

光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII） 2023 年中期报告

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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 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。本报告已经三分之二以上董事签字同意，并由董事长签发。

集合计划托管人中国工商银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益。投资需谨慎，敬请投资者注意投资风险。投资者欲了解本集合计划的详细情况，请于投资集合计划前认真阅读集合计划的产品合同、更新的招募说明书等法律文件以及相关业务公告。敬请投资者关注适当性管理相关规定，提前做好风险测评，并根据自身的风险承受能力购买风险等级相匹配的产品。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 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 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 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.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.9 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.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
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.....	12
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.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	40

7.3 期末按行业分类的权益投资组合	40
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	41
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	44
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	46
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	46
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	46
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	46
7.11 投资组合报告附注	46
§8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
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	48
§9 开放式基金份额变动	48
§10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
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	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8 其他重大事件	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息	50
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	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	50
§12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	51
12.3 查阅方式	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII）	
基金简称	光大阳光香港精选混合（QDII）	
基金主代码	862001	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 1 月 4 日	
基金管理人	上海光大证券资产管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	562,198,704.37 份	
基金合同存续期	3 年	
下属分级基金的基金简称	光大阳光香港精选混合（QDII）A	光大阳光香港精选混合（QDII）C
下属分级基金的交易代码	862001/862011	862012
报告期末下属分级基金的份额总额	307,474,024.35 份	254,724,680.02 份

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

2.2 基金产品说明

投资目标	在深入研究，控制和分散投资组合风险的前提下，实现集合计划资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本集合计划投资于全球市场，将基于宏观研究分析，决定境、内外资产配置比例，自下而上精选境外上市股票或债权类资产，充分挖掘境内、外股票投资机会，提高产品综合收益。</p> <p>（一）资产配置策略</p> <p>本集合计划通过定性与定量研究相结合的方法，确定投资组合中权益类资产和固定收益类资产的配置比例。</p> <p>（二）权益类品种的投资策略</p> <p>1、行业配置策略</p> <p>本集合计划重点投资于一些符合转型期中国经济发展趋势的行业或子行业，如由人口老龄化驱动的医疗行业、具有品牌优势的消费品行业、可以替代人工的自动化行业等。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本集合计划将重点关注在港股市场上市、具有行业代表性和核心竞争力的优质公司，关注港股市场在行业结构、估值、AH 股折溢价、股息率等方面具有吸引力的投资标的。</p> <p>（三）固定收益类品种投资策略</p> <p>本计划将根据对利率走势的预测、债券等级、债券的期限结构、风险结构、不同品种流动性的高低等因素，构造债券组合。</p> <p>（四）资产支持证券投资策略</p>

	<p>本集合计划将重点对区域经济、市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。</p> <p>（五）衍生品投资策略</p> <p>本集合计划主要投资于在经中国证监会认可的交易所上市交易的衍生品，也可投资在场外交易市场（OTC）进行买卖的衍生品。</p>
业绩比较基准	经人民币汇率调整的恒生指数收益率*80%+人民币同期活期存款利率（税后）*20%
风险收益特征	<p>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。</p> <p>本集合计划主要投资于境外证券市场。除了需要承担与境内集合计划类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本集合计划还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。</p>

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海光大证券资产管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	朱轶	郭明
	联系电话	021-32068300	(010)66105799
	电子邮箱	zhuyi1@ebscn.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	95525	95588	
传真	021-32068585	(010)66105798	
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层	北京市西城区复兴门内大街 55 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	北京市西城区复兴门内大街 55 号	
邮政编码	200127	100140	
法定代表人	熊国兵	陈四清	

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	Brown Brothers Harriman & Co.
	中文	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		140 Broadway New York
办公地址		140 Broadway New York
邮政编码		NY 10005

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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
--	------

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	光大阳光香港精选混合（QDII）A	光大阳光香港精选混合（QDII）C
本期已实现收益	-40,585,776.45	-24,769,263.30
本期利润	-37,396,308.37	-22,484,252.71
加权平均基金份额本期利润	-0.1199	-0.0873
本期加权平均净值利润率	-16.41%	-16.32%
本期基金份额净值增长率	-15.64%	-15.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	光大阳光香港精选混合（QDII）A	光大阳光香港精选混合（QDII）C
期末可供分配利润	-108,811,243.51	-134,503,011.16
期末可供分配基金份额利润	-0.3539	-0.5280
期末基金资产净值	198,662,780.84	120,221,668.86
期末基金份额净值	0.6461	0.4720
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	光大阳光香港精选混合（QDII）A	光大阳光香港精选混合（QDII）C
基金份额累计净值增长率	-50.60%	-52.80%

注：1、表中的“期末”均指报告期最后一日，即 2023 年 6 月 30 日；“本期”指 2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 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，采用期末未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

光大阳光香港精选混合（QDII）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	3.43%	1.77%	4.68%	1.10%	-1.25%	0.67%
过去三个月	-10.54%	1.53%	-1.79%	0.96%	-8.75%	0.57%
过去六个月	-15.64%	1.68%	-0.84%	1.06%	-14.80%	0.62%
过去一年	-19.14%	2.16%	-4.85%	1.30%	-14.29%	0.86%
自基金合同生效起至今	-50.60%	2.34%	-18.52%	1.27%	-32.08%	1.07%

