

# 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：广发银行股份有限公司

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。

集合计划托管人广发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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
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
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>11</b>
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	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
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	15
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	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	20
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>45</b>
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	73
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	74

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 .....	75
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 .....	75
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 .....	75
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 .....	75
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	75
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	75
7.12 市场中性策略执行情况 .....	75
7.13 投资组合报告附注 .....	76
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>78</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	78
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	78
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 .....	78
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>79</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>79</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	79
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 .....	80
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	80
10.4 基金投资策略的改变 .....	80
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	80
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 .....	80
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	80
10.8 其他重大事件 .....	81
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>82</b>
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 .....	82
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	82
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>82</b>
12.1 备查文件目录 .....	82
12.2 存放地点 .....	82
12.3 查阅方式 .....	82

## § 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	260,150,911.95 份		
基金合同存续期	存续期不超过 2023 年 12 月 31 日，本集合计划到期后，按照中国证监会相关规定执行		
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。

### 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</p>

	<p>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。

### 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	北京市东城区东长安街甲 2 号广发银行大厦
邮政编码		200127	100005
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(2023 年 1 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
本期已实现收益	57,633.15	976,653.53	5,967,201.90
本期利润	79,515.49	1,313,361.24	7,941,904.20
加权平均基金份额本期利润	0.0331	0.0356	0.0325
本期加权平均净值利润率	3.17%	3.43%	3.17%
本期基金份额净值增长率	3.23%	3.48%	3.28%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)		
期末可供分配利润	150,191.36	2,171,965.22	10,178,408.17
期末可供分配基金份额	0.0651	0.0594	0.0460

利润			
期末基金资产净值	2,456,080.92	38,708,435.91	231,486,959.87
期末基金份额净值	1.0651	1.0594	1.0460
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)		
基金份额累计净值增长率	4.21%	5.94%	4.60%

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	1.20%	0.22%	0.21%	0.01%	0.99%	0.21%
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	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	1.24%	0.21%	0.21%	0.01%	1.03%	0.20%
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	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	1.21%	0.22%	0.21%	0.01%	1.00%	0.21%
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%

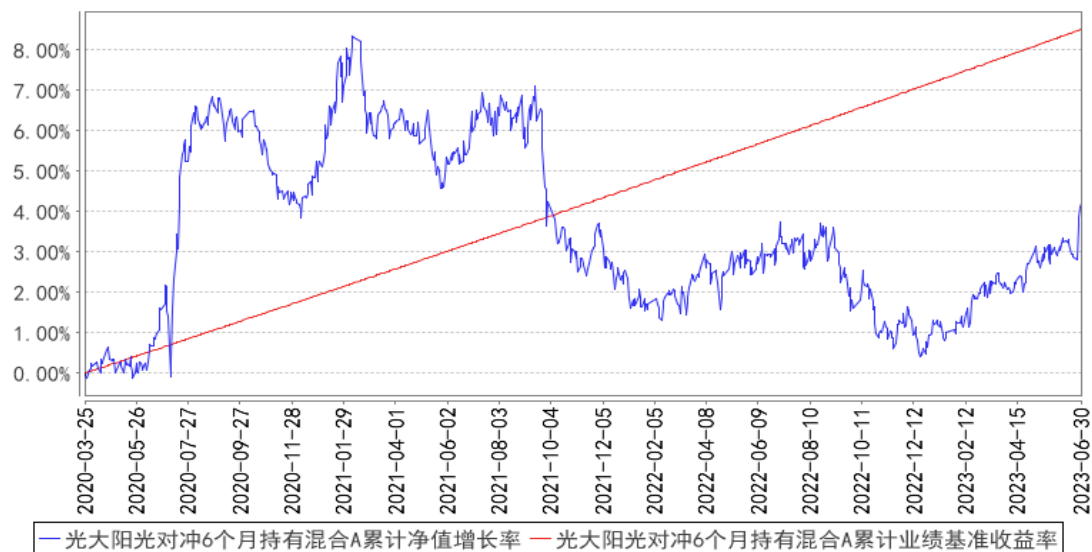
注：1、自基金合同生效起至今指 2020 年 3 月 25 日至 2023 年 6 月 30 日；

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%

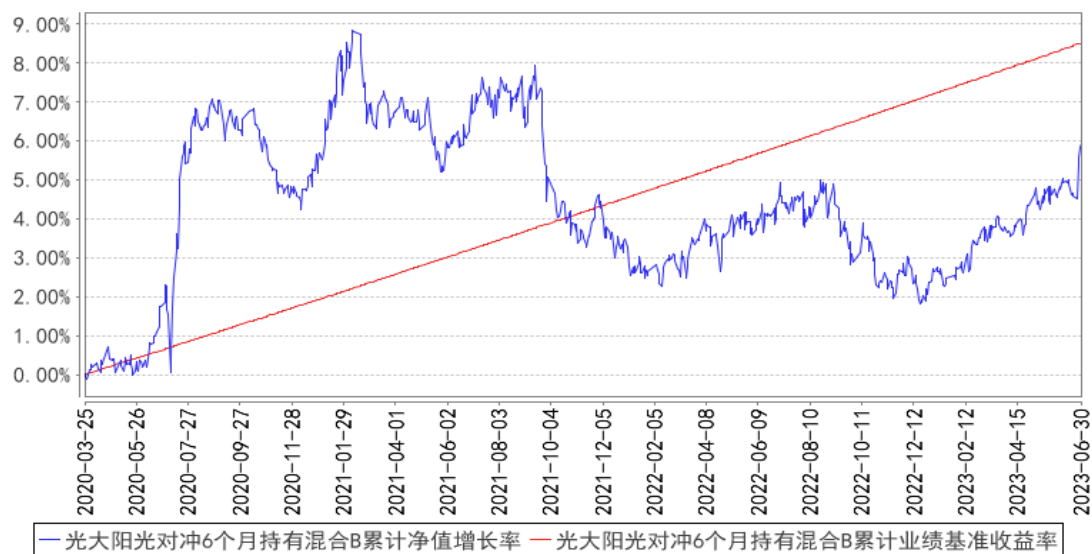
3、B 类、C 类份额设立日均为 2020 年 3 月 25 日。

### 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

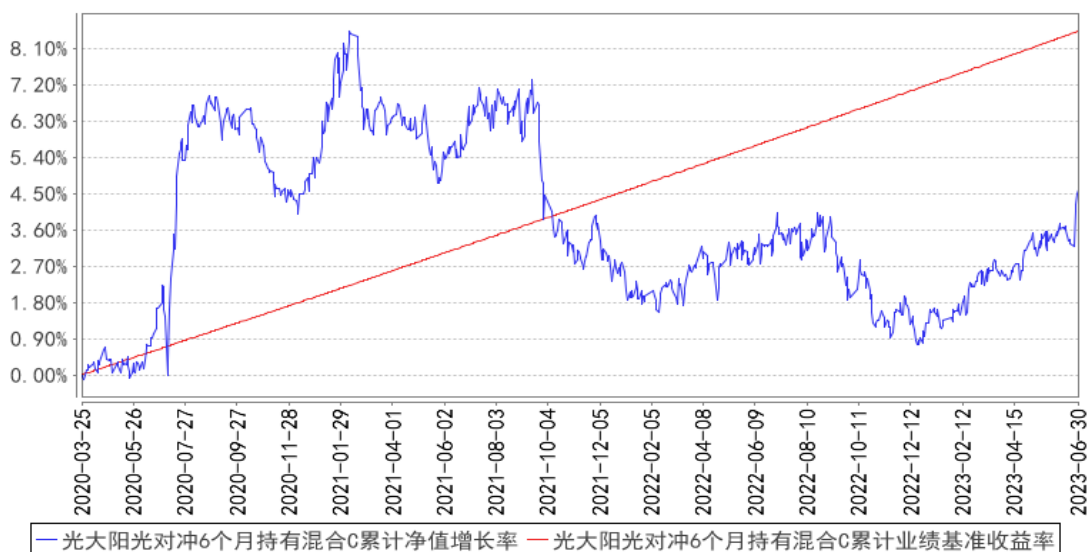
光大阳光对冲6个月持有混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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的经验。

#### 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		
陈韵聘	固定收益公募投资部投资经理、本	2023年3月17日	-	12年	陈韵聘先生，博士学位，本硕博均毕业于上海交通大学，曾担任

	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				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。
崔宁	投资经理助理	2023年03月27日	-	6年	崔宁女士，清华大学学士、硕士。2017年加入上海光大证券资产管理有限公司担任信用研究员，历任光证资管信用研究员、投资助理、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、根据管理人2023年3月27日公告，聘任崔宁为本集合计划的投资经理助理。

#### 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，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。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

今年上半年 A 股呈现高开低走之势。一月受国内疫情解封、人民币汇率上升利好推动，A 股呈现普涨态势，但是此后各主流宽基指数开始震荡下行。从风格角度，市场呈现风险偏好收缩状态，2 月以来高分红低估值特征个股跌幅有限，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 A 股先涨后跌的主要原因。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。

宏观走弱确实对股票市场造成了掣肘效果，但我们认为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。数据上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底部位置，资金流出压力将得到缓解。

#### 4.4.2 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 3.23%；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 3.48%；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 3.28%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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。

#### 4.6 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，对本集合计划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，未发现本集合计划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：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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,392,899.60	13,222,574.40
结算备付金		5,943,756.59	24,889,194.26
存出保证金		18,930,517.30	23,127,903.63
交易性金融资产	6.4.7.2	235,856,041.12	246,821,815.92
其中：股票投资		174,819,590.99	184,793,787.97
基金投资		-	-
债券投资		61,036,450.13	62,028,027.95
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	7,996,174.14	7,998,513.70
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		4,002,740.25	128,779.80
应收股利		-	-

