,796.16元，存出保证金余额为23,191,022.40元。

6.4.11 利润分配情况

本集合计划本报告期末进行利润分配。

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	292	16,226.44	8,768.76	-
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	141	5,992.50	4,514.82	-
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	42	0.00	1,344.84	-
301112	信邦智能	2022年6月20日	6个月	新股流通受限	27.53	45.04	182	5,010.46	8,197.28	-
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	-
301120	新特电气	2022年4月11日	6个月	新股流通受限	13.73	15.49	261	3,583.53	4,042.89	-
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	-
301136	招标股份	2021年12月31日	6个月	新股流通受限	10.52	19.74	2,637	27,741.24	52,054.38	-
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	-

301150	中一科技	2022年4月14日	6个月	新股流通受限	163.56	82.76	99	16,192.44	8,193.24	-
301150	中一科技	2022年06月10日	1-6个月(含)	送/配股流通受限	0.00	82.76	50	0.00	4,138.00	-
301153	中科江南	2022年5月10日	6个月	新股流通受限	33.68	43.98	161	5,422.48	7,080.78	-
301162	国能日新	2022年4月19日	6个月	新股流通受限	45.13	54.11	185	8,349.05	10,010.35	-
301163	宏德股份	2022年4月11日	6个月	新股流通受限	26.27	32.33	99	2,600.73	3,200.67	-
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	新股流通受限	64.08	37.52	171	10,957.68	6,415.92	-
301206	三元生物	2022年1月26日	6个月	新股流通受限	109.30	45.69	240	26,232.00	10,965.60	-
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	120	0.00	5,482.80	-
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	2,188	8,314.40	13,981.32	-
301216	万凯新材	2022年3月21日	6个月	新股流通受限	35.68	29.84	423	15,092.64	12,622.32	-
301217	铜冠铜箔	2022年1月20日	6个月	新股流通受限	17.27	14.83	1,619	27,960.13	24,009.77	-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	6个月	新股流通受限	173.98	87.82	68	11,830.64	5,971.76	-
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	54	0.00	4,742.28	-
301222	浙江恒	2022年	6个月	新股流	33.98	28.96	128	4,349.44	3,706.88	-

	威	3月2日		通受限							
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	185	7,270.50	7,017.05		-
301237	和顺科技	2022年 3月16日	6个月	新股流 通受限	56.69	41.86	110	6,235.90	4,604.60		-
301239	普瑞眼科	2022年 6月22日	1个月 内(含)	新股流 通受限	33.65	33.65	2,475	83,283.75	83,283.75		-
301239	普瑞眼科	2022年 6月22日	6个月	新股流 通受限	33.65	33.65	276	9,287.40	9,287.40		-
301248	杰创智能	2022年 4月13日	6个月	新股流 通受限	39.07	29.87	163	6,368.41	4,868.81		-
301256	华融化学	2022年 3月14日	6个月	新股流 通受限	8.05	10.08	867	6,979.35	8,739.36		-
301258	富士莱	2022年 3月21日	6个月	新股流 通受限	48.30	41.68	126	6,085.80	5,251.68		-
301259	艾布鲁	2022年 4月18日	6个月	新股流 通受限	18.39	24.94	150	2,758.50	3,741.00		-
301263	泰恩康	2022年 3月22日	6个月	新股流 通受限	19.93	31.38	351	6,995.43	11,014.38		-
301266	宇邦新材	2022年 5月30日	6个月	新股流 通受限	26.86	47.07	204	5,479.44	9,602.28		-
301268	铭利达	2022年 3月29日	6个月	新股流 通受限	28.50	34.87	269	7,666.50	9,380.03		-
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		-
301286	侨源股份	2022年 6月6日	6个月	新股流 通受限	16.91	19.79	288	4,870.08	5,699.52		-
301288	清研环境	2022年 4月14日	6个月	新股流 通受限	19.09	19.98	135	2,577.15	2,697.30		-

301298	东利机械	2022 年 5 月 27 日	6 个月	新股流 通受限	12.68	20.83	206	2,612.08	4,290.98	-
688237	超卓航 科	2022 年 6 月 24 日	1 个月 内(含)	新股未 上市	41.27	41.27	1,248	51,504.96	51,504.96	-
688400	凌云光	2022 年 6 月 27 日	1 个月 内(含)	新股未 上市	21.93	21.93	4,059	89,013.87	89,013.87	-

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参与银行间市场债券正回购。

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参与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参与转融通证券出借业务。

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广发银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。

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

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

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

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	-	30,030,000.00
合计	-	30,030,000.00

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级中包含国债、政策性金融债、央票以及未有第三方机构评级的其他债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

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。

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	35,433,003.34	19,980,892.50
AAA以下	22,980,365.61	23,940,591.61
未评级	10,270,353.42	151,631,000.00
合计	68,683,722.37	195,552,484.11

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

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	-	4,927,500.00
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	4,927,500.00

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。

6.4.13.2.6 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。

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	50,885,566.97	-	-	-	50,885,566.97
结算备付金	17,722,871.74	-	-	-	17,722,871.74
存出保证金	23,446,582.63	-	-	-	23,446,582.63
交易性金融资产	58,347,896.83	10,270,353.42	65,472.12	205,595,877.62	274,279,599.99
买入返售金融资产	15,000,000.00	-	-	-	15,000,000.00
应收申购款	-	-	-	300.00	300.00
应收清算款	-	-	-	350,363.63	350,363.63
资产总计	165,402,918.17	10,270,353.42	65,472.12	205,946,541.25	381,685,284.96
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,576,347.32	1,576,347.32
应付管理人报酬	-	-	-	317,751.26	317,751.26
应付托管费	-	-	-	63,299.24	63,299.24
应付清算款	-	-	-	63,213.89	63,213.89
应付销售服务费	-	-	-	112,474.17	112,474.17
应交税费	-	-	-	160,841.83	160,841.83
其他负债	-	-	-	2,522,833.78	2,522,833.78
负债总计	-	-	-	4,816,761.49	4,816,761.49
利率敏感度缺口	165,402,918.17	10,270,353.42	65,472.12	201,129,779.76	376,868,523.47

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	20,675,583.61	-	-	-	20,675,583.61
结算备付金	35,682,420.12	-	-	-	35,682,420.12
存出保证金	20,153,603.81	-	-	-	20,153,603.81
交易性金融资产	34,957,500.00	124,626,114.18	70,926,369.93	206,821,340.82	437,331,324.93
买入返售金融资产	20,000,000.00	-	-	-	20,000,000.00
应收申购款	-	-	-	21,920.00	21,920.00
应收清算款	-	-	-	5,816,187.82	5,816,187.82
其他资产	-	-	-	2,690,399.47	2,690,399.47
资产总计	131,469,107.54	124,626,114.18	70,926,369.93	215,349,848.11	542,371,439.76
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,339,008.95	2,339,008.95
应付管理人报酬	-	-	-	442,982.11	442,982.11
应付托管费	-	-	-	88,318.73	88,318.73
应付销售服务费	-	-	-	161,396.67	161,396.67
应交税费	-	-	-	317.46	317.46
其他负债	-	-	-	41,257,642.20	41,257,642.20
负债总计	-	-	-	44,289,666.12	44,289,666.12
利率敏感度缺口	131,469,107.54	124,626,114.18	70,926,369.93	171,060,181.99	498,081,773.64