光大阳光香港精选混合（QDII）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	3.37%	1.78%	4.68%	1.10%	-1.31%	0.68%
过去三个月	-10.67%	1.52%	-1.79%	0.96%	-8.88%	0.56%
过去六个月	-15.88%	1.68%	-0.84%	1.06%	-15.04%	0.62%
过去一年	-19.59%	2.16%	-4.85%	1.30%	-14.74%	0.86%
自基金合同生效起至今	-52.80%	2.34%	-18.52%	1.27%	-34.28%	1.07%

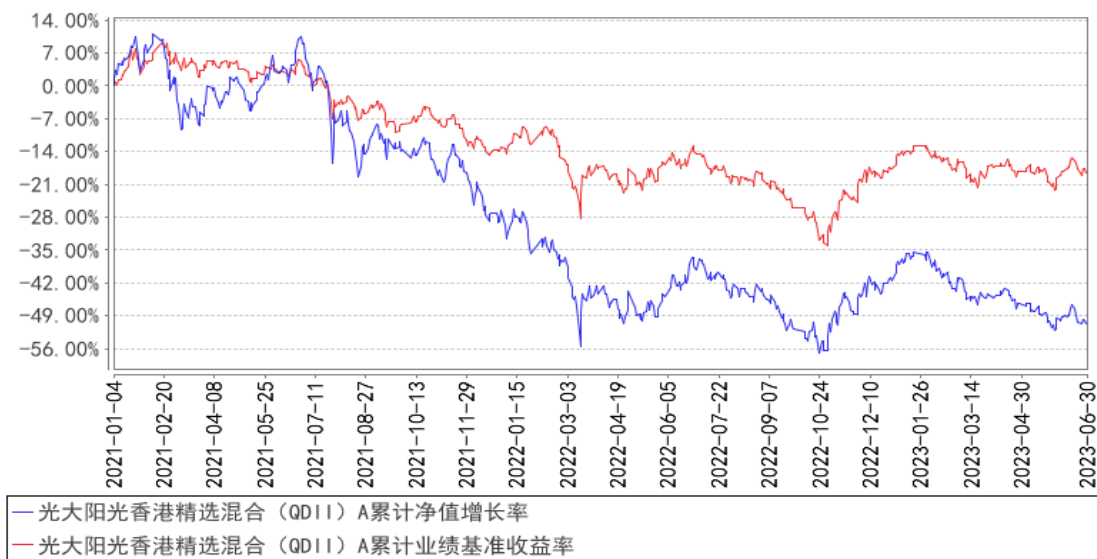
注：1、自基金合同生效起至今指 2021 年 1 月 4 日至 2023 年 6 月 30 日；

2、业绩比较基准为：经人民币汇率调整的恒生指数收益率*80%+人民币同期活期存款利率（税后）*20%

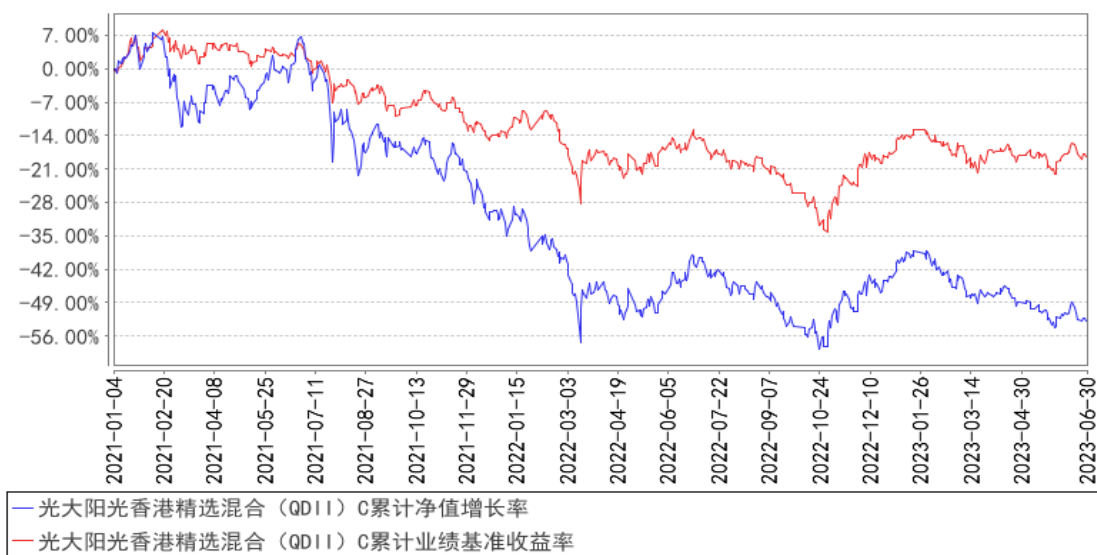
3、C类份额设立日为2021年1月4日，自2021年1月7日开始有实际份额。

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

光大阳光香港精选混合（QDII）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



光大阳光香港精选混合（QDII）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 2023 年 6 月末，本公司共管理 16 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		
王海涛	权益公募投资部总经理、本集合计划投资经理、光大阳光价值 30 个月持有期混合型集合资产管理计划投资经理	2021 年 1 月 4 日	-	17 年	王海涛先生，北京师范大学硕士研究生毕业，历任首创证券、华泰证券研究员，太平资管、平安信托高级投资经理，上海人寿保险、华宝证券投资部门总经理，2019 年加入光证资管，现任权益公募投资部总经理。