应收申购款		49,950.05	2,500.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		275,172,079.05	316,191,281.71
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	3,357,407.22
应付赎回款		1,353,264.74	451,911.94
应付管理人报酬		226,858.89	268,610.02
应付托管费		45,171.95	53,492.73
应付销售服务费		76,901.21	93,149.85
应付投资顾问费		-	-
应交税费		87,511.43	2,349.05
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	730,894.13	861,107.13
负债合计		2,520,602.35	5,088,027.94
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	260,150,911.95	306,720,352.78
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	12,500,564.75	4,382,900.99
净资产合计		272,651,476.70	311,103,253.77
负债和净资产总计		275,172,079.05	316,191,281.71

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，集合计划份额总额 260,150,911.95 份。光大阳光对冲 6 个月持有混合 A 集合计划份额净值 1.0651 元，集合计划份额 2,305,889.56 份，集合计划资产净值 2,456,080.92 元。光大阳光对冲 6 个月持有混合 B 集合计划份额净值 1.0594 元，集合计划份额 36,536,470.69 份，集合计划资产净值 38,708,435.91 元。光大阳光对冲 6 个月持有混合 C 集合计划份额净值 1.0460 元，集合计划份额 221,308,551.70 份，集合计划资产净值 231,486,959.87 元。

## 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：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	上年度可比期间
----	-----	----	---------



		2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
<b>一、营业总收入</b>		11,697,207.65	4,176,814.56
1. 利息收入		122,462.51	466,001.90
其中：存款利息收入	6.4.7.13	76,949.39	305,354.44
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		45,513.12	160,647.46
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		9,241,452.79	7,199,663.22
其中：股票投资收益	6.4.7.14	12,656,278.68	-23,762,898.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	127,104.79	1,018,029.85
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	34,689.00
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-5,483,952.92	27,811,942.97
股利收益	6.4.7.19	1,942,022.24	2,097,900.01
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	2,333,292.35	-3,488,850.56
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	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		2,362,426.72	3,422,943.58
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,453,822.44	2,115,214.17
2. 托管费	6.4.10.2.2	289,521.67	421,496.83
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	498,106.69	757,004.56
4. 投资顾问费		-	-
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		32,351.56	23,671.34
8. 其他费用	6.4.7.23	88,624.36	105,373.11
<b>三、利润总额（亏损总额</b>		9,334,780.93	753,870.98

以“-”号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		9,334,780.93	753,870.98
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		9,334,780.93	753,870.98

### 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：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）	306,720,352.78	-	4,382,900.99	311,103,253.77
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）	306,720,352.78	-	4,382,900.99	311,103,253.77
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列)	-46,569,440.83	-	8,117,663.76	-38,451,777.07
（一）、综合收益总额	-	-	9,334,780.93	9,334,780.93
（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)	-46,569,440.83	-	-1,217,117.17	-47,786,558.00
其中：1. 基金申购款	935,550.81	-	22,305.73	957,856.54
2. 基金赎回款	-47,504,991.64	-	-1,239,422.90	-48,744,414.54
（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)	260,150,911.95	-	12,500,564.75	272,651,476.70
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)	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、本期期初净资产(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、本期期末净资产(基金净值)	365,160,363.36	-	11,708,160.11	376,868,523.47

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：

<u>常松</u>	<u>詹朋</u>	<u>杨薇</u>
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。本集合计划存续期不超过 2023 年 12 月 31 日，本集合计划到期后，按照中国证监会相关规定执行。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。

#### 6.4.7 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	2,392,899.60
等于：本金	2,391,042.33
加：应计利息	1,857.27
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	2,392,899.60

##### 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	174,898,507.19	-	174,819,590.99	-78,916.20	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	40,231,469.42	176,500.00	40,696,861.74	288,892.32
	银行间市场	19,860,290.00	314,588.39	20,339,588.39	164,710.00
	合计	60,091,759.42	491,088.39	61,036,450.13	453,602.32
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	234,990,266.61	491,088.39	235,856,041.12	374,686.12	

### 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 2023 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	-157,700,816.74	-	-	-
其中：股指期货投资	-157,700,816.74	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-157,700,816.74	-	-	-

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
IC2307	IC2307	-6.00	-7,188,960.00	16,690.91
IC2309	IC2309	-40.00	-47,760,000.00	1,022,305.26
IF2309	IF2309	-17.00	-19,578,900.00	152,219.24
IM2307	IM2307	-4.00	-5,259,840.00	-86,858.67
IM2309	IM2309	-59.00	-77,129,520.00	-320,760.00
合计				783,596.74
减：可抵销期货暂收款				783,596.74
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 2023 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	7,996,174.14	-
银行间市场	-	-
合计	7,996,174.14	-

##### 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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	641,469.77
其中：交易所市场	641,294.77
银行间市场	175.00
应付利息	-
预提费用	89,424.36
合计	730,894.13

#### 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 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	2,615,678.28	2,615,678.28
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-309,788.72	-309,788.72
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	2,305,889.56	2,305,889.56

##### 光大阳光对冲 6 个月持有混合 B

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	37,128,843.54	37,128,843.54
本期申购	63,392.85	63,392.85
本期赎回（以“-”号填列）	-655,765.70	-655,765.70
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	36,536,470.69	36,536,470.69

##### 光大阳光对冲 6 个月持有混合 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	266,975,830.96	266,975,830.96
本期申购	872,157.96	872,157.96

本期赎回（以“-”号填列）	-46,539,437.22	-46,539,437.22
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	221,308,551.70	221,308,551.70

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
上年度末	404,849.55	-321,569.66	83,279.89
本期利润	57,633.15	21,882.34	79,515.49
本期基金份额交易产生的变动数	-13,100.21	496.19	-12,604.02
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-13,100.21	496.19	-12,604.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	449,382.49	-299,191.13	150,191.36

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
上年度末	1,910,435.23	-1,027,424.08	883,011.15
本期利润	976,653.53	336,707.71	1,313,361.24
本期基金份额交易产生的变动数	-26,758.25	2,351.08	-24,407.17
其中：基金申购款	3,503.59	-192.69	3,310.90
基金赎回款	-30,261.84	2,543.77	-27,718.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,860,330.51	-688,365.29	2,171,965.22

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
上年度末	10,559,919.10	-7,143,309.15	3,416,609.95
本期利润	5,967,201.90	1,974,702.30	7,941,904.20
本期基金份额交易产生的变动数	-2,283,943.77	1,103,837.79	-1,180,105.98
其中：基金申购款	41,655.42	-22,660.59	18,994.83
基金赎回款	-2,325,599.19	1,126,498.38	-1,199,100.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,243,177.23	-4,064,769.06	10,178,408.17

### 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	58,918.03
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	17,165.32
其他	866.04
合计	76,949.39

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	12,656,278.68
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	12,656,278.68

#### 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	982,846,168.27
减：卖出股票成本总额	968,412,195.91
减：交易费用	1,777,693.68
买卖股票差价收入	12,656,278.68

#### 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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	576,163.07
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-449,058.28

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	127,104.79

#### 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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	260,101,234.52
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	259,238,198.98
减：应计利息总额	1,292,438.08
减：交易费用	19,655.74
买卖债券差价收入	-449,058.28

#### 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

本集合计划本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 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

本集合计划本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

##### 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
	2023年1月1日至2023年6月30日
股指期货投资收益	-5,483,952.92

**6.4.7.19 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	1,942,022.24
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	1,942,022.24

**6.4.7.20 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	5,180,129.65
股票投资	4,367,349.33
债券投资	812,780.32
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-2,809,052.54
权证投资	-
期货投资	-2,809,052.54
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	37,784.76
合计	2,333,292.35

#### 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 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	600.00
账户维护费	18,600.00
合计	88,624.36

#### 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

本集合本报告期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
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
光大期货有限公司（“光大期货”）	集合计划管理的股东控制的公司

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	1,936,916,817.87	100.00	2,568,128,451.46	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 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	487,800,246.34	100.00	262,981,109.60	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 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	466,900,000.00	100.00	1,733,500,000.00	100.00

##### 6.4.10.1.4 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。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	641,294.77	100.00	641,294.77	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	1,307,122.29	100.00	2,436,224.49	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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	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	1,453,822.44	2,115,214.17
其中：支付销售机构的客户维护费	695,593.35	1,016,831.62

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

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	289,521.67	421,496.83

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 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	-	-	642.34	642.34
光证资管	-	-	1.81	1.81
合计	-	-	644.15	644.15
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

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固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

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 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
广发银行股份有限公司	2,392,899.60	58,918.03	50,885,566.97	110,980.91

注：本集合计划的银行存款由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2023年6月30日，本集合无应付交易手续费余额。于2023年1月1日-2023年6月30日期间，本集合期间交易手续费支出19,987.76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2023年6月30日，本集合的结算备付金余额为3,312,471.05元，存出保证金余额为18,830,066.40元。

#### 6.4.11 利润分配情况

本集合计划本报告期未进行利润分配。

## 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

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
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	11.88	21.02	274	3,255.12	5,759.48	-
001324	长青科技	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	18.88	19.60	73	1,378.24	1,430.80	-
001328	登康口腔	2023年3月29日	6个月	新股流通受限	20.68	25.49	111	2,295.48	2,829.39	-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	15.38	14.87	122	1,876.36	1,814.14	-
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	44.48	39.48	40	1,779.20	1,579.20	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	1-6个月（含）	新股流通受限	25.82	25.82	2,246	57,991.72	57,991.72	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	236	6,985.60	16,855.12	-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	32.29	51.12	177	5,715.33	9,048.24	-
301317	鑫磊股份	2023年1月12日	6个月	新股流通受限	20.67	26.17	296	6,118.32	7,746.32	-
301358	湖南	2023年2月	6个月	新股流通	23.77	42.89	438	10,411.26	18,785.82	-

