

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
2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 月 31 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：2023 年 04 月 23 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 04 月 21 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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 03 月 31 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	284,133,603.85 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	2,305,889.56 份	36,961,704.34 份	244,866,009.95 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（2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 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	38,845.42	630,801.79	4,072,748.15
2. 本期利润	33,092.56	531,245.96	3,376,299.20
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0133	0.0143	0.0132
4. 期末基金资产净值	2,409,657.99	38,370,952.29	251,225,407.98
5. 期末基金份额净值	1.0450	1.0381	1.0260

注：1、本期已实现收益指集合本期利息收入、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	1.28%	0.17%	0.62%	0.01%	0.66%	0.16%
过去六个月	0.63%	0.19%	1.25%	0.01%	-0.62%	0.18%
过去一年	-0.24%	0.22%	2.53%	0.01%	-2.77%	0.21%

过去三年	2.14%	0.26%	7.79%	0.01%	-5.65%	0.25%
自基金合同生效起至今	2.24%	0.26%	7.84%	0.01%	-5.60%	0.25%

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	1.40%	0.18%	0.62%	0.01%	0.78%	0.17%
过去六个月	0.87%	0.19%	1.25%	0.01%	-0.38%	0.18%
过去一年	0.26%	0.22%	2.53%	0.01%	-2.27%	0.21%
过去三年	3.69%	0.26%	7.79%	0.01%	-4.10%	0.25%
自基金合同生效起至今	3.81%	0.26%	7.84%	0.01%	-4.03%	0.25%

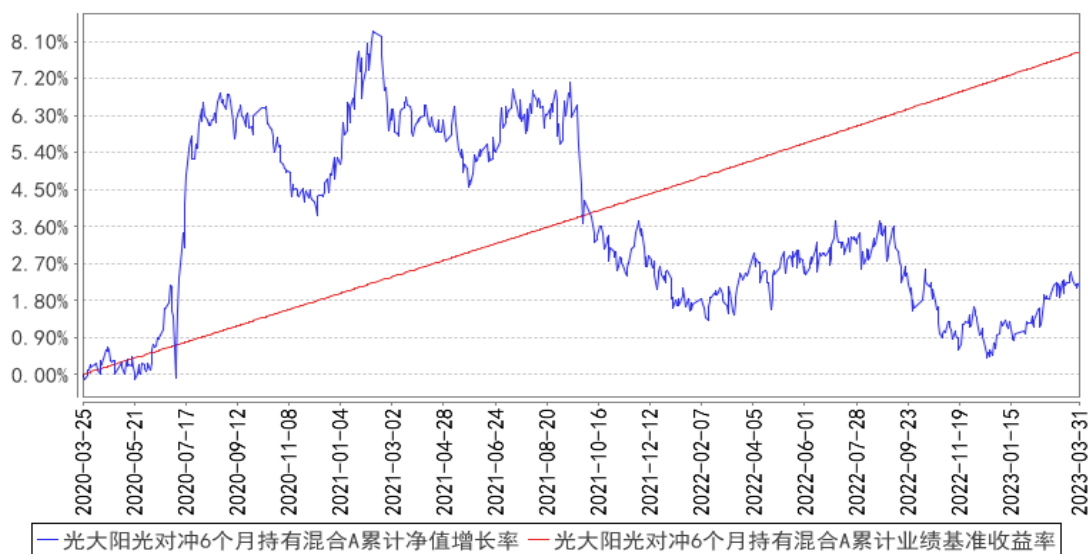
光大阳光对冲 6 个月持有混合 C

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	1.30%	0.17%	0.62%	0.01%	0.68%	0.16%
过去六个月	0.68%	0.19%	1.25%	0.01%	-0.57%	0.18%
过去一年	-0.14%	0.22%	2.53%	0.01%	-2.67%	0.21%
过去三年	2.49%	0.26%	7.79%	0.01%	-5.30%	0.25%
自基金合同生效起至今	2.60%	0.26%	7.84%	0.01%	-5.24%	0.25%