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本集合计划本报告期末投资经理无兼任私募资产管理计划的情况。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

无。

4.3 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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年行情主要反映的是市场对国内经济的修复不断调整的预期。从年初到 2 月，市场对于经济在疫情后的复苏较为乐观，各种宏观经济数据也较为强劲。因此这段时间，市场仍然延续去年四季度的预期修复行情。同时，外资也在不断流入中国市场。但二季度，市场出现了不同的预期，开始对于经济复苏失去了耐心，叠加中美关系恶化，人民币贬值预期，地产销售下滑等。市场开始二次探底，并开始从经济复苏，转向主题投资。市场选择了中特估主题进行交易，主题行情演绎的快速且猛烈，但存量资金博弈的特点又十分突出。我们认为，中特估主题的基本面支撑不够坚实，因此仍然选择估值更有优势的成长方向进行布局。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，光大阳光香港精选混合 A 类份额净值为 0.6461 元，本报告期份额净值增长率为-15.64%；光大阳光香港精选混合 C 类份额净值为 0.4720 元，本报告期份额净值增长率为-15.88%；

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年下半年市场有望出现一些拐点，一是美国经济衰退概率大幅降低，且美联储继续紧缩

货币的概率大幅降低。二是中国经济走过了曲折的经济复苏历程后，经济有望彻底走出疫情影响，开始新的周期。三是宏观政策开始对市场产生积极影响。结合以上几个拐点，我们对于下半年的中国资本市场，较市场更为乐观。我们认为过去两三年，国内外压制市场的各种因素，都在发生拐点性的变化，叠加目前市场顺周期品种的低估状态，市场有望开始新一轮的向上周期。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本基金的管理人上海光大证券资产管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持

有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对上海光大证券资产管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、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：光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII）

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	26,169,526.84	30,573,856.16
结算备付金		12.35	2.00
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	293,892,220.23	360,956,290.19
其中：股票投资		293,892,220.23	360,956,290.19
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		602,085.82	-
应收申购款		82,243.98	266,277.74
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		320,746,089.22	391,796,426.09
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2023 年 6 月 30 日	2022 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		286,378.02	15.56
应付赎回款		758,147.89	1,193,184.19
应付管理人报酬		429,801.28	517,519.76
应付托管费		94,019.08	113,207.44
应付销售服务费		60,658.63	74,819.40
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	232,634.62	285,995.40
负债合计		1,861,639.52	2,184,741.75
净 资 产：			
实收基金	6.4.7.10	562,198,704.37	580,342,738.38
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-243,314,254.67	-190,731,054.04
净资产合计		318,884,449.70	389,611,684.34
负债和净资产总计		320,746,089.22	391,796,426.09

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，集合计划份额总额 562,198,704.37 份。光大阳光香港精选混合（QDII）A 集合计划份额净值 0.6461 元，集合计划份额 307,474,024.35 份，集合计划资产净值 198,662,780.84 元。光大阳光香港精选混合（QDII）C 集合计划份额净值 0.4720 元，集合计划份额 254,724,680.02 份，集合计划资产净值 120,221,668.86 元。

6.2 利润表

会计主体：光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-55,842,481.37	-75,157,124.13
1. 利息收入		168,435.28	50,185.10
其中：存款利息收入	6.4.7.13	168,435.28	50,185.10
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-62,335,602.48	-21,848,069.68
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-65,846,420.30	-30,089,885.43
基金投资收益	6.4.7.15	-	-
债券投资收益	6.4.7.16	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.17	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	3,510,817.82	8,241,815.75
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	5,474,478.67	-54,261,983.46
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		812,315.63	861,825.90
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	37,891.53	40,918.01
减：二、营业总支出		4,038,079.71	4,458,834.22
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,917,697.12	3,216,912.58
2. 托管费	6.4.10.2.2	638,246.30	703,699.66
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	412,417.93	469,409.69
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.24	69,718.36	68,812.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-59,880,561.08	-79,615,958.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-59,880,561.08	-79,615,958.35
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-59,880,561.08	-79,615,958.35

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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）	580,342,738.38	-	-190,731,054.04	389,611,684.34
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）	580,342,738.38	-	-190,731,054.04	389,611,684.34
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-18,144,034.01	-	-52,583,200.63	-70,727,234.64
（一）、综合收益总额	-	-	-59,880,561.08	-59,880,561.08
（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）	-18,144,034.01	-	7,297,360.45	-10,846,673.56
其中：1. 基金申购款	35,394,366.00	-	-13,696,321.43	21,698,044.57
2. 基金赎回款	-53,538,400.01	-	20,993,681.88	-32,544,718.13
（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、本期期末净资产（基金净值）	562,198,704.37	-	-243,314,254.6	318,884,449.70

			7	
项目	上年度可比期间 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）	587,480,475.58	-	-93,801,575.06	493,678,900.52
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）	587,480,475.58	-	-93,801,575.06	493,678,900.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-10,963,574.64	-	-77,349,169.37	-88,312,744.01
（一）、综合收益总额	-	-	-79,615,958.35	-79,615,958.35
（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）	-10,963,574.64	-	2,266,788.98	-8,696,785.66
其中：1. 基金申购款	68,923,363.49	-	-27,392,082.21	41,531,281.28
2. 基金赎回款	-79,886,938.13	-	29,658,871.19	-50,228,066.94
（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、本期期末净资产（基金净值）	576,516,900.94	-	-171,150,744.43	405,366,156.51