	裕能	1 日		受限						
301429	森泰股份	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	28.75	21.02	246	7,072.50	5,170.92	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	11.66	12.26	339	3,952.74	4,156.14	-
601916	浙商银行	2023 年 6 月 27 日	1-6 个月(含)	配股流通受限	2.02	2.64	1,740	3,514.80	4,593.60	-
603135	中重科技	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	17.80	17.89	292	5,197.60	5,223.88	-
603137	恒尚节能	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	15.90	17.09	67	1,065.30	1,145.03	-
603172	万丰股份	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通受限	14.58	16.13	60	874.80	967.80	-
688352	颀中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股流通受限	12.10	12.07	805	9,740.50	9,716.35	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	23.60	64.67	336	7,929.60	21,729.12	-
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.20	25.53	289	5,548.80	7,378.17	-
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股流通受限	26.66	31.50	257	6,851.62	8,095.50	-
688469	中芯	2023 年 4 月	6 个月	新股流通	5.69	5.41	2,876	16,364.44	15,559.16	-

	集成	28日		受限						
688478	晶升股份	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	32.52	42.37	266	8,650.32	11,270.42	-
688484	南芯科技	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	39.99	36.71	298	11,917.02	10,939.58	-
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	新股流通受限	21.86	23.85	353	7,716.58	8,419.05	-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	12.68	22.31	467	5,921.56	10,418.77	-
688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	9.26	18.59	482	4,463.32	8,960.38	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	25.28	29.87	232	5,864.96	6,929.84	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601298	青岛港	2023年6月28日	重大事项	6.97	-	-	10,700	75,648.55	74,579.00	-
000540	*ST中天	2023年6月20日	重大事项	0.00	-	-	99,486	75,752.64	0.00	-

#### 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

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	13,598,947.40	25,011,330.25
AAA 以下	27,097,914.34	26,886,374.41
未评级	20,339,588.39	10,130,323.29
合计	61,036,450.13	62,028,027.95

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

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，部分证券流通暂时受限的情况参见附注6.4.12“期末(2023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 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	2,392,899.60	-	-	-	2,392,899.60
结算备付金	5,943,756.59	-	-	-	5,943,756.59
存出保证金	18,930,517.30	-	-	-	18,930,517.30
交易性金融资产	21,219,776.05	36,203,078.15	3,613,595.93	174,819,590.99	235,856,041.12
买入返售金融资产	7,996,174.14	-	-	-	7,996,174.14
应收申购款	-	-	-	49,950.05	49,950.05
应收清算款	-	-	-	4,002,740.25	4,002,740.25
资产总计	56,483,123.68	36,203,078.15	3,613,595.93	178,872,281.29	275,172,079.05
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,353,264.74	1,353,264.74

应付管理人报酬	-	-	-	226,858.89	226,858.89
应付托管费	-	-	-	45,171.95	45,171.95
应付销售服务费	-	-	-	76,901.21	76,901.21
应交税费	-	-	-	87,511.43	87,511.43
其他负债	-	-	-	730,894.13	730,894.13
负债总计	-	-	-	2,520,602.35	2,520,602.35
利率敏感度缺口	56,483,123.68	36,203,078.15	3,613,595.93	176,351,678.94	272,651,476.70
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	13,222,574.40	-	-	-	13,222,574.40
结算备付金	24,889,194.26	-	-	-	24,889,194.26
存出保证金	23,127,903.63	-	-	-	23,127,903.63
交易性金融资产	30,773,583.56	29,497,421.72	1,757,022.67	184,793,787.97	246,821,815.92
买入返售金融资产	7,998,513.70	-	-	-	7,998,513.70
应收申购款	-	-	-	2,500.00	2,500.00
应收清算款	-	-	-	128,779.80	128,779.80
资产总计	100,011,769.55	29,497,421.72	1,757,022.67	184,925,067.77	316,191,281.71
负债					
应付赎回款	-	-	-	451,911.94	451,911.94
应付管理人报酬	-	-	-	268,610.02	268,610.02
应付托管费	-	-	-	53,492.73	53,492.73
应付清算款	-	-	-	3,357,407.22	3,357,407.22
应付销售服务费	-	-	-	93,149.85	93,149.85
应交税费	-	-	-	2,349.05	2,349.05
其他负债	-	-	-	861,107.13	861,107.13
负债总计	-	-	-	5,088,027.94	5,088,027.94
利率敏感度缺口	100,011,769.55	29,497,421.72	1,757,022.67	179,837,039.83	311,103,253.77

#### 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		
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）
	市场利率上升 25 个基点	-17,267.44	-22,732.23
市场利率下降 25 个基点	17,267.44	22,732.23	

### 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

本集合计划本报告期末不存在外汇风险敞口。

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

本集合计划本报告期末不存在外汇风险。

### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是集合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。本集合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。本集合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，管理人每日对本集合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合计划进行风险度量，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	174,819,590.99	64.12	184,793,787.97	59.40
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	174,819,590.99	64.12	184,793,787.97	59.40

#### 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	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	6,426,031.36	8,414,467.00
	沪深 300 指数下降 5%	-6,426,031.36	-8,414,467.00

#### 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末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	215,181,953.39	215,616,320.03
第二层次	20,472,159.11	31,016,281.36
第三层次	201,928.62	189,214.53
合计	235,856,041.12	246,821,815.92

###### 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	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	其他各项资产	22,983,207.60	8.35
9	合计	275,172,079.05	100.00

注：本集合计划本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

### 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	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

### 7.2.2 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通过港股通交易机制投资的港股。

### 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	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
11	002025	航天电器	25,100	1,601,380.00	0.59
12	600519	贵州茅台	919	1,554,029.00	0.57
13	601668	中国建筑	258,800	1,485,512.00	0.54
14	002215	诺普信	196,400	1,474,964.00	0.54
15	000538	云南白药	26,680	1,400,166.40	0.51
16	002267	陕天然气	167,100	1,323,432.00	0.49
17	002737	葵花药业	52,500	1,277,850.00	0.47
18	000048	京基智农	65,000	1,268,800.00	0.47
19	002152	广电运通	106,700	1,250,524.00	0.46
20	603883	老百姓	39,400	1,176,090.00	0.43

21	600332	白云山	35,600	1,134,928.00	0.42
22	002154	报喜鸟	202,200	1,116,144.00	0.41
23	600486	扬农化工	12,700	1,110,234.00	0.41
24	002128	电投能源	83,900	1,109,158.00	0.41
25	300017	网宿科技	155,400	1,104,894.00	0.41
26	600438	通威股份	32,200	1,104,782.00	0.41
27	300729	乐歌股份	61,820	1,102,868.80	0.40
28	002929	润建股份	25,400	1,102,614.00	0.40
29	600585	海螺水泥	46,400	1,101,536.00	0.40
30	002588	史丹利	180,200	1,095,616.00	0.40
31	601958	金钼股份	98,100	1,093,815.00	0.40
32	603868	飞科电器	17,300	1,091,457.00	0.40
33	603156	养元饮品	43,800	1,081,860.00	0.40
34	002448	中原内配	153,300	1,073,100.00	0.39
35	601857	中国石油	137,000	1,023,390.00	0.38
36	300866	安克创新	11,600	1,015,000.00	0.37
37	002422	科伦药业	33,000	979,440.00	0.36
38	300206	理邦仪器	57,500	867,100.00	0.32
39	300593	新雷能	36,300	831,633.00	0.31
40	300750	宁德时代	3,589	821,127.31	0.30
41	600690	海尔智家	34,900	819,452.00	0.30
42	603187	海容冷链	40,160	802,798.40	0.29
43	002990	盛视科技	21,700	798,560.00	0.29
44	603368	柳药集团	32,100	793,191.00	0.29
45	601618	中国中冶	199,200	790,824.00	0.29
46	600073	上海梅林	105,800	772,340.00	0.28
47	600167	联美控股	106,100	739,517.00	0.27
48	301239	普瑞眼科	7,500	735,600.00	0.27
49	601717	郑煤机	57,900	720,855.00	0.26
50	601601	中国太保	26,800	696,264.00	0.26
51	601988	中国银行	177,100	692,461.00	0.25
52	002651	利君股份	88,200	685,314.00	0.25
53	300775	三角防务	20,200	682,356.00	0.25
54	600398	海澜之家	98,400	676,992.00	0.25
55	002772	众兴菌业	59,200	668,960.00	0.25
56	300041	回天新材	55,800	658,440.00	0.24
57	600020	中原高速	178,900	656,563.00	0.24
58	300638	广和通	28,700	650,916.00	0.24
59	002441	众业达	56,900	648,660.00	0.24
60	600728	佳都科技	93,500	647,955.00	0.24
61	601519	大智慧	89,700	642,252.00	0.24
62	600351	亚宝药业	90,300	641,130.00	0.24
63	600888	新疆众和	80,900	640,728.00	0.23

64	603299	苏盐井神	64,200	640,716.00	0.23
65	002546	新联电子	103,800	638,370.00	0.23
66	000650	仁和药业	103,400	634,876.00	0.23
67	601669	中国电建	110,400	633,696.00	0.23
68	603199	九华旅游	18,300	632,265.00	0.23
69	002103	广博股份	105,400	631,346.00	0.23
70	300842	帝科股份	6,900	630,936.00	0.23
71	600633	浙数文化	38,900	630,569.00	0.23
72	002381	双箭股份	81,600	629,952.00	0.23
73	300783	三只松鼠	32,200	629,188.00	0.23
74	603689	皖天然气	71,500	627,055.00	0.23
75	300533	冰川网络	12,550	626,998.00	0.23
76	603230	内蒙新华	48,600	626,940.00	0.23
77	603519	立霸股份	42,300	626,886.00	0.23
78	002728	特一药业	40,860	623,115.00	0.23
79	603518	锦泓集团	54,900	623,115.00	0.23
80	002763	汇洁股份	70,200	621,972.00	0.23
81	603587	地素时尚	42,400	620,736.00	0.23
82	300434	金石亚药	45,700	618,778.00	0.23
83	688569	铁科轨道	14,700	618,429.00	0.23
84	603768	常青股份	34,800	618,396.00	0.23
85	603367	辰欣药业	40,600	616,308.00	0.23
86	300304	云意电气	111,200	616,048.00	0.23
87	603358	华达科技	32,300	615,638.00	0.23
88	600926	杭州银行	52,000	611,000.00	0.22
89	600809	山西汾酒	3,100	573,717.00	0.21
90	000338	潍柴动力	43,600	543,256.00	0.20
91	601009	南京银行	66,800	534,400.00	0.20
92	600050	中国联通	110,700	531,360.00	0.19
93	601319	中国人保	88,400	516,256.00	0.19
94	300014	亿纬锂能	8,500	514,250.00	0.19
95	600035	楚天高速	118,300	482,664.00	0.18
96	000063	中兴通讯	10,200	464,508.00	0.17
97	300532	今天国际	22,400	460,544.00	0.17
98	601038	一拖股份	39,100	459,034.00	0.17
99	002966	苏州银行	65,900	431,645.00	0.16
100	003816	中国广核	128,900	400,879.00	0.15
101	688599	天合光能	9,300	396,273.00	0.15
102	600085	同仁堂	6,600	379,896.00	0.14
103	600887	伊利股份	13,400	379,488.00	0.14
104	000400	许继电气	16,300	375,715.00	0.14
105	000596	古井贡酒	1,500	371,070.00	0.14
106	600060	海信视像	14,500	358,875.00	0.13