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	-71,316.01	-1,490,755.71
	市场利率下降 25 个基点	71,316.01	1,490,755.71

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本集合计划的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

无。

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	205,595,877.62	54.55	206,821,340.82	41.52
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	205,595,877.62	54.55	206,821,340.82	41.52

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%	9,798,758.75	9,800,999.17
	沪深 300 指数下降	-9,798,758.75	-9,800,999.17

	5%		
--	----	--	--

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

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	222,371,170.14	248,828,181.83
第二层次	51,587,460.11	188,503,143.10
第三层次	320,969.74	-
合计	274,279,599.99	437,331,324.93

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	205,595,877.62	53.87
	其中：股票	205,595,877.62	53.87
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	68,683,722.37	17.99
	其中：债券	68,683,722.37	17.99
	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	15,000,000.00	3.93
	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	68,608,438.71	17.98
8	其他各项资产	23,797,246.26	6.23
9	合计	381,685,284.96	100.00

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	330,154.00	0.09
B	采矿业	11,884,802.75	3.15
C	制造业	121,120,747.50	32.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,434,827.00	1.71
E	建筑业	8,000,034.00	2.12
F	批发和零售业	4,419,094.98	1.17
G	交通运输、仓储和邮政业	5,365,569.00	1.42
H	住宿和餐饮业	109,764.80	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,344,689.78	2.21
J	金融业	31,063,639.62	8.24
K	房地产业	2,848,577.00	0.76
L	租赁和商务服务业	867,751.00	0.23
M	科学研究和技术服务业	190,378.75	0.05

N	水利、环境和公共设施管理业	111,754.63	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,349,850.81	0.62
R	文化、体育和娱乐业	1,685,176.00	0.45
S	综合	469,066.00	0.12
	合计	205,595,877.62	54.55

注：本集合计划本报告期末持有港股通交易机制投资的港股。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	600519	贵州茅台	2,619	5,355,855.00	1.42
2	300750	宁德时代	7,416	3,960,144.00	1.05
3	601328	交通银行	598,800	2,982,024.00	0.79
4	601288	农业银行	964,900	2,913,998.00	0.77
5	601998	中信银行	598,100	2,840,975.00	0.75
6	600282	南钢股份	823,400	2,593,710.00	0.69
7	600438	通威股份	42,006	2,514,479.16	0.67
8	600089	特变电工	88,100	2,413,059.00	0.64
9	000858	五粮液	11,500	2,322,195.00	0.62
10	601939	建设银行	375,700	2,276,742.00	0.60
11	600390	五矿资本	464,900	2,273,361.00	0.60
12	000651	格力电器	67,200	2,265,984.00	0.60
13	603659	璞泰来	26,400	2,228,160.00	0.59
14	600809	山西汾酒	6,000	1,948,800.00	0.52
15	002460	赣锋锂业	12,400	1,843,880.00	0.49
16	000568	泸州老窖	7,202	1,775,581.08	0.47
17	600036	招商银行	41,909	1,768,559.80	0.47
18	601012	隆基绿能	26,509	1,766,294.67	0.47
19	601319	中国人保	343,600	1,738,616.00	0.46
20	601899	紫金矿业	184,629	1,722,588.57	0.46
21	002304	洋河股份	9,400	1,721,610.00	0.46
22	601186	中国铁建	216,200	1,707,980.00	0.45
23	002812	恩捷股份	6,800	1,703,060.00	0.45
24	601166	兴业银行	82,657	1,644,874.30	0.44
25	601919	中远海控	112,840	1,568,476.00	0.42
26	600919	江苏银行	215,400	1,533,648.00	0.41
27	300482	万孚生物	37,300	1,518,483.00	0.40
28	601318	中国平安	31,326	1,462,610.94	0.39

29	600901	江苏租赁	272,600	1,398,438.00	0.37
30	002129	TCL中环	23,600	1,389,804.00	0.37
31	603882	金域医学	16,800	1,386,840.00	0.37
32	600141	兴发集团	31,200	1,372,488.00	0.36
33	601857	中国石油	251,500	1,332,950.00	0.35
34	603392	万泰生物	8,260	1,282,778.00	0.34
35	002594	比亚迪	3,600	1,200,564.00	0.32
36	002920	德赛西威	7,600	1,124,800.00	0.30
37	601088	中国神华	33,100	1,102,230.00	0.29
38	300316	晶盛机电	16,200	1,094,958.00	0.29
39	600486	扬农化工	8,200	1,092,896.00	0.29
40	603799	华友钴业	11,350	1,085,287.00	0.29
41	300661	圣邦股份	5,950	1,083,019.00	0.29
42	601985	中国核电	147,300	1,010,478.00	0.27
43	600426	华鲁恒升	34,400	1,004,480.00	0.27
44	000983	山西焦煤	74,000	990,860.00	0.26
45	601668	中国建筑	180,100	958,132.00	0.25
46	002078	太阳纸业	77,700	956,487.00	0.25
47	300390	天华超净	10,900	952,660.00	0.25
48	600018	上港集团	159,500	929,885.00	0.25
49	600905	三峡能源	144,600	909,534.00	0.24
50	601390	中国中铁	145,900	895,826.00	0.24
51	300244	迪安诊断	27,800	864,580.00	0.23
52	000625	长安汽车	49,740	861,496.80	0.23
53	603456	九洲药业	16,600	858,220.00	0.23
54	002756	永兴材料	5,600	852,376.00	0.23
55	601618	中国中冶	242,900	850,150.00	0.23
56	601009	南京银行	80,900	842,978.00	0.22
57	002466	天齐锂业	6,600	823,680.00	0.22
58	688005	容百科技	6,327	818,966.88	0.22
59	002709	天赐材料	13,100	812,986.00	0.22
60	600522	中天科技	35,100	810,810.00	0.22
61	600887	伊利股份	20,800	810,160.00	0.21
62	601615	明阳智能	23,400	790,920.00	0.21
63	002240	盛新锂能	13,100	790,716.00	0.21
64	600900	长江电力	33,900	783,768.00	0.21
65	600546	山煤国际	40,200	782,292.00	0.21
66	600926	杭州银行	52,221	782,270.58	0.21
67	603993	洛阳钼业	136,200	780,426.00	0.21
68	603613	国联股份	8,360	740,696.00	0.20
69	600499	科达制造	34,600	714,144.00	0.19
70	600690	海尔智家	25,600	702,976.00	0.19