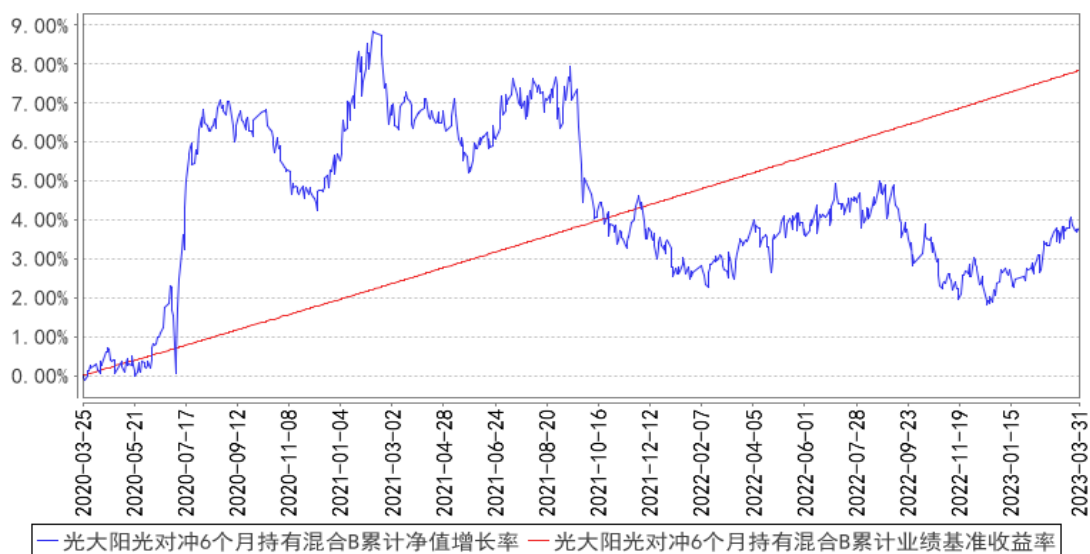
注：B 类份额设立日为 2020 年 3 月 25 日，C 类份额设立日为 2020 年 3 月 25 日。

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

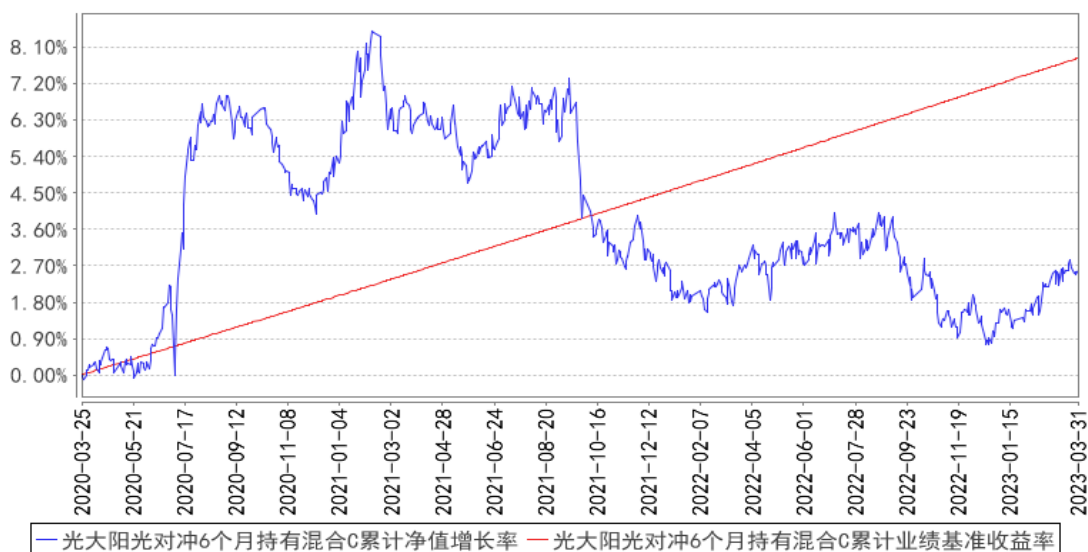
光大阳光对冲6个月持有混合**A**累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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		
陈韵骋	固定收益公募投资部投资经理、本集合计划投资经理、光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券型集合资产管理计划投资经理	2023 年 3 月 17 日	-	12 年	陈韵骋先生，博士学位，本硕博均毕业于上海交通大学，曾担任海通证券研究所分析师。2015 年加入光证资管，历任研究员、投资经理助理、投资经理。
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	2023 年 03 月 17 日	8 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	2023 年 03 月 17 日	8 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。