107	000858	五粮液	2,100	343,497.00	0.13
108	600600	青岛啤酒	3,300	341,979.00	0.13
109	601877	正泰电器	12,300	340,095.00	0.12
110	600597	光明乳业	32,400	336,960.00	0.12
111	000568	泸州老窖	1,602	335,731.14	0.12
112	601816	京沪高铁	61,100	321,386.00	0.12
113	300433	蓝思科技	26,800	315,168.00	0.12
114	601088	中国神华	10,100	310,575.00	0.11
115	600901	江苏金租	71,620	295,790.60	0.11
116	605499	东鹏饮料	1,700	293,930.00	0.11
117	600036	招商银行	8,909	291,858.84	0.11
118	002446	盛路通信	30,400	287,280.00	0.11
119	002236	大华股份	14,500	286,375.00	0.11
120	300133	华策影视	39,600	280,764.00	0.10
121	600109	国金证券	32,100	278,307.00	0.10
122	002027	分众传媒	40,700	277,167.00	0.10
123	002507	涪陵榨菜	14,990	274,466.90	0.10
124	600918	中泰证券	39,300	271,563.00	0.10
125	600886	国投电力	20,700	261,855.00	0.10
126	688029	南微医学	3,200	260,992.00	0.10
127	600329	达仁堂	5,800	260,362.00	0.10
128	603979	金诚信	8,300	258,130.00	0.09
129	688676	金盘科技	8,400	254,436.00	0.09
130	002563	森马服饰	40,600	252,532.00	0.09
131	002352	顺丰控股	5,500	247,995.00	0.09
132	600570	恒生电子	5,400	239,166.00	0.09
133	688556	高测股份	4,500	239,130.00	0.09
134	601100	恒立液压	3,700	238,021.00	0.09
135	600583	海油工程	40,000	234,000.00	0.09
136	601702	华峰铝业	17,000	232,560.00	0.09
137	300124	汇川技术	3,600	231,156.00	0.08
138	300332	天壕能源	20,100	230,547.00	0.08
139	600028	中国石化	36,200	230,232.00	0.08
140	600315	上海家化	7,900	229,179.00	0.08
141	600436	片仔癀	800	229,088.00	0.08
142	300762	上海瀚讯	19,300	227,161.00	0.08
143	000811	冰轮环境	14,300	225,368.00	0.08
144	600531	豫光金铅	35,600	224,280.00	0.08
145	688239	航宇科技	3,200	223,840.00	0.08
146	002484	江海股份	10,400	221,416.00	0.08
147	002402	和而泰	13,000	220,740.00	0.08
148	000100	TCL科技	55,460	218,512.40	0.08
149	002020	京新药业	17,000	217,940.00	0.08

150	000528	柳工	27,500	217,250.00	0.08
151	600612	老凤祥	3,100	216,628.00	0.08
152	600933	爱柯迪	9,300	216,597.00	0.08
153	601985	中国核电	30,500	215,025.00	0.08
154	002085	万丰奥威	31,000	214,830.00	0.08
155	600266	城建发展	41,800	212,344.00	0.08
156	600458	时代新材	17,700	212,223.00	0.08
157	300674	宇信科技	12,000	212,160.00	0.08
158	003006	百亚股份	12,100	209,088.00	0.08
159	000917	电广传媒	28,500	208,335.00	0.08
160	688148	芳源股份	17,000	207,400.00	0.08
161	000425	徐工机械	30,300	205,131.00	0.08
162	002434	万里扬	22,900	204,955.00	0.08
163	600502	安徽建工	38,800	204,864.00	0.08
164	002063	远光软件	23,400	203,112.00	0.07
165	601006	大秦铁路	27,300	202,839.00	0.07
166	300723	一品红	6,900	202,170.00	0.07
167	688389	普门科技	8,600	202,014.00	0.07
168	300633	开立医疗	3,700	201,650.00	0.07
169	301039	中集车辆	15,200	201,096.00	0.07
170	603369	今世缘	3,800	200,640.00	0.07
171	600158	中体产业	19,700	200,152.00	0.07
172	301015	百洋医药	7,200	199,872.00	0.07
173	601898	中煤能源	23,400	197,496.00	0.07
174	600312	平高电气	15,900	197,001.00	0.07
175	300855	图南股份	5,540	195,672.80	0.07
176	000951	中国重汽	11,600	195,460.00	0.07
177	600999	招商证券	14,400	195,408.00	0.07
178	002649	博彦科技	13,800	194,994.00	0.07
179	600066	宇通客车	13,200	194,568.00	0.07
180	603027	千禾味业	9,000	190,080.00	0.07
181	300628	亿联网络	5,420	190,079.40	0.07
182	300130	新国都	6,700	189,811.00	0.07
183	600552	凯盛科技	15,900	188,256.00	0.07
184	002283	天润工业	28,900	185,538.00	0.07
185	601117	中国化学	22,400	185,472.00	0.07
186	300294	博雅生物	5,100	185,028.00	0.07
187	600478	科力远	25,900	184,926.00	0.07
188	603588	高能环境	19,500	182,715.00	0.07
189	688777	中控技术	2,900	182,062.00	0.07
190	300679	电连技术	5,500	181,775.00	0.07
191	601369	陕鼓动力	19,900	181,289.00	0.07
192	300298	三诺生物	6,700	181,168.00	0.07

193	688139	海尔生物	3,500	180,145.00	0.07
194	002782	可立克	11,700	178,893.00	0.07
195	688100	威胜信息	6,000	178,860.00	0.07
196	603170	宝立食品	8,400	178,584.00	0.07
197	603959	百利科技	15,500	178,250.00	0.07
198	600718	东软集团	16,700	178,022.00	0.07
199	002400	省广集团	36,900	177,489.00	0.07
200	002724	海洋王	20,400	177,072.00	0.06
201	002006	精工科技	8,200	176,874.00	0.06
202	600346	恒力石化	12,300	176,259.00	0.06
203	603345	安井食品	1,200	176,160.00	0.06
204	603308	应流股份	9,600	175,680.00	0.06
205	603567	珍宝岛	11,700	175,032.00	0.06
206	002746	仙坛股份	22,200	174,936.00	0.06
207	600797	浙大网新	24,500	174,930.00	0.06
208	600420	国药现代	15,400	173,866.00	0.06
209	300408	三环集团	5,900	173,165.00	0.06
210	603328	依顿电子	20,900	173,052.00	0.06
211	002223	鱼跃医疗	4,800	172,752.00	0.06
212	002706	良信股份	15,300	172,125.00	0.06
213	000913	钱江摩托	9,400	171,362.00	0.06
214	603100	川仪股份	4,400	170,984.00	0.06
215	002244	滨江集团	19,300	170,226.00	0.06
216	300055	万邦达	23,500	169,200.00	0.06
217	601886	江河集团	19,000	168,910.00	0.06
218	601058	赛轮轮胎	14,800	168,572.00	0.06
219	002698	博实股份	9,600	167,904.00	0.06
220	603599	广信股份	6,200	167,896.00	0.06
221	300455	航天智装	14,500	166,025.00	0.06
222	002641	公元股份	29,400	165,816.00	0.06
223	600039	四川路桥	16,900	165,789.00	0.06
224	600572	康恩贝	24,200	165,770.00	0.06
225	002815	崇达技术	13,300	165,585.00	0.06
226	601899	紫金矿业	14,529	165,194.73	0.06
227	601222	林洋能源	20,100	164,619.00	0.06
228	002171	楚江新材	23,100	164,472.00	0.06
229	600919	江苏银行	22,300	163,905.00	0.06
230	600587	新华医疗	4,600	162,518.00	0.06
231	601211	国泰君安	11,600	162,284.00	0.06
232	600489	中金黄金	15,700	162,181.00	0.06
233	000550	江铃汽车	11,700	161,928.00	0.06
234	002320	海峡股份	26,800	161,872.00	0.06
235	600835	上海机电	9,400	161,492.00	0.06

