

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 2 季度报告

2023 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

报告送出日期：2023 年 7 月 21 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 07 月 20 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 04 月 01 日起至 2023 年 06 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 | 260,150,911.95 份 |
| 投资目标 | 通过深度研究，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 | 36,536,470.69 份 | 221,308,551.70 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 4 月 1 日-2023 年 6 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 | 18,787.73 | 345,851.74 | 1,894,453.75 |
| 2. 本期利润 | 46,422.93 | 782,115.28 | 4,565,605.00 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0201 | 0.0213 | 0.0196 |
| 4. 期末基金资产净值 | 2,456,080.92 | 38,708,435.91 | 231,486,959.87 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0651 | 1.0594 | 1.0460 |

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 | 1.92% | 0.19% | 0.63% | 0.01% | 1.29% | 0.18% |
| 过去六个月 | 3.23% | 0.18% | 1.25% | 0.01% | 1.98% | 0.17% |
| 过去一年 | 1.35% | 0.21% | 2.53% | 0.01% | -1.18% | 0.20% |

| | | | | | | |
|------------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 过去三年 | 1.99% | 0.26% | 7.79% | 0.01% | -5.80% | 0.25% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.21% | 0.25% | 8.51% | 0.01% | -4.30% | 0.24% |

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 | 2.05% | 0.19% | 0.63% | 0.01% | 1.42% | 0.18% |
| 过去六个月 | 3.48% | 0.18% | 1.25% | 0.01% | 2.23% | 0.17% |
| 过去一年 | 1.87% | 0.21% | 2.53% | 0.01% | -0.66% | 0.20% |
| 过去三年 | 3.54% | 0.26% | 7.79% | 0.01% | -4.25% | 0.25% |
| 自基金合同生效起至今 | 5.94% | 0.25% | 8.51% | 0.01% | -2.57% | 0.24% |

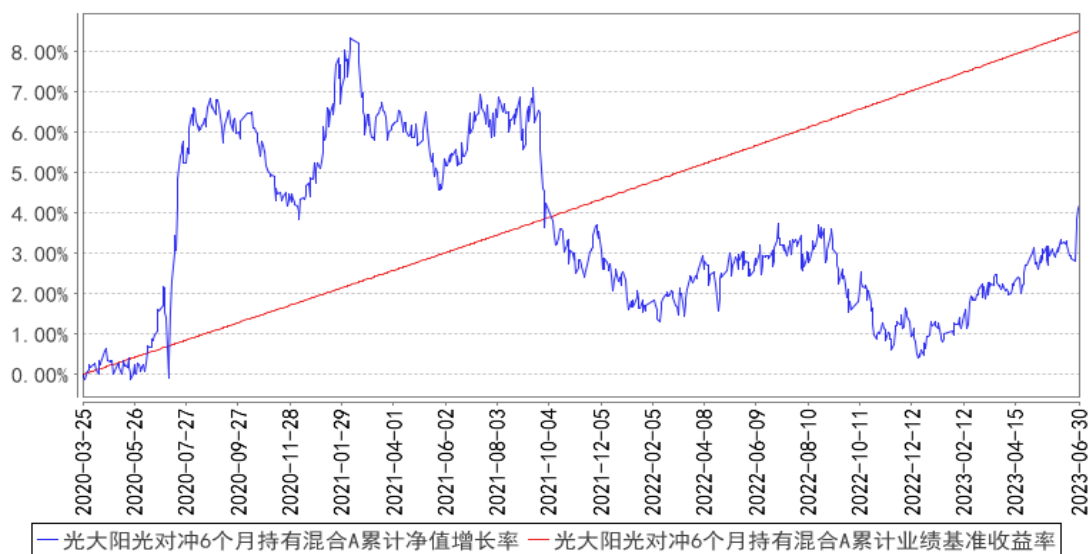
光大阳光对冲 6 个月持有混合 C

| 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 | 1.95% | 0.19% | 0.63% | 0.01% | 1.32% | 0.18% |
| 过去六个月 | 3.28% | 0.18% | 1.25% | 0.01% | 2.03% | 0.17% |
| 过去一年 | 1.45% | 0.21% | 2.53% | 0.01% | -1.08% | 0.20% |
| 过去三年 | 2.32% | 0.26% | 7.79% | 0.01% | -5.47% | 0.25% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.60% | 0.25% | 8.51% | 0.01% | -3.91% | 0.24% |