71	002497	雅化集团	21,200	692,180.00	0.18
72	601601	中国太保	28,600	672,958.00	0.18
73	300450	先导智能	10,500	663,390.00	0.18
74	600795	国电电力	169,000	660,790.00	0.18
75	300014	亿纬锂能	6,700	653,250.00	0.17
76	000333	美的集团	10,300	622,017.00	0.17
77	600050	中国联通	178,100	616,226.00	0.16
78	002555	三七互娱	28,600	607,178.00	0.16
79	002505	鹏都农牧	178,700	605,793.00	0.16
80	601838	成都银行	36,500	605,170.00	0.16
81	300073	当升科技	6,500	587,210.00	0.16
82	603317	天味食品	20,300	577,941.00	0.15
83	300363	博腾股份	7,400	577,126.00	0.15
84	601238	广汽集团	36,100	550,164.00	0.15
85	600022	山东钢铁	309,200	538,008.00	0.14
86	002050	三花智控	19,400	533,112.00	0.14
87	002459	晶澳科技	6,620	522,318.00	0.14
88	601988	中国银行	159,800	520,948.00	0.14
89	600582	天地科技	108,900	520,542.00	0.14
90	600704	物产中大	100,400	515,052.00	0.14
91	002049	紫光国微	2,700	512,244.00	0.14
92	300122	智飞生物	4,600	510,646.00	0.14
93	600985	淮北矿业	35,000	509,600.00	0.14
94	601117	中国化学	53,100	499,671.00	0.13
95	600863	内蒙华电	136,700	498,955.00	0.13
96	600867	通化东宝	48,000	496,320.00	0.13
97	601898	中煤能源	47,700	495,126.00	0.13
98	600028	中国石化	121,200	494,496.00	0.13
99	000970	中科三环	26,185	491,754.30	0.13
100	002821	凯莱英	1,700	491,300.00	0.13
101	603345	安井食品	2,900	486,823.00	0.13
102	300182	捷成股份	87,242	479,831.00	0.13
103	600970	中材国际	49,500	479,655.00	0.13
104	688099	晶晨股份	4,747	479,447.00	0.13
105	601179	中国西电	100,200	468,936.00	0.12
106	600497	驰宏锌锗	90,300	468,657.00	0.12
107	601872	招商轮船	80,500	463,680.00	0.12
108	601138	工业富联	47,100	463,464.00	0.12
109	601128	常熟银行	60,100	459,164.00	0.12
110	000559	万向钱潮	77,300	459,162.00	0.12
111	600016	民生银行	119,200	443,424.00	0.12
112	300037	新宙邦	8,360	439,401.60	0.12

113	603868	飞科电器	5,700	431,775.00	0.11
114	600563	法拉电子	2,100	430,836.00	0.11
115	000778	新兴铸管	85,900	414,038.00	0.11
116	002191	劲嘉股份	38,400	411,648.00	0.11
117	002422	科伦药业	21,800	407,660.00	0.11
118	600325	华发股份	53,800	407,266.00	0.11
119	603605	珀莱雅	2,460	406,342.80	0.11
120	600718	东软集团	35,200	405,152.00	0.11
121	601699	潞安环能	27,700	404,974.00	0.11
122	603986	兆易创新	2,800	398,188.00	0.11
123	600188	兖矿能源	10,000	394,800.00	0.10
124	688122	西部超导	4,200	387,240.00	0.10
125	688981	中芯国际	8,469	382,544.73	0.10
126	601669	中国电建	48,400	380,908.00	0.10
127	601169	北京银行	83,800	380,452.00	0.10
128	600968	海油发展	146,800	378,744.00	0.10
129	600415	小商品城	67,800	377,646.00	0.10
130	600219	南山铝业	101,900	376,011.00	0.10
131	600888	新疆众和	40,800	375,360.00	0.10
132	000063	中兴通讯	14,700	375,291.00	0.10
133	600160	巨化股份	28,300	372,145.00	0.10
134	300170	汉得信息	41,200	371,212.00	0.10
135	002624	完美世界	25,600	367,872.00	0.10
136	002244	滨江集团	41,900	362,435.00	0.10
137	603236	移远通信	2,700	360,882.00	0.10
138	000937	冀中能源	48,183	359,445.18	0.10
139	601717	郑煤机	24,700	355,927.00	0.09
140	002230	科大讯飞	8,600	354,492.00	0.09
141	002252	上海莱士	59,700	354,021.00	0.09
142	000060	中金岭南	79,200	353,232.00	0.09
143	600839	四川长虹	121,900	351,072.00	0.09
144	600251	冠农股份	32,300	344,318.00	0.09
145	002166	莱茵生物	27,000	340,200.00	0.09
146	601991	大唐发电	138,600	336,798.00	0.09
147	600566	济川药业	12,400	336,784.00	0.09
148	600332	白云山	10,600	334,854.00	0.09
149	600373	中文传媒	33,500	334,665.00	0.09
150	000552	靖远煤电	77,100	332,301.00	0.09
151	688388	嘉元科技	3,899	330,908.13	0.09
152	600572	康恩贝	74,500	330,035.00	0.09
153	300832	新产业	7,300	329,303.00	0.09
154	600063	皖维高新	43,300	328,214.00	0.09

155	600873	梅花生物	29,000	327,120.00	0.09
156	600339	中油工程	112,700	325,703.00	0.09
157	601598	中国外运	83,000	322,040.00	0.09
158	600660	福耀玻璃	7,700	321,937.00	0.09
159	002390	信邦制药	46,200	319,242.00	0.08
160	601600	中国铝业	66,900	317,775.00	0.08
161	601658	邮储银行	58,100	313,159.00	0.08
162	300601	康泰生物	6,920	312,645.60	0.08
163	000933	神火股份	23,800	311,304.00	0.08
164	600782	新钢股份	61,600	310,464.00	0.08
165	603599	广信股份	11,020	310,213.00	0.08
166	600000	浦发银行	38,600	309,186.00	0.08
167	601728	中国电信	82,600	308,098.00	0.08
168	300160	秀强股份	37,800	307,314.00	0.08
169	600079	人福医药	18,900	302,400.00	0.08
170	603369	今世缘	5,900	300,900.00	0.08
171	002738	中矿资源	3,240	300,056.40	0.08
172	002655	共达电声	20,000	295,600.00	0.08
173	600019	宝钢股份	48,300	290,766.00	0.08
174	600115	中国东航	52,500	288,225.00	0.08
175	600639	浦东金桥	21,200	288,108.00	0.08
176	600176	中国巨石	16,489	287,073.49	0.08
177	300130	新国都	23,400	286,884.00	0.08
178	002597	金禾实业	6,600	285,978.00	0.08
179	603806	福斯特	4,360	285,667.20	0.08
180	600383	金地集团	21,200	284,928.00	0.08
181	600039	四川路桥	26,800	282,204.00	0.07
182	603766	隆鑫通用	61,000	281,210.00	0.07
183	600273	嘉化能源	25,800	280,188.00	0.07
184	002478	常宝股份	61,300	279,528.00	0.07
185	002291	星期六	14,100	278,616.00	0.07
186	600655	豫园股份	29,500	278,480.00	0.07
187	600811	东方集团	98,000	277,340.00	0.07
188	688556	高测股份	3,420	275,994.00	0.07
189	600389	江山股份	4,500	273,285.00	0.07
190	688298	东方生物	2,381	271,791.15	0.07
191	300532	今天国际	21,000	269,640.00	0.07
192	603876	鼎胜新材	5,900	266,680.00	0.07
193	002258	利尔化学	11,260	265,961.20	0.07
194	002454	松芝股份	20,200	264,620.00	0.07
195	688777	中控技术	3,601	262,008.76	0.07
196	002202	金风科技	17,700	261,960.00	0.07

