

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 年第 3 季度报告

2022 年 9 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

报告送出日期：2022 年 10 月 26 日

§ 1 重要提示

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

集合计划托管人广发银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 10 月 25 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 07 月 01 日起至 2022 年 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	330,506,269.89 份
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。</p> <p>数量化投资模型的投资逻辑基于学术研究、投资实践中</p>

	<p>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应。</p> <p>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，可以寻找到行业、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。
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		
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	2,615,678.28 份	37,468,826.25 份	290,421,765.36 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。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 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
1. 本期已实现收益	-30,972.25	-382,964.14	-3,253,375.41
2. 本期利润	-30,783.28	-407,530.17	-3,353,553.26
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0117	-0.0107	-0.0109
4. 期末基金资产净值	2,716,413.56	38,559,396.65	295,967,608.22
5. 期末基金份额净值	1.0385	1.0291	1.0191

注：（1）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；

（2）上述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。

3.2 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	净值增长率①	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
过去三个月	-1.18%	0.25%	0.63%	0.01%	-1.81%	0.24%
过去六个月	-0.86%	0.25%	1.26%	0.01%	-2.12%	0.24%

过去一年	-2.53%	0.23%	2.53%	0.01%	-5.06%	0.22%
自基金合同生效起至今	1.60%	0.27%	6.50%	0.01%	-4.90%	0.26%

光大阳光对冲 6 个月持有混合 B

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	-1.05%	0.25%	0.63%	0.01%	-1.68%	0.24%
过去六个月	-0.61%	0.25%	1.26%	0.01%	-1.87%	0.24%
过去一年	-2.05%	0.23%	2.53%	0.01%	-4.58%	0.22%
自基金合同生效起至今	2.91%	0.27%	6.50%	0.01%	-3.59%	0.26%

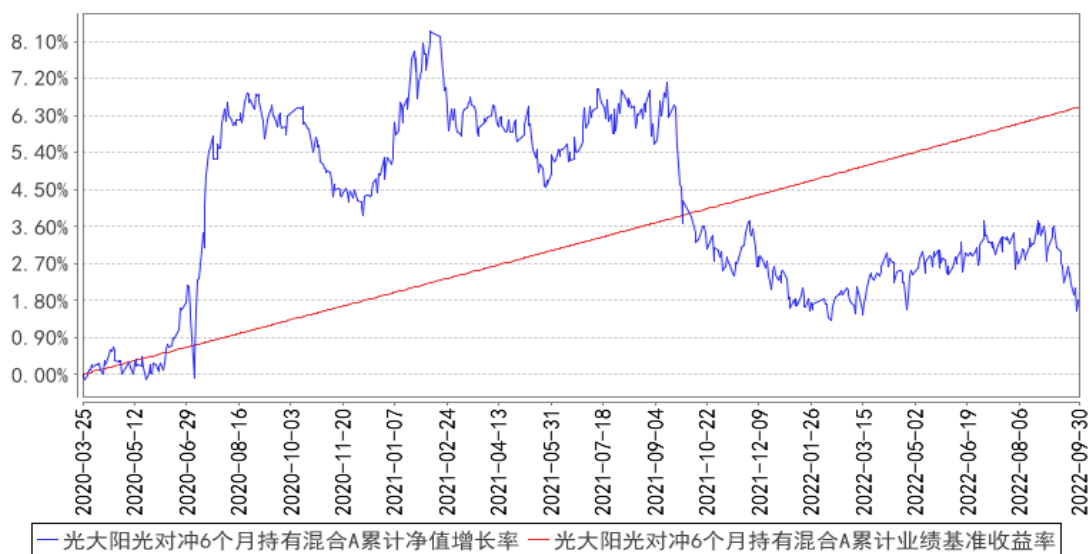
光大阳光对冲 6 个月持有混合 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.15%	0.25%	0.63%	0.01%	-1.78%	0.24%
过去六个月	-0.81%	0.25%	1.26%	0.01%	-2.07%	0.24%
过去一年	-2.44%	0.23%	2.53%	0.01%	-4.97%	0.22%
自基金合同生效起至今	1.91%	0.27%	6.50%	0.01%	-4.59%	0.26%