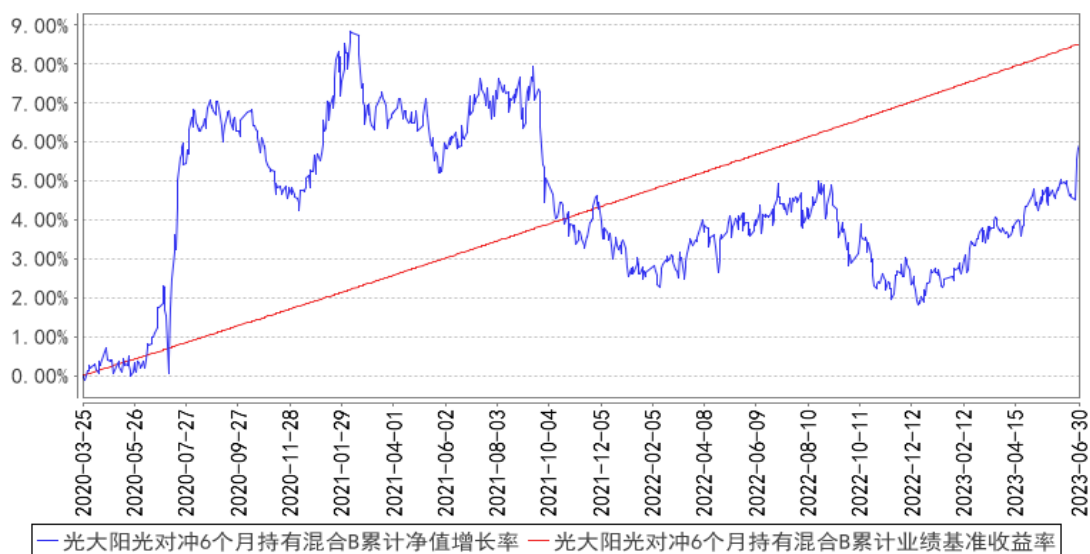
注：B 类份额设立日为 2020 年 3 月 25 日，C 类份额设立日为 2020 年 3 月 25 日。

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

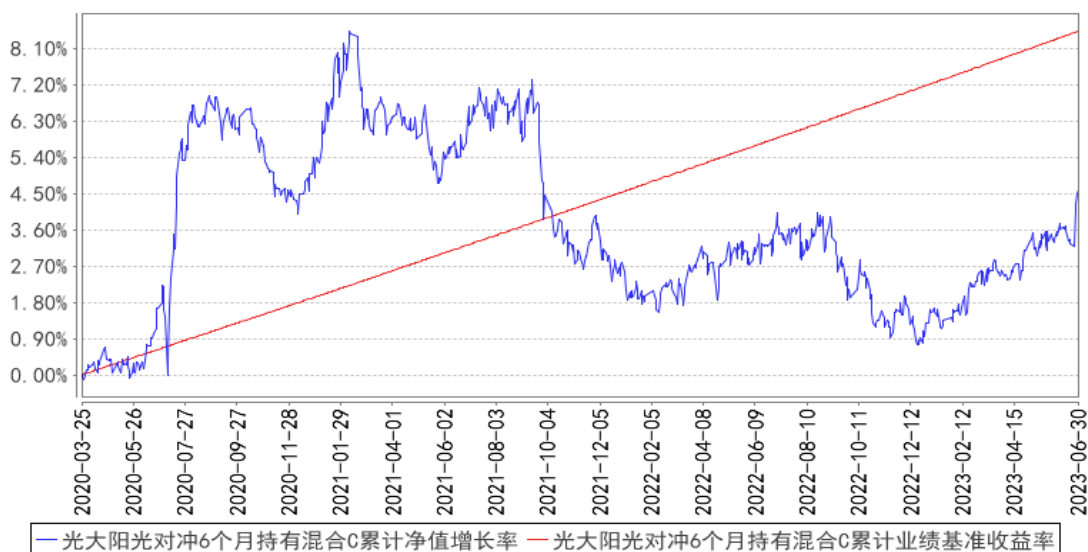
光大阳光对冲6个月持有混合**A**累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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、光大阳光稳健增长混合型集合资产管理计划投资经理、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。 |