236	002991	甘源食品	2,100	161,070.00	0.06
237	603871	嘉友国际	10,200	160,242.00	0.06
238	603288	海天味业	3,420	160,227.00	0.06
239	600061	国投资本	22,500	160,200.00	0.06
240	002139	拓邦股份	12,200	159,210.00	0.06
241	000801	四川九洲	21,800	159,140.00	0.06
242	601607	上海医药	7,101	159,133.41	0.06
243	002212	天融信	16,400	159,080.00	0.06
244	300773	拉卡拉	9,100	158,704.00	0.06
245	688066	航天宏图	2,600	158,340.00	0.06
246	300856	科思股份	2,000	157,540.00	0.06
247	000682	东方电子	16,200	157,464.00	0.06
248	300738	奥飞数据	15,400	157,080.00	0.06
249	000848	承德露露	17,700	156,645.00	0.06
250	000690	宝新能源	22,300	156,546.00	0.06
251	300316	晶盛机电	2,200	155,980.00	0.06
252	603612	索通发展	9,000	155,970.00	0.06
253	603801	志邦家居	4,700	155,194.00	0.06
254	605388	均瑶健康	12,200	155,062.00	0.06
255	002697	红旗连锁	26,500	154,760.00	0.06
256	600320	振华重工	41,200	153,676.00	0.06
257	002130	沃尔核材	18,900	153,468.00	0.06
258	600339	中油工程	37,700	153,439.00	0.06
259	603018	华设集团	17,500	153,125.00	0.06
260	300470	中密控股	3,300	152,526.00	0.06
261	600184	光电股份	11,600	152,308.00	0.06
262	000555	神州信息	12,300	151,290.00	0.06
263	601963	重庆银行	19,000	150,290.00	0.06
264	601658	邮储银行	30,700	150,123.00	0.06
265	601808	中海油服	10,800	149,904.00	0.05
266	300900	广联航空	5,200	149,812.00	0.05
267	688617	惠泰医疗	400	149,500.00	0.05
268	600929	雪天盐业	18,800	149,272.00	0.05
269	300347	泰格医药	2,300	148,442.00	0.05
270	603688	石英股份	1,300	147,992.00	0.05
271	000969	安泰科技	15,600	147,732.00	0.05
272	002373	千方科技	10,800	147,312.00	0.05
273	000333	美的集团	2,500	147,300.00	0.05
274	002017	东信和平	11,170	146,438.70	0.05
275	600007	中国国贸	7,800	144,456.00	0.05
276	688363	华熙生物	1,600	142,656.00	0.05
277	300768	迪普科技	8,600	142,502.00	0.05
278	002156	通富微电	6,300	142,380.00	0.05

279	002415	海康威视	4,300	142,373.00	0.05
280	601390	中国中铁	18,600	140,988.00	0.05
281	002051	中工国际	11,800	140,774.00	0.05
282	002180	纳思达	4,100	140,425.00	0.05
283	300382	斯莱克	10,600	139,814.00	0.05
284	002950	奥美医疗	13,400	139,092.00	0.05
285	002967	广电计量	6,900	138,621.00	0.05
286	002194	武汉凡谷	12,600	137,718.00	0.05
287	300770	新媒股份	3,000	137,580.00	0.05
288	000921	海信家电	5,100	137,445.00	0.05
289	601600	中国铝业	25,000	137,250.00	0.05
290	002048	宁波华翔	10,200	136,680.00	0.05
291	605222	起帆电缆	6,600	136,356.00	0.05
292	688270	臻镭科技	2,100	136,353.00	0.05
293	603171	税友股份	3,400	135,932.00	0.05
294	002233	塔牌集团	17,600	135,872.00	0.05
295	300737	科顺股份	14,800	135,568.00	0.05
296	600639	浦东金桥	10,900	135,269.00	0.05
297	605296	神农集团	6,300	134,946.00	0.05
298	300827	上能电气	3,732	134,538.60	0.05
299	000928	中钢国际	13,900	134,135.00	0.05
300	601208	东材科技	10,500	133,350.00	0.05
301	600588	用友网络	6,500	133,250.00	0.05
302	002736	国信证券	15,200	132,696.00	0.05
303	002001	新和成	8,600	132,440.00	0.05
304	002254	泰和新材	5,400	132,138.00	0.05
305	002106	莱宝高科	15,400	130,900.00	0.05
306	600966	博汇纸业	22,100	130,832.00	0.05
307	603197	保隆科技	2,400	130,200.00	0.05
308	300413	芒果超媒	3,800	129,998.00	0.05
309	300119	瑞普生物	7,300	129,940.00	0.05
310	600562	国睿科技	8,000	129,600.00	0.05
311	002384	东山精密	5,000	129,500.00	0.05
312	603098	森特股份	6,300	129,150.00	0.05
313	600985	淮北矿业	11,200	129,024.00	0.05
314	603877	太平鸟	5,100	128,928.00	0.05
315	002011	盾安环境	9,300	128,619.00	0.05
316	600480	凌云股份	16,300	128,118.00	0.05
317	688133	泰坦科技	1,500	127,785.00	0.05
318	002847	盐津铺子	1,500	127,575.00	0.05
319	003012	东鹏控股	15,700	127,013.00	0.05
320	600984	建设机械	28,100	127,012.00	0.05
321	002675	东诚药业	8,600	126,506.00	0.05

322	600422	昆药集团	6,100	126,392.00	0.05
323	600863	内蒙华电	30,400	126,160.00	0.05
324	603053	成都燃气	12,500	125,875.00	0.05
325	603529	爱玛科技	3,900	125,658.00	0.05
326	001696	宗申动力	17,700	125,316.00	0.05
327	300763	锦浪科技	1,200	124,920.00	0.05
328	600248	陕建股份	26,100	124,497.00	0.05
329	002396	星网锐捷	5,500	124,245.00	0.05
330	002064	华峰化学	18,100	124,166.00	0.05
331	603416	信捷电气	3,000	123,930.00	0.05
332	600373	中文传媒	9,300	123,876.00	0.05
333	600746	江苏索普	18,800	122,764.00	0.05
334	600707	彩虹股份	25,700	122,332.00	0.04
335	000061	农产品	20,400	122,196.00	0.04
336	600717	天津港	27,500	121,825.00	0.04
337	600399	抚顺特钢	11,900	121,380.00	0.04
338	002979	雷赛智能	5,100	121,176.00	0.04
339	603071	物产环能	7,300	121,107.00	0.04
340	603108	润达医疗	6,500	120,770.00	0.04
341	000426	兴业银锡	13,600	120,768.00	0.04
342	600674	川投能源	8,000	120,400.00	0.04
343	300760	迈瑞医疗	400	119,920.00	0.04
344	000030	富奥股份	23,500	118,440.00	0.04
345	002273	水晶光电	9,900	118,206.00	0.04
346	603010	万盛股份	10,800	117,396.00	0.04
347	688190	云路股份	1,600	116,800.00	0.04
348	300406	九强生物	5,000	116,650.00	0.04
349	002429	兆驰股份	21,100	116,050.00	0.04
350	000050	深天马A	12,600	115,668.00	0.04
351	600528	中铁工业	11,700	115,596.00	0.04
352	600971	恒源煤电	14,800	115,292.00	0.04
353	600662	外服控股	20,100	114,972.00	0.04
354	300942	易瑞生物	9,200	114,908.00	0.04
355	000923	河钢资源	8,500	114,750.00	0.04
356	688173	希荻微	5,000	114,400.00	0.04
357	601688	华泰证券	8,300	114,291.00	0.04
358	300476	胜宏科技	4,700	113,317.00	0.04
359	600416	湘电股份	5,900	112,631.00	0.04
360	603659	璞泰来	2,945	112,557.90	0.04
361	000738	航发控制	4,600	112,240.00	0.04
362	600360	华微电子	16,300	112,144.00	0.04
363	300416	苏试试验	5,200	112,112.00	0.04
364	002065	东华软件	15,800	111,548.00	0.04

365	603032	德新科技	3,220	111,218.80	0.04
366	600989	宝丰能源	8,800	110,968.00	0.04
367	600210	紫江企业	20,800	110,656.00	0.04
368	300438	鹏辉能源	2,300	110,492.00	0.04
369	001914	招商积余	7,300	109,865.00	0.04
370	601169	北京银行	23,700	109,731.00	0.04
371	002203	海亮股份	9,100	109,291.00	0.04
372	600967	内蒙一机	10,800	109,080.00	0.04
373	002250	联化科技	10,400	108,784.00	0.04
374	601838	成都银行	8,900	108,669.00	0.04
375	601028	玉龙股份	10,100	108,575.00	0.04
376	002745	木林森	11,800	108,560.00	0.04
377	000878	云南铜业	9,800	108,290.00	0.04
378	002727	一心堂	4,100	108,240.00	0.04
379	600742	一汽富维	13,200	108,108.00	0.04
380	002646	天佑德酒	8,000	107,920.00	0.04
381	600968	海油发展	35,100	107,757.00	0.04
382	600710	苏美达	12,500	107,000.00	0.04
383	300101	振芯科技	5,500	106,645.00	0.04
384	600500	中化国际	19,100	106,196.00	0.04
385	300662	科锐国际	3,000	106,110.00	0.04
386	601699	潞安环能	6,500	106,080.00	0.04
387	605199	葫芦娃	7,000	105,980.00	0.04
388	600673	东阳光	14,600	105,266.00	0.04
389	002304	洋河股份	800	105,080.00	0.04
390	002600	领益智造	15,200	105,032.00	0.04
391	688568	中科星图	1,300	104,754.00	0.04
392	000708	中信特钢	6,600	104,544.00	0.04
393	300068	南都电源	5,400	104,544.00	0.04
394	603218	日月股份	5,500	104,445.00	0.04
395	600284	浦东建设	17,000	104,040.00	0.04
396	002768	国恩股份	4,300	104,017.00	0.04
397	600906	财达证券	14,400	103,680.00	0.04
398	002611	东方精工	18,000	103,320.00	0.04
399	002435	长江健康	21,200	103,244.00	0.04
400	002648	卫星化学	6,900	103,224.00	0.04
401	601939	建设银行	16,400	102,664.00	0.04
402	000557	西部创业	19,400	102,238.00	0.04
403	600377	宁沪高速	10,400	102,232.00	0.04
404	600821	金开新能	14,800	101,972.00	0.04
405	688390	固德威	600	100,116.00	0.04
406	002155	湖南黄金	8,200	100,040.00	0.04
407	603707	健友股份	7,400	99,900.00	0.04