197	000589	贵州轮胎	59,500	261,800.00	0.07
198	300477	合纵科技	34,000	261,800.00	0.07
199	601216	君正集团	52,700	257,176.00	0.07
200	000543	皖能电力	63,400	252,966.00	0.07
201	300196	长海股份	13,300	251,237.00	0.07
202	600027	华电国际	63,900	251,127.00	0.07
203	300144	宋城演艺	16,300	250,205.00	0.07
204	300533	冰川网络	9,300	244,590.00	0.06
205	601016	节能风电	50,800	243,840.00	0.06
206	600157	永泰能源	152,700	242,793.00	0.06
207	600673	东阳光	27,000	242,730.00	0.06
208	600428	中远海特	50,600	240,856.00	0.06
209	000836	富通信息	81,400	240,130.00	0.06
210	600713	南京医药	48,900	238,143.00	0.06
211	300647	超频三	20,800	233,792.00	0.06
212	600060	海信视像	18,700	233,750.00	0.06
213	600496	精工钢构	50,500	233,310.00	0.06
214	002419	天虹股份	32,500	231,725.00	0.06
215	000878	云南铜业	20,100	228,939.00	0.06
216	000683	远兴能源	21,700	228,067.00	0.06
217	002658	雪迪龙	32,300	227,069.00	0.06
218	002035	华帝股份	39,000	226,980.00	0.06
219	601801	皖新传媒	46,900	226,527.00	0.06
220	600370	三房巷	64,500	226,395.00	0.06
221	600603	广汇物流	35,200	226,336.00	0.06
222	300059	东方财富	8,900	226,060.00	0.06
223	601666	平煤股份	16,600	225,594.00	0.06
224	000090	天健集团	32,400	223,236.00	0.06
225	000425	徐工机械	41,400	223,146.00	0.06
226	601929	吉视传媒	108,800	223,040.00	0.06
227	002805	丰元股份	3,600	222,840.00	0.06
228	002436	兴森科技	19,700	222,019.00	0.06
229	600269	赣粤高速	63,800	221,386.00	0.06
230	603387	基蛋生物	15,520	221,315.20	0.06
231	002623	亚玛顿	5,500	220,330.00	0.06
232	600761	安徽合力	18,500	220,150.00	0.06
233	601800	中国交建	23,700	219,936.00	0.06
234	603538	美诺华	6,900	219,765.00	0.06
235	002643	万润股份	10,500	219,030.00	0.06
236	601866	中远海发	73,000	219,000.00	0.06
237	002328	新朋股份	37,000	217,190.00	0.06
238	000977	浪潮信息	8,200	217,136.00	0.06

239	600035	楚天高速	66,300	216,801.00	0.06
240	000738	航发控制	7,700	216,370.00	0.06
241	002838	道恩股份	8,800	216,128.00	0.06
242	600758	辽宁能源	48,900	215,160.00	0.06
243	601398	工商银行	45,100	215,127.00	0.06
244	002085	万丰奥威	40,000	214,800.00	0.06
245	300177	中海达	26,500	214,385.00	0.06
246	600649	城投控股	50,000	214,000.00	0.06
247	600491	龙元建设	31,100	212,102.00	0.06
248	603323	苏农银行	41,500	211,650.00	0.06
249	002947	恒铭达	11,500	211,600.00	0.06
250	000404	长虹华意	38,700	210,915.00	0.06
251	300398	飞凯材料	9,200	210,312.00	0.06
252	000536	华映科技	97,800	210,270.00	0.06
253	002216	三全食品	10,700	209,613.00	0.06
254	600757	长江传媒	36,700	209,190.00	0.06
255	300121	阳谷华泰	19,300	207,089.00	0.05
256	002850	科达利	1,300	206,700.00	0.05
257	603019	中科曙光	7,100	206,042.00	0.05
258	600705	中航产融	59,500	205,870.00	0.05
259	000667	美好置业	128,500	205,600.00	0.05
260	300739	明阳电路	12,800	205,056.00	0.05
261	002517	恺英网络	36,700	204,786.00	0.05
262	603115	海星股份	8,300	203,931.00	0.05
263	600057	厦门象屿	23,200	203,928.00	0.05
264	002955	鸿合科技	9,300	202,461.00	0.05
265	000989	九芝堂	22,100	201,110.00	0.05
266	002109	兴化股份	34,900	199,628.00	0.05
267	002562	兄弟科技	30,800	199,584.00	0.05
268	600104	上汽集团	11,200	199,472.00	0.05
269	601881	中国银河	20,500	198,235.00	0.05
270	600256	广汇能源	18,800	198,152.00	0.05
271	300043	星辉娱乐	65,700	197,100.00	0.05
272	603379	三美股份	8,800	195,800.00	0.05
273	002839	张家港行	37,000	195,730.00	0.05
274	600206	有研新材	10,100	195,334.00	0.05
275	002267	陕天然气	27,900	195,021.00	0.05
276	601619	嘉泽新能	47,500	194,750.00	0.05
277	000725	京东方 A	49,400	194,636.00	0.05
278	603948	建业股份	6,900	194,235.00	0.05
279	002645	华宏科技	8,800	192,016.00	0.05
280	002128	电投能源	13,300	190,456.00	0.05