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：

常松

詹朋

杨薇

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII）是由光大全球灵活配置型（QDII）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 12 月 3 日发布《光大全球灵活配置型（QDII）集合资产管理计划合同变更公告》。根据公告，光大全球灵活配置型（QDII）集合资产管理计划名称变更为“光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII）”，光大全球灵活配置型（QDII）集合资产管理计划份额转换为光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII）A 类人民币份额。合同变更后，本集合计划的托管人、登记机构不变。自 2021 年 1 月 4 日起《光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII）资产管理合同》、《光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII）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，托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII）资产管理合同》的有关规定，本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括境外投资品种与境内投资品种。其中：

境外投资品种包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股（包括港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港交易所上市的股票）、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（以下无特别说明，均包括交易型开放式指数基金（ETF））；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构化投资产品。

本集合计划主要投资的境外市场有：中国香港特别行政区和美国。境内投资品种包括国内依法发行上市的股票（含创业板、中小板及其他经中国证监会允许集合计划投资的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、

公开发行的次级债券、政府支持债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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

本集合计划投资于中国香港特别行政区证券市场挂牌交易的股票时，在法律法规允许的前提下，既可通过合格境内机构投资者的额度进行投资，也可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制进行投资。

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 60%~95%，其中投资于香港证券市场相关证券的比例不低于非现金集合计划资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债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。

本集合计划的业绩比较基准为：经人民币汇率调整的恒生指数收益率*80%+人民币同期活期存款利率（税后）*20%

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本集合计划持续经营为基础列报。

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、完整地反映了本集合计划本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和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

本集合计划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采用的会计政策、会计估计一致。

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

本集合计划本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2、对集合计划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、对集合计划取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向集合计划支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对集合计划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。对集合计划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、集合计划卖出股票按 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、本集合计划运作过程中涉及的境外投资的税项问题, 根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	26,169,526.84
等于: 本金	26,168,937.15
加: 应计利息	589.69
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	26,169,526.84

6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	459,392,405.09	-	293,892,220.23	-165,500,184.86
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	459,392,405.09	-	293,892,220.23	-165,500,184.86

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本集合计划本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本集合计划本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本集合计划本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本集合计划本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本集合计划本报告期末未持有任何买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本集合计划本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本集合计划本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本集合计划本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本集合计划本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本集合计划本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本集合计划本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本集合计划本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	491.87
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	22,718.39
其中：交易所市场	22,718.39
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	209,424.36
合计	232,634.62

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

光大阳光香港精选混合（QDII）A

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	312,483,491.26	312,483,491.26
本期申购	9,536,436.48	9,536,436.48
本期赎回（以“-”号填列）	-14,545,903.39	-14,545,903.39
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	307,474,024.35	307,474,024.35

光大阳光香港精选混合（QDII）C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	267,859,247.12	267,859,247.12
本期申购	25,857,929.52	25,857,929.52
本期赎回（以“-”号填列）	-38,992,496.62	-38,992,496.62
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	254,724,680.02	254,724,680.02

6.4.7.11 其他综合收益

本集合计划本期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

光大阳光香港精选混合（QDII）A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,786,862.92	-82,942,932.54	-73,156,069.62
本期利润	-40,585,776.45	3,189,468.08	-37,396,308.37
本期基金份额交易产生的变动数	388,165.39	1,352,969.09	1,741,134.48
其中：基金申购款	65,222.77	-2,243,745.89	-2,178,523.12
基金赎回款	322,942.62	3,596,714.98	3,919,657.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-30,410,748.14	-78,400,495.37	-108,811,243.51

光大阳光香港精选混合（QDII）C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-54,739,350.18	-62,835,634.24	-117,574,984.42
本期利润	-24,769,263.30	2,285,010.59	-22,484,252.71
本期基金份额交易产生的变动数	2,805,419.18	2,750,806.79	5,556,225.97
其中：基金申购款	-5,910,355.86	-5,607,442.45	-11,517,798.31
基金赎回款	8,715,775.04	8,358,249.24	17,074,024.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-76,703,194.30	-57,799,816.86	-134,503,011.16

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	167,771.07
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	652.03
其他	12.18
合计	168,435.28

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 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-65,846,420.30
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	-65,846,420.30

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	75,515,554.15
减：卖出股票成本总额	141,037,609.40
减：交易费用	324,365.05
买卖股票差价收入	-65,846,420.30

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 基金投资收益

本集合计划本报告期无基金投资收益。

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

本集合计划本报告期无债券投资收益。

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本集合计划本报告期无债券投资收益-买卖债券差价收入。

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期无债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期无债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

本集合计划本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本集合计划本报告期无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

本集合计划本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本集合计划本报告期无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期无贵金属投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期无贵金属投资收益-申购差价收入。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本集合计划本报告期无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

本集合计划本报告期无衍生工具收益-其他投资收益。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

股票投资产生的股利收益	3,510,817.82
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	3,510,817.82

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	5,474,478.67
股票投资	5,474,478.67
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	5,474,478.67