408	000885	城发环境	7,500	99,825.00	0.04
409	600776	东方通信	7,000	99,750.00	0.04
410	300653	正海生物	2,900	99,731.00	0.04
411	600761	安徽合力	5,000	99,650.00	0.04
412	600557	康缘药业	3,600	98,856.00	0.04
413	603609	禾丰股份	10,800	98,280.00	0.04
414	600783	鲁信创投	7,600	98,268.00	0.04
415	603601	再升科技	23,000	98,210.00	0.04
416	603236	移远通信	1,700	98,107.00	0.04
417	002034	旺能环境	6,200	98,022.00	0.04
418	600064	南京高科	14,800	97,828.00	0.04
419	600267	海正药业	8,500	96,730.00	0.04
420	300080	易成新能	19,000	96,710.00	0.04
421	603387	基蛋生物	7,500	96,675.00	0.04
422	300146	汤臣倍健	4,000	95,920.00	0.04
423	603338	浙江鼎力	1,700	95,217.00	0.03
424	600642	申能股份	13,600	95,064.00	0.03
425	000581	威孚高科	6,000	94,500.00	0.03
426	601872	招商轮船	16,300	94,377.00	0.03
427	000028	国药一致	2,160	94,197.60	0.03
428	002918	蒙娜丽莎	6,100	94,184.00	0.03
429	300257	开山股份	6,200	94,054.00	0.03
430	600884	杉杉股份	6,200	93,868.00	0.03
431	300185	通裕重工	33,600	93,744.00	0.03
432	600510	黑牡丹	15,400	93,478.00	0.03
433	600941	中国移动	1,000	93,300.00	0.03
434	600660	福耀玻璃	2,600	93,210.00	0.03
435	000559	万向钱潮	17,100	93,195.00	0.03
436	600435	北方导航	8,100	93,069.00	0.03
437	600535	天士力	6,400	92,864.00	0.03
438	002837	英维克	3,100	92,814.00	0.03
439	600169	太原重工	37,300	92,504.00	0.03
440	300166	东方国信	8,200	92,168.00	0.03
441	600580	卧龙电驱	6,300	92,043.00	0.03
442	600993	马应龙	3,300	91,773.00	0.03
443	601777	力帆科技	25,700	91,749.00	0.03
444	600403	大有能源	22,300	91,653.00	0.03
445	600233	圆通速递	6,200	90,272.00	0.03
446	600770	综艺股份	16,000	90,080.00	0.03
447	688088	虹软科技	2,100	89,775.00	0.03
448	300502	新易盛	1,320	89,720.40	0.03
449	688002	睿创微纳	2,000	89,600.00	0.03
450	603678	火炬电子	2,600	89,596.00	0.03



451	000800	一汽解放	10,700	89,559.00	0.03
452	300896	爱美客	200	88,990.00	0.03
453	300973	立高食品	1,300	88,946.00	0.03
454	600977	中国电影	6,300	88,515.00	0.03
455	300747	锐科激光	2,900	88,392.00	0.03
456	600390	五矿资本	16,300	87,694.00	0.03
457	002468	申通快递	8,100	87,642.00	0.03
458	002653	海思科	3,700	87,320.00	0.03
459	603866	桃李面包	8,620	87,234.40	0.03
460	002100	天康生物	10,500	86,625.00	0.03
461	300031	宝通科技	3,500	86,520.00	0.03
462	300735	光弘科技	8,000	85,600.00	0.03
463	601728	中国电信	15,200	85,576.00	0.03
464	603786	科博达	1,300	85,410.00	0.03
465	601231	环旭电子	5,700	85,272.00	0.03
466	600938	中国海油	4,700	85,164.00	0.03
467	601908	京运通	14,000	84,700.00	0.03
468	002475	立讯精密	2,600	84,370.00	0.03
469	688033	天宜上佳	4,400	84,128.00	0.03
470	002028	思源电气	1,800	84,096.00	0.03
471	300857	协创数据	3,200	84,096.00	0.03
472	002518	科士达	2,100	84,021.00	0.03
473	600273	嘉化能源	8,900	83,838.00	0.03
474	600750	江中药业	3,800	83,334.00	0.03
475	600129	太极集团	1,400	83,286.00	0.03
476	600908	无锡银行	15,300	82,008.00	0.03
477	600606	绿地控股	29,800	81,950.00	0.03
478	300558	贝达药业	1,700	81,651.00	0.03
479	300369	绿盟科技	6,600	81,642.00	0.03
480	600419	天润乳业	5,000	81,100.00	0.03
481	600963	岳阳林纸	11,000	81,070.00	0.03
482	688819	天能股份	2,200	81,048.00	0.03
483	002262	恩华药业	2,600	80,158.00	0.03
484	002583	海能达	13,700	79,597.00	0.03
485	300457	赢合科技	4,500	79,470.00	0.03
486	000680	山推股份	14,100	79,383.00	0.03
487	603128	华贸物流	8,700	79,257.00	0.03
488	688739	成大生物	2,400	79,104.00	0.03
489	300226	上海钢联	2,440	79,056.00	0.03
490	603566	普莱柯	3,400	79,050.00	0.03
491	603589	口子窖	1,600	78,960.00	0.03
492	600827	百联股份	5,900	78,883.00	0.03
493	600380	健康元	6,200	78,802.00	0.03

494	300601	康泰生物	3,100	78,709.00	0.03
495	300724	捷佳伟创	700	78,645.00	0.03
496	600288	大恒科技	6,500	78,455.00	0.03
497	002773	康弘药业	4,100	78,392.00	0.03
498	000035	中国天楹	17,100	78,318.00	0.03
499	002061	浙江交科	17,520	78,139.20	0.03
500	000963	华东医药	1,800	78,066.00	0.03
501	300487	蓝晓科技	1,250	78,025.00	0.03
502	601615	明阳智能	4,600	77,648.00	0.03
503	300389	艾比森	3,800	77,406.00	0.03
504	300782	卓胜微	800	77,304.00	0.03
505	603323	苏农银行	18,300	77,043.00	0.03
506	600916	中国黄金	6,500	76,765.00	0.03
507	300996	普联软件	2,500	76,750.00	0.03
508	688150	莱特光电	3,400	76,160.00	0.03
509	002344	海宁皮城	16,100	76,153.00	0.03
510	000090	天健集团	14,900	75,096.00	0.03
511	601099	太平洋	29,100	75,078.00	0.03
512	002214	大立科技	5,500	75,075.00	0.03
513	002032	苏泊尔	1,500	75,000.00	0.03
514	000423	东阿阿胶	1,400	74,830.00	0.03
515	300872	天阳科技	4,800	74,592.00	0.03
516	601298	青岛港	10,700	74,579.00	0.03
517	603737	三棵树	1,140	74,578.80	0.03
518	300598	诚迈科技	1,600	73,872.00	0.03
519	603633	徕木股份	5,600	73,192.00	0.03
520	601865	福莱特	1,900	73,169.00	0.03
521	600773	西藏城投	5,800	73,080.00	0.03
522	600017	日照港	24,400	72,956.00	0.03
523	000927	中国铁物	26,200	72,836.00	0.03
524	600578	京能电力	18,500	72,335.00	0.03
525	000753	漳州发展	14,900	72,265.00	0.03
526	603169	兰石重装	9,700	72,168.00	0.03
527	002003	伟星股份	7,700	72,072.00	0.03
528	300663	科蓝软件	5,300	72,027.00	0.03
529	000685	中山公用	9,500	71,915.00	0.03
530	601238	广汽集团	6,900	71,898.00	0.03
531	601077	渝农商行	20,000	71,800.00	0.03
532	603118	共进股份	5,400	71,766.00	0.03
533	600581	八一钢铁	17,700	71,685.00	0.03
534	603596	伯特利	900	71,334.00	0.03
535	603033	三维股份	3,500	71,225.00	0.03
536	301238	瑞泰新材	3,500	71,190.00	0.03

537	603456	九洲药业	2,600	71,188.00	0.03
538	603983	丸美股份	2,200	71,170.00	0.03
539	000600	建投能源	9,200	71,116.00	0.03
540	603208	江山欧派	1,950	71,019.00	0.03
541	603063	禾望电气	2,300	70,725.00	0.03
542	600309	万华化学	800	70,272.00	0.03
543	601233	桐昆股份	5,300	70,225.00	0.03
544	002839	张家港行	16,600	70,218.00	0.03
545	300003	乐普医疗	3,100	70,091.00	0.03
546	600468	百利电气	13,400	70,082.00	0.03
547	605020	永和股份	2,700	69,687.00	0.03
548	605577	龙版传媒	6,100	69,479.00	0.03
549	002851	麦格米特	1,900	69,293.00	0.03
550	002568	百润股份	1,900	69,065.00	0.03
551	601399	国机重装	21,700	69,006.00	0.03
552	600643	爱建集团	13,800	69,000.00	0.03
553	600970	中材国际	5,400	68,850.00	0.03
554	603501	韦尔股份	700	68,628.00	0.03
555	000718	苏宁环球	25,100	68,523.00	0.03
556	600741	华域汽车	3,700	68,302.00	0.03
557	002664	信质集团	4,800	67,584.00	0.02
558	600498	烽火通信	3,300	67,221.00	0.02
559	601921	浙版传媒	7,700	66,913.00	0.02
560	603309	维力医疗	4,300	66,521.00	0.02
561	600059	古越龙山	6,400	66,432.00	0.02
562	002545	东方铁塔	9,400	66,364.00	0.02
563	301095	广立微	800	66,120.00	0.02
564	600023	浙能电力	13,000	65,910.00	0.02
565	002131	利欧股份	28,600	65,780.00	0.02
566	603919	金徽酒	2,800	65,744.00	0.02
567	000727	冠捷科技	30,900	65,508.00	0.02
568	002516	旷达科技	13,500	65,340.00	0.02
569	300751	迈为股份	380	64,364.40	0.02
570	600755	厦门国贸	8,300	64,242.00	0.02
571	603595	东尼电子	1,500	64,230.00	0.02
572	002465	海格通信	6,200	64,108.00	0.02
573	002867	周大生	3,600	64,008.00	0.02
574	603297	永新光学	800	63,920.00	0.02
575	300687	赛意信息	2,300	63,894.00	0.02
576	002677	浙江美大	6,000	63,540.00	0.02
577	688127	蓝特光学	3,600	63,468.00	0.02
578	601236	红塔证券	8,500	63,325.00	0.02
579	600997	开滦股份	10,600	63,282.00	0.02