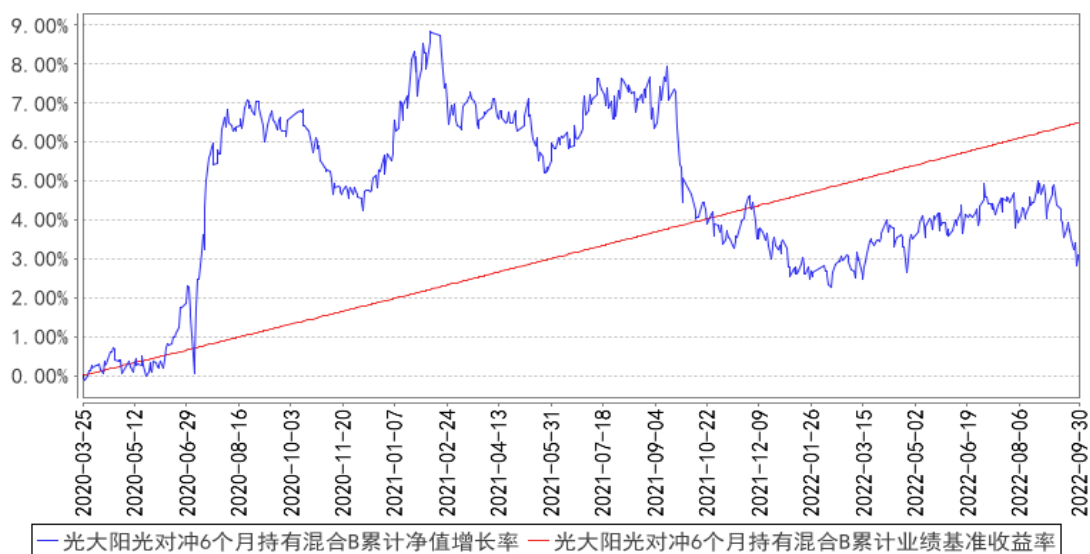
注：B 类份额设立日为 2020 年 3 月 25 日，C 类份额设立日为 2020 年 3 月 25 日。

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

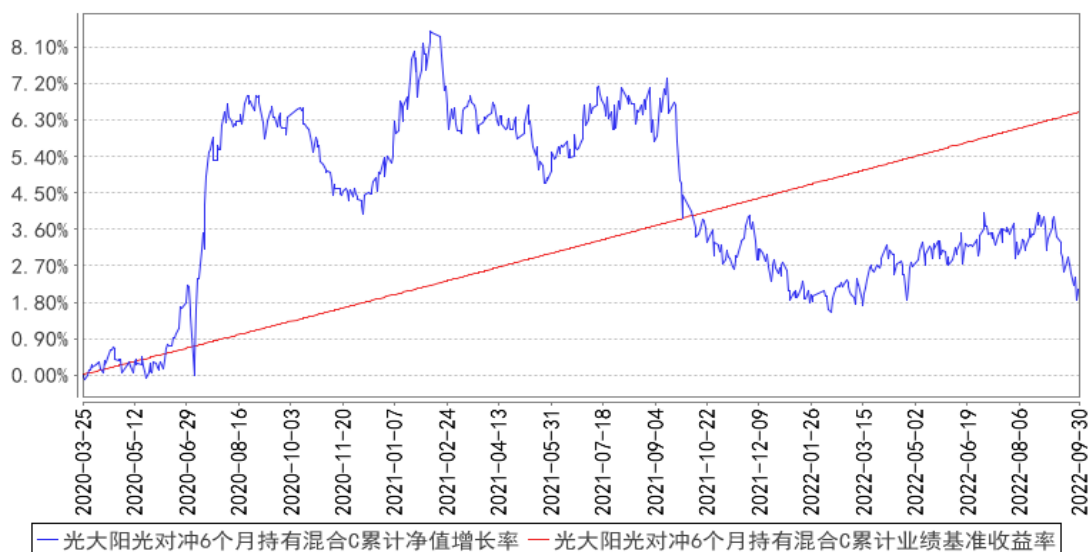
光大阳光对冲6个月持有混合**A**累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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 合计划投资经理	2020年03月25 日	-	7年	李禄俊先生，本硕均毕业于北京大学，曾在中金基金管理公司量化投资部任职，2018年加入光证资管，现任量化公募投资部副总经理。
陈延庆	量化公募投资部 投资经理、本集 合计划投资经理	2022年07月01 日	-	7年	陈延庆先生，研究生毕业于纽约大学应用数学专业，历任中金基金量化研究员，量化专户投资经理，中信建投基金量化研究负责人，量化专户投资经理。2021年加入光证资管，现任量化公募投资部投资经理。