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	37,891.53
合计	37,891.53

6.4.7.23 信用减值损失

本集合计划本报告期无信用减值损失。

6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	9,916.99
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	294.00
合计	69,718.36

6.4.7.25 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其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
上海光大证券资产管理有限公司（“光证资管”）	集合计划管理人、集合计划销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	集合计划托管人、集合计划代销机构
布朗兄弟哈里曼银行（“布朗兄弟哈里曼银行”）	境外资产托管人
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	集合计划代销机构、集合计划管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
光大证券	29,389,777.81	20.67	53,589,704.25	52.76

6.4.10.1.2 债券交易

本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

本集合计划本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023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	22,718.39	16.66	22,718.39	100.00
关联方名称	上年度可比期间 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	40,834.02	49.76	130,126.66	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 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	2,917,697.12
其中：支付销售机构的客户维护费	80,330.79	39,825.67

注：1、本集合计划不同类别份额的管理费分别计算，A类份额固定年管理费率为1.6%，C类份额固定年管理费率为1.6%，本集合计划固定管理费的计算方法如下：

$$G = E \times \text{相应类别份额的固定管理费率} / \text{当年天数}$$

G 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日的集合计划资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日

当期发生的基金应支付的托管费	638,246.30	703,699.66
----------------	------------	------------

注：集合计划托管费按前一日的集合计划资产净值的 0.35% 的年费率计提。计算方法如下：托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	光大阳光香港精选混合 (QDII) A	光大阳光香港精选混合 (QDII) C	合计
光大证券	-	369,670.35	369,670.35
光证资管	-	3,159.83	3,159.83
合计	-	372,830.18	372,830.18
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	光大阳光香港精选混合 (QDII) A	光大阳光香港精选混合 (QDII) C	合计
光大证券	-	415,576.30	415,576.30
光证资管	-	35,493.95	35,493.95
合计	-	451,070.25	451,070.25

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 0.6% 的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

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

本集合计划本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

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

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本集合计划本报告期无与关联方通过约定申报方式进行适用市场化费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	光大阳光香港精选混合（QDII）A	光大阳光香港精选混合（QDII）C
基金合同生效日（2021 年 1 月 4 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	58,610,757.73	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	58,610,757.73	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	10.4253%	-
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	光大阳光香港精选混合（QDII）A	光大阳光香港精选混合（QDII）C
基金合同生效日（2021 年 1 月 4 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	32,781,586.04	-
报告期间申购/买入总份额	25,829,171.69	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	58,610,757.73	-

报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	10.1664%	-
-------------------------	----------	---

注：期间申购/买入总份额含红利再投资、转换转入份额，期间赎回/卖出总份额含转换转出份额。

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

份额单位：份

光大阳光香港精选混合（QDII）A

关联方名称	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
光大证券 股份有限 公司	5,058,602.16	0.8998	5,058,602.16	0.8717

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 2023年1月1日至2023年6月30 日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
布朗兄弟哈里曼银 行	19,935,125.99	148,590.29	22,505,350.21	1,074.76
工商银行	6,234,400.85	19,180.78	13,352,591.67	46,744.18

注：本集合计划的境内银行存款由集合计划托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。境外存款由布朗兄弟哈里曼银行保管。

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

本集合计划本报告期没有需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本集合计划本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本集合计划本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本集合计划本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持有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持有交易所市场债券正回购。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本集合计划本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划在日常经营活动中面临的与金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。管理人制定内部风险管理制度来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

公司建立四个层级的风险管理体系，即董事会、经理层及各专业委员会、各风险管理职能部门、各业务部门。公司董事会是风险管理的最高决策机构，承担全面风险管理的最终责任。公司经理层就公司风险管理工作的有效性向董事会负责，对全面风险管理承担主要责任。公司经理层在董事会的领导下，全面负责公司风险管理的日常工作。公司经理层下设专业委员会就不同类别风险管理对经理层负责，委员会根据公司各委员会议事规则确定的职责范围，行使公司风险管理职能。各风险管理职能部门按照公司授权对公司不同风险进行识别、监测、评估和报告，并制定公司不同类型风险管理办法，明确具体工作流程，并为业务决策提供对口风险管理建议，协助、指导和检查各部门的对口风险管理工作。公司各业务部门按照公司授权管理体系在被授予的权限范围内开展业务，严禁越权从事经营活动，并通过制度、流程、系统等方式，进行有效管理和控制。

本集合计划的管理人主要通过定性分析和定量分析的方法评估各种金融工具风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本集合计划的投资目标，结合集合计划资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者集合计划所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。

本集合计划的银行存款存放在本集合计划的托管行中国工商银行股份有限公司，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

本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

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投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指集合计划管理人未能以合理价格及时变现集合计划资产以支付投资者赎回款项的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于计划份额持有人可随时要求赎回其持有的计划份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划的管理人在运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本集合计划资产的流动性风险

进行管理，集合计划管理人建立了健全的流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，对组合持仓集中度、流动性受限资产比例、现金类资产比例等流动性指标进行持续的监测和分析，通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，对交易对手进行必要的尽职调查和准入，加强逆回购的流动性风险和交易对手风险的管理，并健全了逆回购交易质押品管理制度。