580	600789	鲁抗医药	9,800	62,916.00	0.02
581	603429	集友股份	7,100	62,906.00	0.02
582	600131	国网信通	3,100	62,589.00	0.02
583	600810	神马股份	8,800	62,568.00	0.02
584	600872	中炬高新	1,700	62,543.00	0.02
585	601611	中国核建	7,400	62,530.00	0.02
586	688499	利元亨	980	62,249.60	0.02
587	300957	贝泰妮	700	62,216.00	0.02
588	601128	常熟银行	9,100	62,062.00	0.02
589	300869	康泰医学	2,700	61,992.00	0.02
590	600956	新天绿能	7,100	61,912.00	0.02
591	601991	大唐发电	18,700	61,897.00	0.02
592	600517	国网英大	10,800	61,560.00	0.02
593	002019	亿帆医药	4,200	61,320.00	0.02
594	600566	济川药业	2,100	60,984.00	0.02
595	600869	远东股份	10,900	60,168.00	0.02
596	000761	本钢板材	15,000	60,000.00	0.02
597	000998	隆平高科	3,900	59,865.00	0.02
598	000729	燕京啤酒	4,800	59,856.00	0.02
599	600867	通化东宝	5,700	59,508.00	0.02
600	002053	云南能投	5,300	59,466.00	0.02
601	000627	天茂集团	19,800	59,400.00	0.02
602	300054	鼎龙股份	2,400	59,352.00	0.02
603	000058	深赛格	9,600	59,328.00	0.02
604	002249	大洋电机	10,400	59,280.00	0.02
605	600841	动力新科	9,700	59,170.00	0.02
606	300308	中际旭创	400	58,980.00	0.02
607	600864	哈投股份	11,500	58,765.00	0.02
608	300251	光线传媒	7,200	58,248.00	0.02
609	002092	中泰化学	9,000	58,050.00	0.02
610	301202	朗威股份	2,246	57,991.72	0.02
611	688508	芯朋微	1,000	57,990.00	0.02
612	000887	中鼎股份	4,400	57,596.00	0.02
613	603896	寿仙谷	1,300	57,590.00	0.02
614	688208	道通科技	1,900	57,589.00	0.02
615	000967	盈峰环境	11,400	57,570.00	0.02
616	300122	智飞生物	1,300	57,460.00	0.02
617	002299	圣农发展	3,000	57,450.00	0.02
618	300861	美畅股份	1,320	57,248.40	0.02
619	300567	精测电子	600	57,090.00	0.02
620	002421	达实智能	16,200	57,024.00	0.02
621	601228	广州港	17,600	56,848.00	0.02
622	600649	城投控股	14,400	56,592.00	0.02

623	300183	东软载波	3,400	56,134.00	0.02
624	600523	贵航股份	3,900	56,004.00	0.02
625	600598	北大荒	4,200	55,986.00	0.02
626	000517	荣安地产	18,300	55,815.00	0.02
627	300741	华宝股份	2,600	55,692.00	0.02
628	600172	黄河旋风	13,000	55,640.00	0.02
629	300693	盛弘股份	1,500	55,380.00	0.02
630	000869	张裕A	1,800	55,188.00	0.02
631	600549	厦门钨业	2,900	55,187.00	0.02
632	601577	长沙银行	7,100	55,096.00	0.02
633	601000	唐山港	15,600	55,068.00	0.02
634	002467	二六三	11,000	54,670.00	0.02
635	605333	沪光股份	3,300	54,582.00	0.02
636	600481	双良节能	3,900	54,522.00	0.02
637	000786	北新建材	2,200	53,922.00	0.02
638	600195	中牧股份	4,600	53,728.00	0.02
639	300379	东方通	2,600	53,482.00	0.02
640	600211	西藏药业	900	53,460.00	0.02
641	603713	密尔克卫	600	53,454.00	0.02
642	601126	四方股份	3,500	53,165.00	0.02
643	600803	新奥股份	2,800	53,144.00	0.02
644	002142	宁波银行	2,100	53,130.00	0.02
645	600285	羚锐制药	3,300	52,998.00	0.02
646	002916	深南电路	700	52,759.00	0.02
647	002463	沪电股份	2,500	52,350.00	0.02
648	600201	生物股份	5,500	52,305.00	0.02
649	600055	万东医疗	2,500	52,075.00	0.02
650	600271	航天信息	3,800	52,022.00	0.02
651	002097	山河智能	7,800	51,870.00	0.02
652	603013	亚普股份	3,300	51,744.00	0.02
653	300765	新诺威	4,000	51,560.00	0.02
654	002608	江苏国信	6,800	51,476.00	0.02
655	000739	普洛药业	2,900	51,446.00	0.02
656	603466	风语筑	3,700	51,430.00	0.02
657	600928	西安银行	14,600	51,392.00	0.02
658	600079	人福医药	1,900	51,186.00	0.02
659	002334	英威腾	4,000	50,960.00	0.02
660	600406	国电南瑞	2,200	50,820.00	0.02
661	601766	中国中车	7,800	50,700.00	0.02
662	002272	川润股份	6,900	50,646.00	0.02
663	688408	中信博	600	50,598.00	0.02
664	600637	东方明珠	6,400	50,048.00	0.02
665	603719	良品铺子	2,000	50,020.00	0.02

666	300447	全信股份	2,600	49,894.00	0.02
667	600859	王府井	2,500	49,475.00	0.02
668	688686	奥普特	300	49,344.00	0.02
669	000157	中联重科	7,300	49,275.00	0.02
670	601311	骆驼股份	5,300	49,184.00	0.02
671	002739	万达电影	3,900	48,906.00	0.02
672	601665	齐鲁银行	12,300	48,216.00	0.02
673	600837	海通证券	5,200	47,944.00	0.02
674	600006	东风汽车	8,100	47,871.00	0.02
675	000938	紫光股份	1,500	47,775.00	0.02
676	603055	台华新材	4,300	47,773.00	0.02
677	002230	科大讯飞	700	47,572.00	0.02
678	002612	朗姿股份	2,000	47,560.00	0.02
679	600362	江西铜业	2,500	47,450.00	0.02
680	002517	恺英网络	3,000	47,220.00	0.02
681	002683	广东宏大	1,600	47,104.00	0.02
682	002643	万润股份	2,700	47,007.00	0.02
683	002294	信立泰	1,500	46,785.00	0.02
684	603989	艾华集团	2,200	46,332.00	0.02
685	600197	伊力特	1,700	46,189.00	0.02
686	600845	宝信软件	900	45,729.00	0.02
687	603636	南威软件	3,100	45,477.00	0.02
688	688699	明微电子	900	45,288.00	0.02
689	600497	驰宏锌锗	9,000	45,180.00	0.02
690	603298	杭叉集团	1,900	44,745.00	0.02
691	603379	三美股份	1,900	44,669.00	0.02
692	600820	隧道股份	7,400	44,474.00	0.02
693	301087	可孚医疗	900	44,370.00	0.02
694	600550	保变电气	8,800	44,352.00	0.02
695	688082	盛美上海	400	44,160.00	0.02
696	601162	天风证券	14,800	44,104.00	0.02
697	603179	新泉股份	1,000	43,890.00	0.02
698	300285	国瓷材料	1,600	43,840.00	0.02
699	688425	铁建重工	9,100	43,771.00	0.02
700	300357	我武生物	1,300	43,719.00	0.02
701	002271	东方雨虹	1,600	43,616.00	0.02
702	603530	神马电力	2,800	43,540.00	0.02
703	605123	派克新材	400	43,460.00	0.02
704	600909	华安证券	9,300	43,431.00	0.02
705	601965	中国汽研	2,100	43,365.00	0.02
706	001965	招商公路	4,500	43,200.00	0.02
707	688578	艾力斯	1,600	43,120.00	0.02
708	600276	恒瑞医药	900	43,110.00	0.02

709	002493	荣盛石化	3,700	43,068.00	0.02
710	300009	安科生物	4,300	43,000.00	0.02
711	600426	华鲁恒升	1,400	42,882.00	0.02
712	600025	华能水电	6,000	42,780.00	0.02
713	601106	中国一重	12,700	42,672.00	0.02
714	688006	杭可科技	1,400	42,658.00	0.02
715	601619	嘉泽新能	9,300	42,315.00	0.02
716	300109	新开源	1,700	42,279.00	0.02
717	600335	国机汽车	3,700	42,180.00	0.02
718	002595	豪迈科技	1,200	42,156.00	0.02
719	688366	昊海生科	500	42,110.00	0.02
720	000901	航天科技	3,900	41,730.00	0.02
721	603212	赛伍技术	2,000	41,620.00	0.02
722	600031	三一重工	2,500	41,575.00	0.02
723	002023	海特高新	4,500	41,400.00	0.02
724	603392	万泰生物	620	41,397.40	0.02
725	002807	江阴银行	11,200	41,328.00	0.02
726	603858	步长制药	2,000	41,180.00	0.02
727	600586	金晶科技	5,300	40,916.00	0.02
728	600808	马钢股份	15,900	40,863.00	0.01
729	600363	联创光电	1,100	40,810.00	0.01
730	002500	山西证券	7,300	40,734.00	0.01
731	002840	华统股份	2,600	40,664.00	0.01
732	600299	安迪苏	5,100	40,647.00	0.01
733	601179	中国西电	7,500	40,575.00	0.01
734	688281	华秦科技	200	40,500.00	0.01
735	601997	贵阳银行	7,800	40,248.00	0.01
736	688008	澜起科技	700	40,194.00	0.01
737	600163	中闽能源	7,200	40,176.00	0.01
738	688278	特宝生物	900	39,519.00	0.01
739	601992	金隅集团	18,000	39,240.00	0.01
740	600026	中远海能	3,100	39,184.00	0.01
741	688518	联赢激光	1,400	39,004.00	0.01
742	000543	皖能电力	5,900	38,940.00	0.01
743	603533	掌阅科技	1,400	38,808.00	0.01
744	000975	银泰黄金	3,300	38,610.00	0.01
745	605009	豪悦护理	800	38,400.00	0.01
746	600183	生益科技	2,700	38,340.00	0.01
747	603816	顾家家居	1,000	38,150.00	0.01
748	000829	天音控股	4,200	37,968.00	0.01
749	688276	百克生物	600	37,560.00	0.01
750	000966	长源电力	6,700	37,386.00	0.01
751	600702	舍得酒业	300	37,185.00	0.01