281	600059	古越龙山	17,300	190,300.00	0.05
282	601336	新华保险	5,900	189,921.00	0.05
283	605133	嵘泰股份	8,300	189,904.00	0.05
284	600971	恒源煤电	24,000	189,600.00	0.05
285	002391	长青股份	26,700	189,570.00	0.05
286	000069	华侨城 A	29,200	189,508.00	0.05
287	600480	凌云股份	21,300	189,357.00	0.05
288	002288	超华科技	33,600	189,168.00	0.05
289	002004	华邦健康	33,900	189,162.00	0.05
290	002365	永安药业	15,300	188,496.00	0.05
291	000726	鲁泰 A	26,300	188,045.00	0.05
292	603067	振华股份	15,000	187,950.00	0.05
293	000823	超声电子	18,100	187,154.00	0.05
294	600797	浙大网新	31,600	187,072.00	0.05
295	600312	平高电气	23,400	186,732.00	0.05
296	601677	明泰铝业	7,840	186,592.00	0.05
297	600575	淮河能源	59,700	186,264.00	0.05
298	002091	江苏国泰	17,300	185,975.00	0.05
299	300401	花园生物	10,700	185,538.00	0.05
300	002938	鹏鼎控股	6,133	185,277.93	0.05
301	002009	天奇股份	10,000	185,000.00	0.05
302	300133	华策影视	37,100	184,758.00	0.05
303	601886	江河集团	21,800	184,210.00	0.05
304	600780	通宝能源	35,000	184,100.00	0.05
305	300340	科恒股份	12,000	183,720.00	0.05
306	600418	江淮汽车	10,700	183,612.00	0.05
307	600667	太极实业	24,800	183,024.00	0.05
308	002441	众业达	19,400	182,748.00	0.05
309	605368	蓝天燃气	14,500	182,700.00	0.05
310	000728	国元证券	29,300	182,246.00	0.05
311	300057	万顺新材	19,200	181,824.00	0.05
312	600760	中航沈飞	3,000	181,350.00	0.05
313	600073	上海梅林	22,700	180,919.00	0.05
314	300113	顺网科技	12,500	180,875.00	0.05
315	000629	攀钢钒钛	47,500	180,500.00	0.05
316	300184	力源信息	32,800	180,400.00	0.05
317	300769	德方纳米	440	179,819.20	0.05
318	600869	远东股份	34,900	179,735.00	0.05
319	000895	双汇发展	6,100	178,730.00	0.05
320	600664	哈药股份	59,100	177,891.00	0.05
321	300504	天邑股份	10,000	177,600.00	0.05
322	600738	丽尚国潮	24,200	176,418.00	0.05

323	002878	元隆雅图	9,100	175,630.00	0.05
324	002298	中电兴发	26,700	175,152.00	0.05
325	688201	信安世纪	5,266	175,147.16	0.05
326	300181	佐力药业	17,600	174,944.00	0.05
327	000055	方大集团	39,000	174,720.00	0.05
328	603708	家家悦	12,200	173,728.00	0.05
329	300327	中颖电子	3,480	173,338.80	0.05
330	300657	弘信电子	14,900	173,138.00	0.05
331	600111	北方稀土	4,900	172,284.00	0.05
332	000519	中兵红箭	5,900	171,985.00	0.05
333	002625	光启技术	9,900	170,973.00	0.05
334	600172	黄河旋风	19,600	170,912.00	0.05
335	600578	京能电力	54,600	170,898.00	0.05
336	600885	宏发股份	4,060	169,911.00	0.05
337	688008	澜起科技	2,800	169,624.00	0.05
338	605208	永茂泰	10,700	169,381.00	0.04
339	002491	通鼎互联	32,400	168,804.00	0.04
340	002545	东方铁塔	14,800	168,424.00	0.04
341	601229	上海银行	25,700	168,335.00	0.04
342	600123	兰花科创	10,200	167,790.00	0.04
343	600658	电子城	40,300	167,648.00	0.04
344	688155	先惠技术	1,600	166,720.00	0.04
345	003816	中国广核	59,200	165,760.00	0.04
346	600010	宝钢股份	70,500	165,675.00	0.04
347	000408	藏格矿业	5,000	164,700.00	0.04
348	300124	汇川技术	2,500	164,675.00	0.04
349	600987	航民股份	30,800	164,164.00	0.04
350	000877	天山股份	13,300	163,590.00	0.04
351	002580	圣阳股份	19,400	163,154.00	0.04
352	300551	古鳌科技	18,600	162,936.00	0.04
353	300017	网宿科技	30,300	162,408.00	0.04
354	603077	和邦生物	38,100	162,306.00	0.04
355	002583	海能达	33,500	162,140.00	0.04
356	000731	四川美丰	17,800	161,980.00	0.04
357	002648	卫星化学	6,200	160,270.00	0.04
358	601611	中国核建	19,100	160,249.00	0.04
359	603896	寿仙谷	4,130	160,161.40	0.04
360	002815	崇达技术	12,500	160,125.00	0.04
361	002073	软控股份	22,600	160,008.00	0.04
362	603333	尚纬股份	26,100	159,993.00	0.04
363	000002	万 科 A	7,800	159,900.00	0.04
364	000401	冀东水泥	15,000	157,800.00	0.04

365	601339	百隆东方	30,800	156,464.00	0.04
366	002483	润邦股份	24,200	156,332.00	0.04
367	688561	奇安信	2,800	156,240.00	0.04
368	002303	美盈森	45,100	155,595.00	0.04
369	601225	陕西煤业	7,300	154,614.00	0.04
370	300041	回天新材	8,900	154,593.00	0.04
371	001979	招商蛇口	11,500	154,445.00	0.04
372	603290	斯达半导	400	154,360.00	0.04
373	002783	凯龙股份	17,300	153,278.00	0.04
374	000709	河钢股份	67,500	152,550.00	0.04
375	603968	醋化股份	7,400	152,440.00	0.04
376	002669	康达新材	11,400	152,304.00	0.04
377	002375	亚厦股份	30,200	151,302.00	0.04
378	600941	中国移动	2,500	151,250.00	0.04
379	002539	云图控股	9,300	148,707.00	0.04
380	601002	晋亿实业	28,800	148,320.00	0.04
381	002182	云海金属	5,900	147,972.00	0.04
382	601369	陕鼓动力	15,400	147,840.00	0.04
383	600489	中金黄金	20,000	147,800.00	0.04
384	600929	雪天盐业	15,900	147,552.00	0.04
385	601877	正泰电器	4,100	146,698.00	0.04
386	000021	深科技	12,600	146,664.00	0.04
387	300009	安科生物	14,500	146,595.00	0.04
388	688196	卓越新能	1,900	146,300.00	0.04
389	600166	福田汽车	51,500	145,745.00	0.04
390	600967	内蒙一机	15,900	145,008.00	0.04
391	688598	金博股份	490	144,403.00	0.04
392	688066	航天宏图	1,830	144,204.00	0.04
393	600606	绿地控股	36,400	144,144.00	0.04
394	688707	振华新材	1,900	143,773.00	0.04
395	002714	牧原股份	2,600	143,702.00	0.04
396	002801	微光股份	4,800	143,280.00	0.04
397	600048	保利发展	8,100	141,426.00	0.04
398	000001	平安银行	9,400	140,812.00	0.04
399	300117	嘉寓股份	33,800	140,270.00	0.04
400	002396	星网锐捷	6,100	138,104.00	0.04
401	300237	美晨生态	54,500	136,250.00	0.04
402	600309	万华化学	1,400	135,786.00	0.04
403	600580	卧龙电驱	9,300	134,106.00	0.04
404	601718	际华集团	43,200	133,920.00	0.04
405	002908	德生科技	11,600	133,864.00	0.04
406	600348	华阳股份	8,600	132,956.00	0.04