本集合计划所持有的证券大部分具有良好的流动性。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 2023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	26,169,526.84	-	-	-	26,169,526.84
结算备付金	12.35	-	-	-	12.35
交易性金融资产	-	-	-	293,892,220.23	293,892,220.23
应收股利	-	-	-	602,085.82	602,085.82
应收申购款	-	-	-	82,243.98	82,243.98
资产总计	26,169,539.19	-	-	294,576,550.03	320,746,089.22
负债					
应付赎回款	-	-	-	758,147.89	758,147.89
应付管理人报酬	-	-	-	429,801.28	429,801.28
应付托管费	-	-	-	94,019.08	94,019.08
应付清算款	-	-	-	286,378.02	286,378.02
应付销售服务费	-	-	-	60,658.63	60,658.63
其他负债	-	-	-	232,634.62	232,634.62
负债总计	-	-	-	1,861,639.52	1,861,639.52
利率敏感度缺口	26,169,539.19	-	-	-292,714,910.51	318,884,449.70

上年度末 2022 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	30,573,856.16	-	-	-	30,573,856.16
结算备付金	2.00	-	-	-	2.00
交易性金融资产	-	-	-	-360,956,290.19	360,956,290.19
应收申购款	-	-	-	266,277.74	266,277.74
资产总计	30,573,858.16	-	-	-361,222,567.93	391,796,426.09
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,193,184.19	1,193,184.19
应付管理人报酬	-	-	-	517,519.76	517,519.76
应付托管费	-	-	-	113,207.44	113,207.44
应付清算款	-	-	-	15.56	15.56
应付销售服务费	-	-	-	74,819.40	74,819.40
其他负债	-	-	-	285,995.40	285,995.40
负债总计	-	-	-	2,184,741.75	2,184,741.75
利率敏感度缺口	30,573,858.16	-	-	-359,037,826.18	389,611,684.34

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本集合计划本报告期末未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本集合计划资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本集合计划持有以非记账本位币人民币计价的资产与负债，因此存在相应的外汇风险。本集合计划管理人每日对本集合计划的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			合计
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	
以外币计价的资产				
银行存款	1,690,403.65	18,241,654.65	-	19,932,058.30
交易性金融资产	-	293,892,220.23	-	293,892,220.23
应收股利	-	394,078.19	-	394,078.19
资产合计	1,690,403.65	312,527,953.07	-	314,218,356.72

	5			
以外币计价的负债				
应付清算款	-	286,366.25	-	286,366.25
负债合计	-	286,366.25	-	286,366.25
资产负债表外汇风险敞口净额	1,690,403.65	312,241,586.82	-	313,931,990.47
	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
项目	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	1,127,172.73	17,165,472.16	-	18,292,644.89
交易性金融资产	-	360,956,290.19	-	360,956,290.19
资产合计	1,127,172.73	378,121,762.35	-	379,248,935.08
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	1,127,172.73	378,121,762.35	-	379,248,935.08

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除市场汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	港币相对人民币升值 5%	15,606,693.74	18,906,088.12
	港币相对人民币贬值 5%	-15,606,693.74	-18,906,088.12
	美元相对人民币升值	84,520.18	56,358.64

	值 5%		
	美元相对人民币贬值 5%	-84,520.18	-56,358.64

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 2023年6月30日		上年度末 2022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	293,892,220.23	92.16	360,956,290.19	92.65
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	293,892,220.23	92.16	360,956,290.19	92.65

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除恒生指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	恒生指数上升 5%	17,911,236.30	27,344,547.08
	恒生指数下降 5%	-17,911,236.30	-27,344,547.08

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本集合计划本报告期无采用风险价值法管理的风险。

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	293,892,220.23	360,956,290.19
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	293,892,220.23	360,956,290.19

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	293,892,220.23	91.63
	其中：普通股	293,892,220.23	91.63
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	26,169,539.19	8.16
8	其他各项资产	684,329.80	0.21
9	合计	320,746,089.22	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
中国香港	293,892,220.23	92.16
合计	293,892,220.23	92.16

注：本集合计划本报告期末未持有权证。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
基础材料	-	-
消费者非必需品	78,520,707.00	24.62
消费者常用品	20,285,450.07	6.36
能源	1,032,617.60	0.32
金融	7,208,224.04	2.26
医疗保健	102,005,175.10	31.99
工业	-	-

信息技术	2,692,181.60	0.84
电信服务	71,409,471.56	22.39
公用事业	-	-
房地产	10,738,393.26	3.37
合计	293,892,220.23	92.16

注：以上行业分类采用港交所二级分类标准。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代 码	所在证 券市场	所属 国家 (地 区)	数量 (股)	公允价值	占基 金资 产净 值比 例(%)
1	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股	700 HK	香港联合交易所	中国香港	101,000	30,878,585.36	9.68
2	NETEASE INC	网易	9999 HK	香港联合交易所	中国香港	212,000	29,827,159.38	9.35
3	MEITUAN DIANPING-CLASS B	美团-W	3690 HK	香港联合交易所	中国香港	240,000	27,061,956.96	8.49
4	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	药明生物	2269 HK	香港联合交易所	中国香港	458,349	15,868,202.34	4.98
5	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	阿里巴巴	9988 HK	香港联合交易所	中国香港	205,000	15,347,279.08	4.81
6	BEIGENE LTD	百济神州	6160 HK	香港联合交易所	中国香港	145,035	14,361,460.26	4.50
7	AKESO INC	康方生物	9926 HK	香港联合交易所	中国香港	439,738	14,331,937.82	4.49
8	FU SHOU YUAN INTERNATIONAL	福寿园	1448 HK	香港联合交易所	中国香港	2,481,059	12,329,553.73	3.87
9	GENSCRIPT BIOTEC	金斯瑞生物科技	1548 HK	香港联合交易所	中国香港	680,000	11,034,256.64	3.46