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

二季度 A 股表现较为疲软，延续春节之后震荡下行趋势。从风格角度，市场呈现风险偏好收缩状态，高分红特征个股跌幅有限，创业板等大盘成长风格个股跌幅却显著高于市场平均。但是市场并不缺乏流动性，各类微盘股价格创出新高，走出与 A 股主流完全不同的 beta。行业板块方面，TMT 和中特估双主线非常清晰，也客观上造成如果没有适当配置两个板块将显著跑输市场。

国内经济复苏强度不足与资金外流压力是二季度 A 股呈现前述状态的主要原因。尽管市场主流已经认知到今年国内宏观环境是“强预期弱现实”，但是当主要经济指标走弱同时并没有明确的政策利好时，顺周期板块一直处于向下寻底的过程中。与此同时，美元走强与美联储加息也造成了资金外流的压力，北向资金二季度出现小幅净流出。

二季度宏观环境确实对股票市场造成了掣肘效果，但已经充分反映在价格之上，沪深 300 指数已经回归到年初点位。而且我们也可以观察到制造业 PMI 企稳，工业企业利润回升等经济趋稳态势信号。海外方面，美联储加息节奏已经放缓，人民币汇率也已经触及 7.3 的底部位置，资金流出压力将得到缓解。

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，我们将充分利用半年报的发布窗口，捕捉基本面动量带来的 Alpha。股票多头策略上，我们认为下半年将有一个相对较好的 beta 环境，质地优秀但上半年跌幅较大的公司将出现估值修复的投资机会。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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 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 1.0651 元，本报告期份额净值增长率为 1.92%；光大阳光对冲策略 6 个月持有混合 B 类份额净值为 1.0594 元，本报告期份额净值增长率为 2.05%；光大阳光对冲策略 6 个月持有混合 C 类份额净值为 1.0460 元，本报告期份额净值增长率为 1.95%。

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 | 174,819,590.99 | 63.53 |
| | 其中：股票 | 174,819,590.99 | 63.53 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 61,036,450.13 | 22.18 |
| | 其中：债券 | 61,036,450.13 | 22.18 |
| | 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 | 7,996,174.14 | 2.91 |
| | 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 | 8,336,656.19 | 3.03 |
| 8 | 其他资产 | 22,983,207.60 | 8.35 |
| 9 | 合计 | 275,172,079.05 | 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 | 1,058,023.00 | 0.39 |
| B | 采矿业 | 6,334,865.27 | 2.32 |
| C | 制造业 | 107,766,962.20 | 39.53 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,390,461.00 | 1.98 |
| E | 建筑业 | 5,330,520.37 | 1.96 |

| | | | |
|---|-----------------|----------------|-------|
| F | 批发和零售业 | 8,437,161.49 | 3.09 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 3,672,074.00 | 1.35 |
| H | 住宿和餐饮业 | 15,336.00 | 0.01 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 13,597,756.05 | 4.99 |
| J | 金融业 | 15,520,779.49 | 5.69 |
| K | 房地产业 | 1,425,125.00 | 0.52 |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,532,115.00 | 0.56 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 806,628.00 | 0.30 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 1,158,702.00 | 0.42 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 752,455.12 | 0.28 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 1,825,281.00 | 0.67 |
| S | 综合 | 195,346.00 | 0.07 |
| | 合计 | 174,819,590.99 | 64.12 |