407	601868	中国能建	55,500	131,535.00	0.03
408	600233	圆通速递	6,400	130,496.00	0.03
409	002602	世纪华通	26,900	129,658.00	0.03
410	002416	爱施德	13,900	129,270.00	0.03
411	600787	中储股份	22,600	128,594.00	0.03
412	600369	西南证券	32,300	128,231.00	0.03
413	002736	国信证券	13,300	127,281.00	0.03
414	600392	盛和资源	5,600	126,560.00	0.03
415	002384	东山精密	5,500	126,115.00	0.03
416	002249	大洋电机	20,400	125,256.00	0.03
417	000596	古井贡酒	500	124,830.00	0.03
418	002916	深南电路	1,300	121,823.00	0.03
419	002142	宁波银行	3,400	121,754.00	0.03
420	605080	浙江自然	1,900	121,391.00	0.03
421	002832	比音勒芬	4,700	118,440.00	0.03
422	603444	吉比特	300	116,400.00	0.03
423	600862	中航高科	4,100	115,210.00	0.03
424	600737	中粮糖业	15,100	113,552.00	0.03
425	002271	东方雨虹	2,200	113,234.00	0.03
426	601933	永辉超市	26,400	112,992.00	0.03
427	300856	科思股份	2,600	112,788.00	0.03
428	002180	纳思达	2,200	111,364.00	0.03
429	600258	首旅酒店	4,426	109,764.80	0.03
430	603658	安图生物	2,200	107,558.00	0.03
431	603267	鸿远电子	800	107,464.00	0.03
432	603348	文灿股份	2,000	107,200.00	0.03
433	000567	海德股份	7,210	106,708.00	0.03
434	000411	英特集团	9,980	105,488.60	0.03
435	002223	鱼跃医疗	4,100	105,206.00	0.03
436	000838	财信发展	14,400	103,824.00	0.03
437	600103	青山纸业	40,800	102,408.00	0.03
438	600741	华域汽车	4,400	101,200.00	0.03
439	600085	同仁堂	1,900	100,472.00	0.03
440	688521	芯原股份	2,000	98,800.00	0.03
441	600597	光明乳业	7,800	98,514.00	0.03
442	601608	中信重工	25,800	97,782.00	0.03
443	002212	天融信	9,600	97,440.00	0.03
444	600594	益佰制药	17,400	97,440.00	0.03
445	605198	德利股份	5,300	96,672.00	0.03
446	002405	四维图新	6,400	96,448.00	0.03
447	000563	陕国投A	30,800	96,096.00	0.03
448	688123	聚辰股份	900	95,868.00	0.03

449	600467	好当家	33,600	94,752.00	0.03
450	600017	日照港	31,100	94,544.00	0.03
451	600398	海澜之家	19,700	93,575.00	0.02
452	600665	天地源	26,900	92,805.00	0.02
453	300861	美畅股份	1,000	92,690.00	0.02
454	301239	普瑞眼科	2,751	92,571.15	0.02
455	600585	海螺水泥	2,600	91,728.00	0.02
456	600108	亚盛集团	26,200	91,700.00	0.02
457	601908	京运通	11,400	91,428.00	0.02
458	603368	柳药集团	5,300	91,266.00	0.02
459	003038	鑫铂股份	1,800	90,720.00	0.02
460	600908	无锡银行	16,000	90,080.00	0.02
461	600481	双良节能	5,300	89,305.00	0.02
462	600755	厦门国贸	11,900	89,250.00	0.02
463	600456	宝钛股份	1,500	89,100.00	0.02
464	688400	凌云光	4,059	89,013.87	0.02
465	601918	新集能源	17,400	88,740.00	0.02
466	601599	浙文影业	23,600	87,084.00	0.02
467	300308	中际旭创	2,800	86,940.00	0.02
468	300777	中简科技	1,800	86,760.00	0.02
469	000969	安泰科技	9,700	86,524.00	0.02
470	002048	宁波华翔	5,400	86,508.00	0.02
471	002865	钧达股份	900	85,824.00	0.02
472	603355	莱克电气	3,400	85,782.00	0.02
473	002424	贵州百灵	11,000	84,590.00	0.02
474	605123	派克新材	600	84,432.00	0.02
475	300630	普利制药	2,400	84,360.00	0.02
476	300136	信维通信	5,000	84,250.00	0.02
477	300360	炬华科技	6,300	84,042.00	0.02
478	002352	顺丰控股	1,500	83,715.00	0.02
479	300213	佳讯飞鸿	14,800	83,176.00	0.02
480	600433	冠豪高新	22,100	83,096.00	0.02
481	600163	中闽能源	9,800	82,810.00	0.02
482	600570	恒生电子	1,900	82,726.00	0.02
483	002204	大连重工	18,900	82,593.00	0.02
484	000960	锡业股份	4,900	82,173.00	0.02
485	000733	振华科技	600	81,582.00	0.02
486	600259	广晟有色	1,600	81,040.00	0.02
487	300240	飞力达	9,700	80,995.00	0.02
488	002565	顺灏股份	16,400	80,032.00	0.02
489	600909	华安证券	17,300	78,715.00	0.02
490	002195	二三四五	34,700	78,075.00	0.02

491	002131	利欧股份	39,500	76,630.00	0.02
492	000553	安道麦 A	6,300	76,293.00	0.02
493	002410	广联达	1,400	76,216.00	0.02
494	600765	中航重机	2,300	74,014.00	0.02
495	000417	合肥百货	16,000	73,440.00	0.02
496	300926	博俊科技	3,100	72,385.00	0.02
497	600648	外高桥	5,300	72,080.00	0.02
498	002818	富森美	5,700	71,763.00	0.02
499	601992	金隅集团	25,900	71,743.00	0.02
500	002757	南兴股份	6,100	70,943.00	0.02
501	601689	拓普集团	1,000	68,430.00	0.02
502	600153	建发股份	5,200	67,964.00	0.02
503	000830	鲁西化工	3,900	67,431.00	0.02
504	300418	昆仑万维	4,200	67,200.00	0.02
505	600596	新安股份	3,100	67,115.00	0.02
506	600380	健康元	5,400	66,690.00	0.02
507	002572	索菲亚	2,400	66,000.00	0.02
508	002065	东华软件	10,400	65,728.00	0.02
509	002030	达安基因	3,800	65,322.00	0.02
510	688390	固德威	200	62,602.00	0.02
511	605599	菜百股份	5,700	62,016.00	0.02
512	601860	紫金银行	21,500	61,705.00	0.02
513	600846	同济科技	7,500	59,250.00	0.02
514	002019	亿帆医药	4,200	58,716.00	0.02
515	603026	石大胜华	400	58,140.00	0.02
516	600959	江苏有线	17,800	58,028.00	0.02
517	600875	东方电气	3,500	57,575.00	0.02
518	002387	维信诺	8,500	57,120.00	0.02
519	603127	昭衍新药	500	56,900.00	0.02
520	603259	药明康德	540	56,154.60	0.01
521	600728	佳都科技	8,600	55,556.00	0.01
522	300100	双林股份	5,800	54,752.00	0.01
523	600511	国药股份	2,000	53,560.00	0.01
524	002745	木林森	5,400	52,758.00	0.01
525	301136	招标股份	2,637	52,054.38	0.01
526	688237	超卓航科	1,248	51,504.96	0.01
527	300197	节能铁汉	21,000	50,610.00	0.01
528	600216	浙江医药	3,700	50,505.00	0.01
529	600096	云天化	1,600	50,368.00	0.01
530	601869	长飞光纤	1,600	49,472.00	0.01
531	600177	雅戈尔	7,400	49,062.00	0.01
532	002407	多氟多	1,000	48,910.00	0.01