10	LI NING CO LTD	李宁	2331 HK	香港联合交易所	中国香港	245,000	9,521,056.97	2.99
11	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	安踏体育	2020 HK	香港联合交易所	中国香港	127,000	9,373,171.37	2.94
12	LIFETECH SCI	先健科技	1302 HK	香港联合交易所	中国香港	3,700,000	9,108,240.42	2.86
13	CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	华润啤酒	291 HK	香港联合交易所	中国香港	191,000	9,086,666.09	2.85
14	HYGEIA HEALTH	海吉亚医疗	6078 HK	香港联合交易所	中国香港	227,641	8,898,931.05	2.79
15	INNOVENT BIOLOGICS INC	信达生物	1801 HK	香港联合交易所	中国香港	305,000	8,323,635.44	2.61
16	JD HEALTH INTERN	京东健康	6618 HK	香港联合交易所	中国香港	165,000	7,522,665.32	2.36
17	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	中海物业	2669 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000,000	7,274,422.20	2.28
18	KUAISHOU TECHNOL	快手	1024 HK	香港联合交易所	中国香港	130,000	6,418,363.78	2.01
19	JD.COM INC-CL A	京东集团	9618 HK	香港联合交易所	中国香港	40,040	4,887,688.89	1.53
20	AIA GROUP LTD	友邦保险	1299 HK	香港联合交易所	中国香港	60,000	4,375,717.08	1.37
21	Baidu	百度	9888 HK	香港联合交易所	中国香港	35,000	4,285,363.04	1.34
22	TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	青岛啤酒	168 HK	香港联合交易所	中国香港	56,000	3,676,118.66	1.15
23	SHANDONG WEIGAO GP	威高股份	1066 HK	香港联合交易所	中国香港	370,000	3,493,197.82	1.10

	M			所				
24	POLY PROPERTY- H	保利物 业服务 股份有 限公司	6049 HK	香港联 合交易 所	中 国 香 港	90,000	3,149,022.69	0.99
25	PEIJIA-B	沛嘉医 疗-B	9996 HK	香港联 合交易 所	中 国 香 港	517,159	2,937,151.17	0.92
26	Wuxi Apptec Co.,Ltd.	药明康 德	2359 HK	香港联 合交易 所	中 国 香 港	50,000	2,881,187.50	0.90
27	ALPHAMAB ONCOLOGY	康宁杰 瑞生物 制药	9966 HK	香港联 合交易 所	中 国 香 港	400,000	2,758,564.16	0.87
28	MICROPORT SCIENTIFI C CORP	微创医 疗	853 HK	香港联 合交易 所	中 国 香 港	200,000	2,611,047.36	0.82
29	ZTE CORP-H	中兴通 讯	763 HK	香港联 合交易 所	中 国 香 港	80,000	2,316,013.76	0.73
30	NH HEALTH-B	诺辉健 康	6606 HK	香港联 合交易 所	中 国 香 港	71,000	1,790,346.86	0.56
31	CHINA MERCHANTS BANK	招商银 行	3968 HK	香港联 合交易 所	中 国 香 港	50,000	1,641,124.40	0.51
32	CANSINO BIOLOGICS INC-H	康希诺	6185 HK	香港联 合交易 所	中 国 香 港	50,000	1,205,488.85	0.38
33	REMEGEN CO LTD-H	荣昌生 物	9995 HK	香港联 合交易 所	中 国 香 港	35,000	1,105,223.53	0.35
34	CNOOC LTD	中国海 油	883 HK	香港联 合交易 所	中 国 香 港	100,000	1,032,617.60	0.32
35	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国平 安	2318 HK	香港联 合交易 所	中 国 香 港	20,000	919,214.06	0.29
36	KEYMED BIOSCIENC	康诺亚 -B	2162 HK	香港联 合交易 所	中 国 香 港	20,000	754,179.64	0.24
37	JACOBIO-B	加科思 -B	1167 HK	香港联 合交易	中 国 香 港	100,000	542,124.24	0.17

38	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	中芯国际	981 HK	香港联合交易所	中国香港	20,000	376,167.84	0.12
39	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT	中国海外发展	688 HK	香港联合交易所	中国香港	20,000	314,948.37	0.10
40	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	香港交易所	388 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000	272,168.50	0.09