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 | 601328 | 交通银行 | 557,000 | 3,230,600.00 | 1.18 |
| 2 | 600546 | 山煤国际 | 217,100 | 3,141,437.00 | 1.15 |
| 3 | 002179 | 中航光电 | 44,460 | 2,016,261.00 | 0.74 |
| 4 | 002489 | 浙江永强 | 448,700 | 1,817,235.00 | 0.67 |
| 5 | 002056 | 横店东磁 | 99,000 | 1,802,790.00 | 0.66 |
| 6 | 601336 | 新华保险 | 47,600 | 1,750,252.00 | 0.64 |
| 7 | 000997 | 新大陆 | 91,300 | 1,725,570.00 | 0.63 |
| 8 | 600582 | 天地科技 | 288,100 | 1,679,623.00 | 0.62 |
| 9 | 000625 | 长安汽车 | 126,000 | 1,629,180.00 | 0.60 |
| 10 | 601318 | 中国平安 | 34,526 | 1,602,006.40 | 0.59 |

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 | 10,234,353.42 | 3.75 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 10,105,234.97 | 3.71 |
| | 其中：政策性金融债 | 10,105,234.97 | 3.71 |

| | | | |
|----|-----------|---------------|-------|
| 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） | 40,696,861.74 | 14.93 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 61,036,450.13 | 22.39 |

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 | 10,234,353.42 | 3.75 |
| 2 | 220302 | 22 进出 02 | 100,000 | 10,105,234.97 | 3.71 |
| 3 | 113044 | 大秦转债 | 43,090 | 4,977,591.52 | 1.83 |
| 4 | 110053 | 苏银转债 | 36,190 | 4,549,667.99 | 1.67 |
| 5 | 110045 | 海澜转债 | 36,020 | 4,531,165.01 | 1.66 |

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 |
|-------------------|--------|----------|----------------|--------------|--------------|
| IC2307 | IC2307 | -6 | -7,188,960.00 | 16,690.91 | - |
| IC2309 | IC2309 | -40 | -47,760,000.00 | 1,022,305.26 | - |
| IF2309 | IF2309 | -17 | -19,578,900.00 | 152,219.24 | - |
| IM2307 | IM2307 | -4 | -5,259,840.00 | -86,858.67 | - |
| IM2309 | IM2309 | -59 | -77,129,520.00 | -320,760.00 | - |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | 783,596.74 |
| 股指期货投资本期收益（元） | | | | | 345,259.19 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | 5,293,863.02 |

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 174,819,590.99 元，占基金资产净值的比例为 64.12%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-156,917,220.00 元，占基金资产净值的比例为-57.55%，空头合约市值占股票资产的比例为-89.76%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 4,596,948.04 元，公允价值变动损益为 2,829,957.51 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“交通银行”股票发行主体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 500 万元；

2) 本集合计划持有的“苏银转债”股票发行主体于 2023 年 2 月 10 日因违反反洗钱法，违规经营，被中国人民银行罚款 773.6 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 | 18,930,517.30 |
| 2 | 应收证券清算款 | 4,002,740.25 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 49,950.05 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 22,983,207.60 |