3、根据管理人 2023 年 3 月 17 日公告，李禄俊、陈延庆不再担任本集合计划投资经理。

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

一季度 A 股呈现普涨，但风格行业分化剧烈。风格上，以农历春节为切换节点，一月各类风格都有良好表现，但春节后小盘风格尤其是微盘风格延续上行趋势，大盘风格则拐头向下出现回落。全季中证 1000 相对沪深 300 超额收益接近 5%。行业上，受到 AI 概念推动，TMT 板块大涨，而电新、消费、汽车等行业则表现疲软。

宏观基本面上，3 月制造业 PMI 触顶回落，表明经济恢复最快的时期已经过去，但仍处在历史相对高位水平，建筑业有所式微，但服务业的持续改善是重要亮点，表明内需有后劲，经济持续修复的概率较高。外需的孱弱态势延续，对下一阶段复苏的高度有抑制。总体而言，在前期市场预期已经充分下调的基础上，这份数据进一步明确了经济复苏的持续性，但高度和斜率仍有较

大博弈空间。

产品当前策略主要包含对冲策略、转债策略、股票多头三类。对冲策略上，四月将有密集的财报披露，从过去 A 股历史规律来看，通常会奠定每一年二、三季度的成长主线基调。我们预计市场对于一季度较为极致的风格、主题演绎会有一些修正，机构视野会重新回归盈利基本面超预期的个股及行业，成长风格会受到青睐。我们将适应市场变化，将一部分以估值反转为超额收益来源的策略切换至成长动量风格。同时做好策略的对冲，严控 beta 风险。转债策略上，我们以获取转债价格的相对低估为主要收益来源，在控制 delta 暴露水平的前提下获取稳健收益。股票多头策略上，我们少量配置以低估值高分红为核心逻辑的价值类策略，并且通过基于风险水平的仓位管理机制提升股票多头配置部分的收益回撤比。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 3 月 31 日，光大阳光对冲策略 6 个月持有混合 A 类份额净值为 1.0450 元，本报告期份额净值增长率为 1.28%；光大阳光对冲策略 6 个月持有混合 B 类份额净值为 1.0381 元，本报告期份额净值增长率为 1.40%；光大阳光对冲策略 6 个月持有混合 C 类份额净值为 1.0260 元，本报告期份额净值增长率为 1.30%。

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	185,923,500.10	59.93
	其中：股票	185,923,500.10	59.93
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	34,267,117.62	11.05
	其中：债券	34,267,117.62	11.05
	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	20,000,000.00	6.45
	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	46,122,690.87	14.87

8	其他资产	23,935,347.99	7.71
9	合计	310,248,656.58	100.00

注：本集合计划本报告期末未持有港股通交易机制投资的港股。

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	1,429,681.00	0.49
B	采矿业	7,570,351.93	2.59
C	制造业	112,204,948.96	38.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,023,754.00	2.06
E	建筑业	6,151,320.54	2.11
F	批发和零售业	4,182,272.57	1.43
G	交通运输、仓储和邮政业	6,671,510.10	2.28
H	住宿和餐饮业	58,350.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,865,341.70	4.06
J	金融业	18,682,721.76	6.40
K	房地产业	3,995,607.00	1.37
L	租赁和商务服务业	1,344,991.00	0.46
M	科学研究和技术服务业	1,764,295.12	0.60
N	水利、环境和公共设施管理业	814,950.00	0.28
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	45,175.00	0.02
Q	卫生和社会工作	871,896.42	0.30
R	文化、体育和娱乐业	2,037,089.00	0.70
S	综合	209,244.00	0.07
	合计	185,923,500.10	63.67

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	601088	中国神华	44,600	1,256,382.00	0.43
2	300750	宁德时代	2,716	1,102,831.80	0.38
3	601998	中信银行	192,500	1,045,275.00	0.36

4	603369	今世缘	14,600	946,810.00	0.32
5	300751	迈为股份	2,900	884,500.00	0.30
6	601919	中远海控	77,140	850,854.20	0.29
7	600036	招商银行	24,309	833,069.43	0.29
8	300498	温氏股份	38,000	777,860.00	0.27
9	688599	天合光能	14,500	755,305.00	0.26
10	300896	爱美客	1,300	726,375.00	0.25