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

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	9888 HK	7,166,601.48	1.84
2	CHINA RESOURCES BEER HOLDING	291 HK	4,984,055.80	1.28
3	MEITUAN DIANPING-CLASS B	3690 HK	4,950,675.52	1.27
4	AIA GROUP LTD	1299 HK	4,412,102.53	1.13
5	ZTE CORP-H	763 HK	4,354,795.33	1.12
6	TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	168 HK	3,681,140.08	0.94
7	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT	688 HK	3,152,517.94	0.81
8	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	9988 HK	2,977,248.21	0.76
9	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	2020 HK	2,787,334.27	0.72
10	LI NING CO LTD	2331 HK	2,571,215.19	0.66
11	POLY PROPERTY-H	6049 HK	2,374,300.71	0.61
12	CNOOC LTD	883 HK	2,253,897.50	0.58
13	KUAISHOU TECHNOLOGY	1024 HK	2,040,086.09	0.52
14	INNOVENT BIOLOGICS INC	1801 HK	1,902,622.59	0.49
15	CHINA MERCHANTS BANK	3968 HK	1,805,436.72	0.46
16	SHANDONG WEIGAO GROUP	1066 HK	1,733,111.07	0.44

17	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	27 HK	1,450,919.36	0.37
18	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	1,450,036.60	0.37
19	GENSCRIPT BIOTEC	1548 HK	1,317,793.17	0.34
20	WUAPTEC CO LT-H	2359 HK	1,290,007.83	0.33

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。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	853 HK	36,006,007.13	9.24
2	JD.COM INC-CL A	9618 HK	27,245,396.74	6.99
3	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	3323 HK	22,312,153.46	5.73
4	CANSINO BIOLOGICS INC-H	6185 HK	10,216,083.56	2.62
5	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	6,877,305.65	1.77
6	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	6,781,942.32	1.74
7	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	9988 HK	4,299,956.35	1.10
8	INNOVENT BIOLOGICS INC	1801 HK	3,625,352.73	0.93
9	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	688 HK	2,829,619.83	0.73
10	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	9888 HK	2,619,336.84	0.67
11	ZTE CORP-H	763 HK	2,541,020.25	0.65
12	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	268 HK	2,507,359.65	0.64
13	BEIGENE LTD	6160 HK	2,087,896.62	0.54
14	BYD CO LTD-H	1211 HK	2,035,026.40	0.52
15	GENSCRIPT BIOTEC	1548 HK	1,662,313.52	0.43
16	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	27 HK	1,450,919.36	0.37
17	CNOOC LTD	883 HK	1,126,948.75	0.29
18	CHINA OVERSEAS	2669 HK	1,084,413.41	0.28

	PROPERTY HOLD			
19	AKESO INC	9926 HK	806,699.66	0.21
20	CARSGEN THERAPEU	2171 HK	563,453.37	0.14

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。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	66,648,506.83
卖出收入（成交）总额	75,515,554.15

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。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本集合计划本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本集合计划本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本集合计划本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本集合计划本报告期末未持有基金投资。

7.11 投资组合报告附注

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

本集合计划投资的前十名证券的发行主体本报告期末未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 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。

7.11.3 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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	602,085.82

4	应收利息	-
5	应收申购款	82,243.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	684,329.80

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本集合计划本报告期末未持有可转换债券。

7.11.5 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未持有流通受限股票。

7.11.6 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（%）
光大阳光香港精选混合（QDII）A	4,402	69,848.71	63,676,335.34	20.71	243,797,689.01	79.29
光大阳光香港精选混合（QDII）C	4,985	51,098.23	344,677.34	0.14	254,380,002.68	99.86
合计	9,387	59,891.20	64,021,012.68	11.39	498,177,691.69	88.61

注：分级集合机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级集合，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级集合份额的合计数（即期末集合份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
----	------	-----------	-------------

基金管理人所有从业人员持有本基金	光大阳光香港精选混合（QDII）A	8,665,473.61	2.8183
	光大阳光香港精选混合（QDII）C	244,255.78	0.0959
	合计	8,909,729.39	1.5848

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	光大阳光香港精选混合（QDII）A	>100
	光大阳光香港精选混合（QDII）C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	光大阳光香港精选混合（QDII）A	50~100
	光大阳光香港精选混合（QDII）C	0
	合计	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	光大阳光香港精选混合（QDII）A	光大阳光香港精选混合（QDII）C
基金合同生效日 （2021年1月4日） 基金份额总额	43,936,167.89	-
本报告期期初基金份额总额	312,483,491.26	267,859,247.12
本报告期基金总申购份额	9,536,436.48	25,857,929.52
减：本报告期基金总赎回份额	14,545,903.39	38,992,496.62
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	307,474,024.35	254,724,680.02

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及托管人专门基金托管部门无重大人事变动。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	1	29,389,777.81	20.67	22,718.39	16.66	-
新鸿基	1	25,004,655.22	17.59	14,151.19	10.37	-

海通证券 (香港)	1	77,835,337.1 6	54.75	88,286.43	64.73	-
国泰君安 (香港)	1	9,934,290.79	6.99	11,244.99	8.24	-

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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本集合计划本报告期未进行债券交易、债券回购交易、基金交易以及权证交易。

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	光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII）2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定的媒介	2023 年 01 月 20 日
2	光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII）2022 年年度报告	中国证监会规定的媒介	2023 年 03 月 31 日
3	光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII）2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定的媒介	2023 年 04 月 23 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不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予《光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII）资产管理合同》变更批复的文件；

2、《光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII）资产管理合同》；

- 3、《光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII）托管协议》；
- 4、《光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII）招募说明书》；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、集合计划管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

备查文件存放于集合计划管理人的办公场所：

- 1、中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层

12.3 查阅方式

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

上海光大证券资产管理有限公司

2023 年 8 月 31 日