注：1、集合计划的首任投资经理，其“任职日期”为集合计划合同生效日，其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本季度 A 股市场各大宽基指数跌幅较大，相对进攻属性的创业板指数和中证 1000 指数跌幅居前，行业上除煤炭外均有不同程度的下跌，市场整体处于完全的弱势下跌中。海外通胀压力显著，美联储加息节奏继续，海外能源危机重重，人民币贬值压力叠加国内疫情零星爆发，预计四季度市场压力仍较大。

本产品通过量化模型构建盈利优质的个股组合，结合估值因子、成长因子等选股模型提高组合胜率，同时对冲股指期货以获得绝对收益，再根据风险模型控制个股、行业和风格的整体风险暴露。本报告期内产品操作继续以稳健为主。当前产品运作分为三部分，股债多头、转债策略和对冲策略。股票和转债多头部分，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。从转债的角度看当前溢价仍然较高，因此维持转债较低的配置比例。对冲策略新加入中证 1000 对冲策略，丰富策略的不同维度。本季度对冲策略有所回撤，除了市场风险收缩导致的热门板块回撤以外，基差的快速收敛是亏损的重要原因。后续投资运作中，本产品将更加关注海内外市场所面临的系统性风险，同时尽量控制低配行业所产生的做空风险，适时灵活控制对冲仓位以及基差的影响，采取更加稳健的投资风格以应对市场波动。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 9 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 1.0385 元，本报告期份额净值增长率为-1.18%；光大阳光对冲策略 6 个月持有混合 B 类份额净值为 1.0291 元，本报告期份额净值增长率为-1.05%。光大阳光对冲策略 6 个月持有混合 C 类份额净值为 1.0191 元，本报告期份额净值增长率为-1.15%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	213,833,186.89	62.61
	其中：股票	213,833,186.89	62.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	49,971,338.89	14.63
	其中：债券	49,971,338.89	14.63
	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	9,991,702.74	2.93
	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	40,730,924.66	11.93
8	其他资产	26,982,424.29	7.90
9	合计	341,509,577.47	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,329,386.00	0.69
B	采矿业	11,898,503.47	3.53
C	制造业	125,409,240.62	37.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,262,829.70	2.45
E	建筑业	11,420,539.00	3.39

F	批发和零售业	3,831,889.00	1.14
G	交通运输、仓储和邮政业	6,145,132.80	1.82
H	住宿和餐饮业	137,712.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,425,887.51	3.39
J	金融业	18,951,135.23	5.62
K	房地产业	4,905,700.00	1.45
L	租赁和商务服务业	1,566,883.00	0.46
M	科学研究和技术服务业	2,202,135.00	0.65
N	水利、环境和公共设施管理业	1,045,238.00	0.31
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	76,582.00	0.02
Q	卫生和社会工作	2,772,646.96	0.82
R	文化、体育和娱乐业	1,228,448.60	0.36
S	综合	223,298.00	0.07
	合计	213,833,186.89	63.41

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有港股通股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	2,319	4,342,327.50	1.29
2	300750	宁德时代	5,516	2,211,309.24	0.66
3	601390	中国中铁	360,700	1,886,461.00	0.56
4	000651	格力电器	54,400	1,764,192.00	0.52
5	601988	中国银行	552,600	1,707,534.00	0.51
6	601318	中国平安	40,126	1,668,439.08	0.49
7	601319	中国人保	313,500	1,570,635.00	0.47
8	603392	万泰生物	12,560	1,436,864.00	0.43
9	300244	迪安诊断	49,500	1,436,490.00	0.43
10	601012	隆基绿能	29,809	1,428,149.19	0.42