533	000988	华工科技	2,100	48,657.00	0.01
534	688819	天能股份	1,400	48,412.00	0.01
535	300070	碧水源	9,200	47,932.00	0.01
536	300699	光威复材	800	47,096.00	0.01
537	601077	渝农商行	12,400	45,880.00	0.01
538	603198	迎驾贡酒	700	45,598.00	0.01
539	000528	柳 工	7,000	45,570.00	0.01
540	002557	洽洽食品	800	45,544.00	0.01
541	000402	金 融 街	7,600	45,220.00	0.01
542	002966	苏州银行	7,400	45,140.00	0.01
543	002507	涪陵榨菜	1,300	44,876.00	0.01
544	002465	海格通信	4,900	44,541.00	0.01
545	601298	青岛港	7,900	43,213.00	0.01
546	601106	中国一重	13,800	42,366.00	0.01
547	300072	海新能科	8,300	41,998.00	0.01
548	601156	东航物流	2,100	41,580.00	0.01
549	300474	景嘉微	600	41,034.00	0.01
550	600372	中航电子	2,100	40,719.00	0.01
551	000547	航天发展	3,400	40,596.00	0.01
552	001872	招商港口	2,600	40,560.00	0.01
553	000930	中粮科技	4,400	39,776.00	0.01
554	603927	中科软	1,700	39,644.00	0.01
555	601828	美凯龙	6,400	38,784.00	0.01
556	600126	杭钢股份	7,500	38,400.00	0.01
557	600623	华谊集团	4,600	38,180.00	0.01
558	000997	新 大 陆	2,800	36,988.00	0.01
559	002294	信立泰	1,300	36,530.00	0.01
560	600038	中直股份	800	36,160.00	0.01
561	600236	桂冠电力	5,900	35,931.00	0.01
562	300618	寒锐钴业	600	34,752.00	0.01
563	600350	山东高速	6,300	33,075.00	0.01
564	300257	开山股份	2,200	32,912.00	0.01
565	002500	山西证券	5,700	32,718.00	0.01
566	600549	厦门钨业	1,500	32,430.00	0.01
567	002468	申通快递	2,700	32,184.00	0.01
568	600487	亨通光电	2,200	31,988.00	0.01
569	600642	申能股份	5,600	31,808.00	0.01
570	603858	步长制药	1,600	31,536.00	0.01
571	600208	新湖中宝	11,400	31,464.00	0.01
572	600120	浙江东方	7,700	30,877.00	0.01
573	002532	天山铝业	4,700	30,691.00	0.01
574	688009	中国通号	6,600	29,898.00	0.01

575	688696	极米科技	80	24,629.60	0.01
576	301217	铜冠铜箔	1,619	24,009.77	0.01
577	688383	新益昌	191	21,726.25	0.01
578	688368	晶丰明源	122	19,502.92	0.01
579	301206	三元生物	360	16,448.40	0.00
580	688077	大地熊	180	15,175.80	0.00
581	688330	宏力达	169	14,532.31	0.00
582	301215	中汽股份	2,188	13,981.32	0.00
583	301216	万凯新材	423	12,622.32	0.00
584	301150	中一科技	149	12,331.24	0.00
585	688012	中微公司	100	11,675.00	0.00
586	301263	泰恩康	351	11,014.38	0.00
587	301219	腾远钴业	122	10,714.04	0.00
588	301162	国能日新	185	10,010.35	0.00
589	688095	福昕软件	140	9,940.00	0.00
590	301266	宇邦新材	204	9,602.28	0.00
591	301127	天源环保	851	9,471.63	0.00
592	301268	铭利达	269	9,380.03	0.00
593	688071	华依科技	191	8,831.84	0.00
594	300834	星辉环材	292	8,768.76	0.00
595	301256	华融化学	867	8,739.36	0.00
596	301112	信邦智能	182	8,197.28	0.00
597	601089	福元医药	382	8,041.10	0.00
598	688080	映翰通	182	7,296.38	0.00
599	301153	中科江南	161	7,080.78	0.00
600	301235	华康医疗	185	7,017.05	0.00
601	688630	芯碁微装	106	6,858.20	0.00
602	301196	唯科科技	171	6,415.92	0.00
603	301212	联盛化学	180	5,990.40	0.00
604	301103	何氏眼科	183	5,859.66	0.00
605	301116	益客食品	286	5,851.56	0.00
606	301286	侨源股份	288	5,699.52	0.00
607	301097	天益医疗	115	5,500.45	0.00
608	688398	赛特新材	184	5,253.20	0.00
609	301258	富士莱	126	5,251.68	0.00
610	301248	杰创智能	163	4,868.81	0.00
611	301237	和顺科技	110	4,604.60	0.00
612	301298	东利机械	206	4,290.98	0.00
613	301228	实朴检测	210	4,271.40	0.00
614	301120	新特电气	261	4,042.89	0.00
615	301207	华兰疫苗	70	3,949.40	0.00
616	301259	艾布鲁	150	3,741.00	0.00

617	301222	浙江恒威	128	3,706.88	0.00
618	301137	哈焊华通	210	3,357.90	0.00
619	301279	金道科技	144	3,284.64	0.00
620	301163	宏德股份	99	3,200.67	0.00
621	688698	伟创电气	155	3,154.25	0.00
622	301135	瑞德智能	119	3,124.94	0.00
623	301288	清研环境	135	2,697.30	0.00
624	000046	泛海控股	600	912.00	0.00
625	688690	纳微科技	1	80.81	0.00

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	601288	农业银行	10,925,289.00	2.19
2	300750	宁德时代	10,352,311.00	2.08
3	601998	中信银行	10,027,382.00	2.01
4	601328	交通银行	8,929,181.00	1.79
5	000733	振华科技	8,679,147.35	1.74
6	000568	泸州老窖	7,903,647.60	1.59
7	601939	建设银行	7,346,086.00	1.47
8	603799	华友钴业	7,187,731.00	1.44
9	000651	格力电器	6,797,359.00	1.36
10	600519	贵州茅台	6,797,267.00	1.36
11	002460	赣锋锂业	6,471,125.80	1.30
12	601899	紫金矿业	6,467,061.00	1.30
13	601186	中国铁建	6,440,810.00	1.29
14	601988	中国银行	6,330,096.00	1.27
15	601390	中国中铁	6,194,521.00	1.24
16	601919	中远海控	6,146,485.90	1.23
17	601319	中国人保	5,998,158.65	1.20
18	600919	江苏银行	5,889,771.80	1.18
19	603986	兆易创新	5,644,127.00	1.13
20	002821	凯莱英	5,583,370.60	1.12