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 | 113044 | 大秦转债 | 4,977,591.52 | 1.83 |
| 2 | 110053 | 苏银转债 | 4,549,667.99 | 1.67 |
| 3 | 110045 | 海澜转债 | 4,531,165.01 | 1.66 |
| 4 | 113651 | 松霖转债 | 1,265,089.92 | 0.46 |
| 5 | 128133 | 奇正转债 | 821,115.33 | 0.30 |
| 6 | 128142 | 新乳转债 | 819,434.72 | 0.30 |
| 7 | 127054 | 双箭转债 | 819,343.20 | 0.30 |
| 8 | 110060 | 天路转债 | 819,261.50 | 0.30 |
| 9 | 113549 | 白电转债 | 819,079.20 | 0.30 |
| 10 | 113516 | 苏农转债 | 818,694.36 | 0.30 |
| 11 | 113519 | 长久转债 | 818,234.82 | 0.30 |
| 12 | 127028 | 英特转债 | 818,167.16 | 0.30 |
| 13 | 128075 | 远东转债 | 812,390.98 | 0.30 |
| 14 | 132026 | G 三峡 EB2 | 774,736.03 | 0.28 |
| 15 | 110062 | 烽火转债 | 550,207.91 | 0.20 |
| 16 | 113643 | 风语转债 | 549,717.09 | 0.20 |
| 17 | 113632 | 鹤 21 转债 | 549,550.79 | 0.20 |
| 18 | 113638 | 台 21 转债 | 548,799.66 | 0.20 |
| 19 | 127041 | 弘亚转债 | 548,719.95 | 0.20 |
| 20 | 111002 | 特纸转债 | 548,162.21 | 0.20 |
| 21 | 113045 | 环旭转债 | 547,543.59 | 0.20 |
| 22 | 113059 | 福莱转债 | 546,817.08 | 0.20 |
| 23 | 123119 | 康泰转 2 | 545,866.38 | 0.20 |
| 24 | 123090 | 三诺转债 | 545,457.21 | 0.20 |
| 25 | 113053 | 隆 22 转债 | 545,419.86 | 0.20 |
| 26 | 113659 | 莱克转债 | 544,610.03 | 0.20 |
| 27 | 113623 | 凤 21 转债 | 544,271.27 | 0.20 |
| 28 | 113627 | 太平转债 | 543,924.73 | 0.20 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 29 | 123157 | 科蓝转债 | 543,896.96 | 0.20 |
| 30 | 128136 | 立讯转债 | 543,436.86 | 0.20 |
| 31 | 123117 | 健帆转债 | 542,458.55 | 0.20 |
| 32 | 128134 | 鸿路转债 | 538,599.27 | 0.20 |
| 33 | 123104 | 卫宁转债 | 442,761.33 | 0.16 |
| 34 | 113021 | 中信转债 | 440,889.03 | 0.16 |
| 35 | 113042 | 上银转债 | 440,439.79 | 0.16 |
| 36 | 113057 | 中银转债 | 440,436.97 | 0.16 |
| 37 | 123004 | 铁汉转债 | 440,214.29 | 0.16 |
| 38 | 113061 | 拓普转债 | 440,179.22 | 0.16 |
| 39 | 128035 | 大族转债 | 439,973.37 | 0.16 |
| 40 | 110059 | 浦发转债 | 439,935.56 | 0.16 |
| 41 | 128129 | 青农转债 | 439,622.74 | 0.16 |
| 42 | 113631 | 皖天转债 | 438,895.29 | 0.16 |
| 43 | 128083 | 新北转债 | 438,060.91 | 0.16 |
| 44 | 127052 | 西子转债 | 438,050.15 | 0.16 |
| 45 | 113639 | 华正转债 | 437,719.48 | 0.16 |
| 46 | 127036 | 三花转债 | 435,329.37 | 0.16 |
| 47 | 113588 | 润达转债 | 433,103.30 | 0.16 |
| 48 | 110090 | 爱迪转债 | 273,370.54 | 0.10 |

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 | 2,305,889.56 | 36,961,704.34 | 244,866,009.95 |
| 报告期期间基金总申购份额 | - | 49,096.82 | 317,533.50 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | - | 474,330.47 | 23,874,991.75 |
| 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 | 36,536,470.69 | 221,308,551.70 |

§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。

7.3 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。

7.4 影响投资者决策的其他重要信息

1) 2023 年 6 月 19 日，关于上海光大证券资产管理有限公司旗下部分产品估值调整的公告。

§8 备查文件目录

8.1 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。

8.2 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

8.3 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 7 月 21 日