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

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	10,095,838.36	2.99
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	20,581,945.21	6.10
7	可转债（可交换债）	19,293,555.32	5.72
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	49,971,338.89	14.82

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	102000297	20 苍南国投 MTN001	200,000	20,581,945.21	6.10
2	200009	20 付息国债 09	100,000	10,095,838.36	2.99
3	113042	上银转债	29,180	3,111,947.87	0.92
4	110059	浦发转债	27,730	2,982,395.69	0.88
5	110073	国投转债	20,190	2,105,831.94	0.62

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

本集合计划本报告期内未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本集合计划本报告期内未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本集合计划本报告期内未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC2210	IC2210	-34	-38,940,880.00	3,448,409.52	-
IC2212	IC2212	-30	-34,112,400.00	2,264,360.00	-
IF2211	IF2211	-26	-29,760,120.00	694,920.00	-
IF2212	IF2212	-34	-38,913,000.00	3,670,320.00	-
IM2210	IM2210	-24	-29,387,520.00	3,316,400.00	-
IM2211	IM2211	-16	-19,456,640.00	572,520.00	-
IM2212	IM2212	-5	-6,030,800.00	731,640.00	-
公允价值变动总额合计（元）					14,698,569.52
股指期货投资本期收益（元）					-2,619,692.40
股指期货投资本期公允价值变动（元）					27,872,049.52

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末未进行国债期货投资。

5.10.3 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。

5.11 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 213,833,186.89 元，占基金资产净值的比例为 63.41%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-196,601,360.00 元，占基金资产净值的比例为-58.30%，空头合约市值占股票资产的比例为 91.94%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为-1,720,377.71 元，公允价值变动损益为 134,344.53 元。

5.12 投资组合报告附注

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

本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；

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。

5.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本集合计划投资的前十名股票未超出集合计划合同规定的备选股票库。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	26,881,829.49
2	应收证券清算款	74,095.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	26,499.80
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	26,982,424.29

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113042	上银转债	3,111,947.87	0.92
2	110059	浦发转债	2,982,395.69	0.88
3	110073	国投转债	2,105,831.94	0.62
4	113044	大秦转债	1,772,803.69	0.53
5	127005	长证转债	1,476,945.12	0.44
6	113052	兴业转债	1,473,099.55	0.44
7	113043	财通转债	1,443,701.34	0.43
8	110061	川投转债	806,530.81	0.24
9	128081	海亮转债	806,241.06	0.24
10	110085	通 22 转债	804,465.84	0.24
11	128136	立讯转债	644,893.50	0.19
12	113055	成银转债	627,526.77	0.19
13	127022	恒逸转债	365,094.04	0.11
14	110079	杭银转债	344,632.59	0.10
15	110084	贵燃转债	205,424.22	0.06
16	110077	洪城转债	183,373.35	0.05
17	127027	靖远转债	138,647.94	0.04

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 6 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
报告期期初基金份额总额	2,813,756.51	38,364,346.12	323,982,260.73
报告期期间基金总申购份额	-	980.10	478,788.81
减：报告期期间基金总赎回份额	198,078.23	896,499.97	34,039,284.18
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
报告期期末基金份额总额	2,615,678.28	37,468,826.25	290,421,765.36

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期末管理人未持有本集合计划份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内集合计划管理人未新增固有资金投资本集合计划。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1) 2022 年 7 月 1 日，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经理变更公告；

2) 2022 年 7 月 1 日，关于旗下参公集合资产管理计划增加珠海盈米基金销售有限公司为代理销售机构并开通定期定额投资业务的公告。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会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。

9.2 存放地点

备查文件存放于集合计划管理人的办公场所：

- 1、中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层

9.3 查阅方式

投资者可到集合计划管理人的办公场所免费查阅备查文件，亦可通过公司网站查阅，公司网址为：www.ebscn-am.com

上海光大证券资产管理有限公司

2022 年 10 月 26 日