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	600519	贵州茅台	16,117,416.30	3.24
2	300750	宁德时代	10,714,875.00	2.15
3	600036	招商银行	10,706,627.00	2.15

4	601288	农业银行	9,449,981.00	1.90
5	601398	工商银行	9,338,015.02	1.87
6	000733	振华科技	9,000,534.20	1.81
7	601318	中国平安	8,104,175.00	1.63
8	603259	药明康德	7,789,943.28	1.56
9	601899	紫金矿业	7,594,336.00	1.52
10	600030	中信证券	7,588,679.40	1.52
11	601998	中信银行	7,311,590.00	1.47
12	601988	中国银行	7,168,051.00	1.44
13	000568	泸州老窖	7,167,814.00	1.44
14	601166	兴业银行	7,036,664.00	1.41
15	601328	交通银行	7,010,356.00	1.41
16	603986	兆易创新	6,796,564.00	1.36
17	300059	东方财富	6,608,691.14	1.33
18	603799	华友钴业	6,557,150.50	1.32
19	600887	伊利股份	6,376,878.00	1.28
20	600438	通威股份	5,835,745.00	1.17

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	1,292,585,646.85
卖出股票收入（成交）总额	1,282,997,385.99

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	10,270,353.42	2.73
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	41,093,304.11	10.90
7	可转债（可交换债）	17,320,064.84	4.60
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	68,683,722.37	18.22

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	101901252	19 攀钢集 MTN002	200,000	20,664,673.97	5.48
2	102000297	20 苍南国投 MTN001	200,000	20,428,630.14	5.42
3	200009	20 付息国债 09	100,000	10,270,353.42	2.73
4	113042	上银转债	35,930	3,775,355.09	1.00
5	110059	浦发转债	35,590	3,772,496.12	1.00

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

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

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

根据本集合计划合同，本集合计划投资范围不包括国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本集合计划合同，本集合计划投资范围不包括国债期货。

7.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 205,595,877.62 元，占基金资产净值的比例为 54.55%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-177,886,080.00 元，占基金资产净值的比例为-47.20%，空头合约市值占股票资产的比例为-86.52%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 8,638,348.65 元，公允价值变动损益为-1,702,247.86 元。

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

本报告编制日前一年内：

1) 本集合计划持有的“浦发转债”，发债主体浦发银行于 2022 年 3 月 25 日因未依法履行其他职责，被中国银行保险监督管理委员会公开处罚 420 万元；2021 年 7 月 16 日因未依法履行其他职责，被中国银行保险监督管理委员会公开处罚 6920 万元；

2) 本集合计划持有的“上银转债”，发债主体上海银行于 2022 年 2 月 23 日因未依法履行其他职责，被中国银行保险监督管理委员会责令改正、公开处罚 240 万元；2021 年 11 月 30 日因未依法履行其他职责，被中国银行保险监督管理委员会上海监管局会公开处罚 20 万元；2021 年 7 月 12 日因未依法履行其他职责，被中国银行保险监督管理委员会责令改正、公开处罚 460 万元；

3) 本集合计划持有的“中信银行”，因违规提供担保及财务资助，于 2022 年 3 月 32 日被中国银行保险监督管理委员会处罚 290 万元；因未依法履行职责，于 2021 年 11 月 20 日被国家市场监督管理总局处罚 50 万元；

4) 本集合计划持有的“农业银行”，因违规提供担保及财务资助，违规经营，于 2022 年 3 月 21 日被中国银行保险监督管理委员会处罚；因违规经营，于 2021 年 12 月 8 日被中国银行保险监督管理委员会处罚 150 万元；

5) 本集合计划持有的“交通银行”，因违规提供担保及财务资助，于 2022 年 3 月 25 日被中国银行保险监督管理委员会处罚 420 万元；因违规经营，于 2021 年 10 月 20 日被国家外汇管理局上海市分局处罚 340 万元；因违规经营，于 2021 年 8 月 13 日被中国人民银行处罚 62 万元；因违规经营，于 2021 年 7 月 13 日被中国银行保险监督管理委员会处罚 4100 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。

7.13.2 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	23,446,582.63
2	应收清算款	350,363.63
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	300.00

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,797,246.26

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113042	上银转债	3,775,355.09	1.00
2	110059	浦发转债	3,772,496.12	1.00
3	110073	国投转债	1,794,387.24	0.48
4	113044	大秦转债	1,792,914.87	0.48
5	113013	国君转债	1,001,919.62	0.27
6	127005	长证转债	782,368.04	0.21
7	127040	国泰转债	606,301.74	0.16
8	128081	海亮转债	600,935.30	0.16
9	113050	南银转债	554,531.80	0.15
10	113043	财通转债	544,165.35	0.14
11	127045	牧原转债	472,526.40	0.13
12	110079	杭银转债	388,375.47	0.10
13	113052	兴业转债	361,815.77	0.10
14	110076	华海转债	317,820.37	0.08
15	110077	洪城转债	263,079.87	0.07
16	128141	旺能转债	225,599.67	0.06

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不存在流通受限情况。

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	21	133,988.41	-	-	2,813,756.51	100.00

对冲 6 个月持有混合 A						
光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	240	159,851.44	28,146,931.88	73.37	10,217,414.24	26.63
光大阳光对冲 6 个月持有混合 C	41,065	7,889.50	-	-	323,982,260.73	100.00
合计	41,326	8,836.09	28,146,931.88	7.71	337,013,431.48	92.29

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	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	46,501.00	1.6526
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	134,668.44	0.3510
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C	1,024.60	0.0003
	合计	182,194.04	0.0499

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C
基金合同生效日（2020 年 3 月 25 日）基金份额总额	38,874,579.27	-	-
本报告期期初基金份额总额	3,112,966.42	39,843,250.89	441,324,525.40
本报告期基金总申购份额	-	114.28	1,418,895.93
减：本报告期基金总赎回份额	299,209.91	1,479,019.05	118,761,160.60
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	2,813,756.51	38,364,346.12	323,982,260.73

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本集合计划未召开集合计划份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本集合计划管理人、托管人均无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及集合计划管理人、集合计划财产、集合计划托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本集合计划投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本集合计划本报告期未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，集合计划管理人，集合计划托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
光大证券	2	2,568,128,451.46	100.00	1,307,122.29	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	262,981,109.60	100.00	1,733,500,000.00	100.00	-	-

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	中国证监会规定的媒介	2022年02月08日

	售机构并开通定期定额投资业务的公告		
3	关于旗下参公集合资产管理计划在上海陆金所基金销售有限公司渠道开通定期定额投资业务的公告	中国证监会规定的媒介	2022 年 05 月 19 日
4	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

§ 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无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、中国证监会关于同意光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划合同变更的函；

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

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

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

5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；

6、集合计划管理人业务资格批件、营业执照；

7、中国证监会要求的其他文件。

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：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