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	10,181,515.07	3.49
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	-	-
7	可转债（可交换债）	24,085,602.55	8.25
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	34,267,117.62	11.74

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	200009	20 付息国债 09	100,000	10,181,515.07	3.49
2	113050	南银转债	11,090	1,264,861.59	0.43
3	113044	大秦转债	11,160	1,260,150.51	0.43
4	127006	敖东转债	10,450	1,253,323.76	0.43
5	128034	江银转债	11,170	1,252,753.91	0.43

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末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
IC2304	IC2304	-20	-25,364,800.00	-438,160.00	-
IC2306	IC2306	-26	-32,709,040.00	-952,360.00	-
IF2306	IF2306	-43	-52,304,340.00	-1,550,186.28	-
IM2304	IM2304	-10	-13,732,000.00	-97,880.00	-
IM2306	IM2306	-36	-49,042,080.00	-1,471,680.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-4,510,266.28
股指期货投资本期收益（元）					-5,808,936.35
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-8,102,915.56

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 185,923,500.10 元，占基金资产净值的比例为 63.67%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-173,152,260.00 元，占基金资产净值的比例为-59.30%，空头合约市值占股票资产的比例为 93.14%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 6,319,018.51 元，公允价值变动损益为-1,271,660.72 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“兴业银行”股票发行主体兴业银行因未依法履行职责于2022年3月25日被中国银行保险监督管理委员会罚款350万元；因未依法履行职责于2022年10月28日被中国银行保险监督管理委员会罚款450万元；因未依法履行职责于2022年11月4日被中国银行保险监督管理委员会罚款150万元；

2) 本集合计划持有的“农业银行”股票发行主体于2022年3月25日因违规经营，被中国银行保险监督管理委员会罚款480万元；于2022年10月28日因未依法履行职责，被中国银行保险监督管理委员会罚款150万元；

3) 本集合计划持有的“工商银行”股票发行主体于2022年3月25日因未依法履行职责，被中国银行保险监督管理委员会罚款360万元；

该类情形对上述发行主体没有重大影响，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	23,932,747.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,600.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	23,935,347.99

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	113050	南银转债	1,264,861.59	0.43
2	113044	大秦转债	1,260,150.51	0.43
3	127006	敖东转债	1,253,323.76	0.43
4	128034	江银转债	1,252,753.91	0.43
5	128048	张行转债	1,249,756.54	0.43

6	110080	东湖转债	1,245,700.58	0.43
7	110043	无锡转债	1,244,903.84	0.43
8	123090	三诺转债	745,987.46	0.26
9	113647	禾丰转债	745,190.36	0.26
10	128075	远东转债	744,069.17	0.25
11	113631	皖天转债	738,505.67	0.25
12	118003	华兴转债	737,769.90	0.25
13	127063	贵轮转债	737,097.06	0.25
14	113037	紫银转债	736,688.06	0.25
15	127046	百润转债	736,557.88	0.25
16	113013	国君转债	736,476.80	0.25
17	128129	青农转债	736,447.25	0.25
18	113042	上银转债	736,123.05	0.25
19	110059	浦发转债	735,781.83	0.25
20	113056	重银转债	733,852.29	0.25
21	128035	大族转债	733,454.60	0.25
22	127036	三花转债	733,054.47	0.25
23	111002	特纸转债	732,843.16	0.25
24	127050	麒麟转债	730,771.30	0.25
25	123119	康泰转 2	721,239.60	0.25
26	123077	汉得转债	694,081.75	0.24
27	113584	家悦转债	619,883.75	0.21

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	2,615,678.28	37,128,843.54	266,975,830.96
报告期期间基金总申购份额	-	14,296.03	554,624.46
减：报告期期间基金总赎回份额	309,788.72	181,435.23	22,664,445.47
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	2,305,889.56	36,961,704.34	244,866,009.95

§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) 2023 年 3 月 9 日, 关于光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划延长存续期限并修改资产管理合同、招募说明书的公告;

2) 2023 年 3 月 17 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;

3) 2023 年 3 月 27 日, 上海光大证券资产管理有限公司关于聘任投资经理助理的公告;

§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

2023 年 04 月 23 日