752	688315	诺禾致源	1,400	37,170.00	0.01
753	600015	华夏银行	6,800	36,788.00	0.01
754	600508	上海能源	2,500	36,700.00	0.01
755	000792	盐湖股份	1,900	36,423.00	0.01
756	300002	神州泰岳	2,600	36,400.00	0.01
757	688337	普源精电	600	36,156.00	0.01
758	601881	中国银河	3,100	35,991.00	0.01
759	601860	紫金银行	14,300	35,893.00	0.01
760	603995	甬金股份	1,500	35,865.00	0.01
761	002197	证通电子	3,400	35,836.00	0.01
762	603718	海利生物	3,800	35,834.00	0.01
763	603229	奥翔药业	1,700	35,666.00	0.01
764	688126	沪硅产业	1,700	35,530.00	0.01
765	002266	浙富控股	8,600	35,518.00	0.01
766	300832	新产业	600	35,400.00	0.01
767	600529	山东药玻	1,300	35,386.00	0.01
768	002985	北摩高科	800	35,296.00	0.01
769	002423	中粮资本	4,400	35,200.00	0.01
770	000513	丽珠集团	900	35,019.00	0.01
771	002004	华邦健康	7,000	35,000.00	0.01
772	600511	国药股份	900	34,965.00	0.01
773	600037	歌华有线	4,200	34,902.00	0.01
774	300079	数码视讯	5,700	34,770.00	0.01
775	002405	四维图新	3,000	34,740.00	0.01
776	300337	银邦股份	5,200	34,684.00	0.01
777	600577	精达股份	8,200	34,604.00	0.01
778	002511	中顺洁柔	3,100	34,565.00	0.01
779	000301	东方盛虹	2,900	34,278.00	0.01
780	002901	大博医疗	1,100	34,188.00	0.01
781	603317	天味食品	2,340	34,187.40	0.01
782	002110	三钢闽光	8,100	34,182.00	0.01
783	002926	华西证券	4,100	34,071.00	0.01
784	300699	光威复材	1,100	33,935.00	0.01
785	600350	山东高速	5,300	33,761.00	0.01
786	600366	宁波韵升	3,800	33,706.00	0.01
787	300888	稳健医疗	800	33,336.00	0.01
788	000989	九芝堂	2,400	33,216.00	0.01
789	600732	爱旭股份	1,080	33,210.00	0.01
790	601212	白银有色	12,200	33,184.00	0.01
791	600961	株冶集团	4,100	33,169.00	0.01
792	603916	苏博特	2,500	33,100.00	0.01
793	600900	长江电力	1,500	33,090.00	0.01
794	600655	豫园股份	4,800	32,928.00	0.01



795	603396	金辰股份	500	32,800.00	0.01
796	002234	民和股份	1,800	32,778.00	0.01
797	300682	朗新科技	1,400	32,592.00	0.01
798	603129	春风动力	200	32,380.00	0.01
799	603160	汇顶科技	700	32,375.00	0.01
800	002540	亚太科技	5,600	32,368.00	0.01
801	000563	陕国投A	10,600	32,330.00	0.01
802	002558	巨人网络	1,800	32,274.00	0.01
803	600874	创业环保	5,500	32,230.00	0.01
804	600459	贵研铂业	2,100	32,130.00	0.01
805	000567	海德股份	2,500	32,050.00	0.01
806	300685	艾德生物	1,300	31,538.00	0.01
807	603985	恒润股份	1,500	31,455.00	0.01
808	600252	中恒集团	12,700	31,369.00	0.01
809	603279	景津装备	1,000	31,360.00	0.01
810	300358	楚天科技	2,100	31,353.00	0.01
811	000783	长江证券	5,400	31,320.00	0.01
812	002078	太阳纸业	2,900	31,001.00	0.01
813	300894	火星人	1,200	30,648.00	0.01
814	600862	中航高科	1,200	30,372.00	0.01
815	601003	柳钢股份	7,500	30,300.00	0.01
816	002126	银轮股份	1,700	30,090.00	0.01
817	002206	海利得	5,600	30,016.00	0.01
818	600143	金发科技	3,400	29,682.00	0.01
819	601288	农业银行	8,400	29,652.00	0.01
820	300395	菲利华	600	29,520.00	0.01
821	600386	北巴传媒	7,200	29,448.00	0.01
822	688036	传音控股	200	29,400.00	0.01
823	688295	中复神鹰	800	29,344.00	0.01
824	601918	新集能源	6,900	29,325.00	0.01
825	002425	凯撒文化	5,200	29,276.00	0.01
826	000636	风华高科	1,900	29,146.00	0.01
827	000785	居然之家	7,600	28,956.00	0.01
828	600170	上海建工	10,700	28,783.00	0.01
829	600740	山西焦化	5,600	28,728.00	0.01
830	603639	海利尔	1,600	28,672.00	0.01
831	600623	华谊集团	4,600	28,658.00	0.01
832	600126	杭钢股份	6,600	28,644.00	0.01
833	002414	高德红外	3,650	28,360.50	0.01
834	600496	精工钢构	7,600	28,348.00	0.01
835	002311	海大集团	600	28,104.00	0.01
836	600688	上海石化	9,000	27,990.00	0.01
837	002466	天齐锂业	400	27,964.00	0.01

838	000598	兴蓉环境	5,100	27,693.00	0.01
839	601969	海南矿业	4,200	27,636.00	0.01
840	601186	中国铁建	2,800	27,580.00	0.01
841	601187	厦门银行	5,400	27,108.00	0.01
842	600369	西南证券	7,400	27,010.00	0.01
843	002149	西部材料	1,600	26,864.00	0.01
844	600155	华创云信	4,300	26,746.00	0.01
845	002372	伟星新材	1,300	26,702.00	0.01
846	002669	康达新材	2,000	26,700.00	0.01
847	600378	昊华科技	700	26,348.00	0.01
848	002138	顺络电子	1,100	26,301.00	0.01
849	688348	昱能科技	140	26,296.20	0.01
850	600062	华润双鹤	1,500	26,130.00	0.01
851	300790	宇瞳光学	1,700	25,908.00	0.01
852	002594	比亚迪	100	25,827.00	0.01
853	300498	温氏股份	1,400	25,690.00	0.01
854	600120	浙江东方	6,700	25,661.00	0.01
855	002472	双环传动	700	25,410.00	0.01
856	603355	莱克电气	1,000	25,410.00	0.01
857	600675	中华企业	8,600	25,370.00	0.01
858	002390	信邦制药	5,700	25,251.00	0.01
859	603799	华友钴业	550	25,250.50	0.01
860	605338	巴比食品	1,000	25,250.00	0.01
861	300368	汇金股份	3,800	25,232.00	0.01
862	600831	广电网络	4,200	25,200.00	0.01
863	300884	狄耐克	1,900	25,156.00	0.01
864	300320	海达股份	3,200	25,056.00	0.01
865	002120	韵达股份	2,600	24,856.00	0.01
866	002096	易普力	2,100	24,843.00	0.01
867	002007	华兰生物	1,100	24,651.00	0.01
868	000823	超声电子	2,600	24,648.00	0.01
869	601686	友发集团	3,600	24,624.00	0.01
870	600927	永安期货	1,500	24,390.00	0.01
871	002460	赣锋锂业	400	24,384.00	0.01
872	600658	电子城	4,400	24,332.00	0.01
873	600282	南钢股份	7,200	24,264.00	0.01
874	300525	博思软件	1,580	24,237.20	0.01
875	300059	东方财富	1,700	24,140.00	0.01
876	003000	劲仔食品	1,900	23,921.00	0.01
877	603663	三祥新材	1,600	23,920.00	0.01
878	601163	三角轮胎	1,500	23,805.00	0.01
879	600383	金地集团	3,300	23,793.00	0.01
880	002548	金新农	3,100	23,746.00	0.01

881	300342	天银机电	2,200	23,694.00	0.01
882	000983	山西焦煤	2,600	23,660.00	0.01
883	002917	金奥博	1,900	23,484.00	0.01
884	603058	永吉股份	2,400	23,400.00	0.01
885	002079	苏州固锟	1,600	23,360.00	0.01
886	002170	芭田股份	3,400	23,358.00	0.01
887	601158	重庆水务	4,200	23,352.00	0.01
888	300274	阳光电源	200	23,326.00	0.01
889	000060	中金岭南	4,900	23,275.00	0.01
890	300978	东箭科技	1,700	23,171.00	0.01
891	002449	国星光电	2,600	23,114.00	0.01
892	002601	龙佰集团	1,400	23,100.00	0.01
893	300129	泰胜风能	2,400	23,016.00	0.01
894	603421	鼎信通讯	2,200	22,990.00	0.01
895	000521	长虹美菱	3,000	22,920.00	0.01
896	000031	大悦城	6,200	22,692.00	0.01
897	002108	沧州明珠	5,000	22,650.00	0.01
898	600075	新疆天业	4,800	22,608.00	0.01
899	605599	菜百股份	1,700	22,457.00	0.01
900	002498	汉缆股份	5,600	22,456.00	0.01
901	688079	美迪凯	2,000	22,380.00	0.01
902	600108	亚盛集团	7,400	22,348.00	0.01
903	603283	赛腾股份	500	22,250.00	0.01
904	300448	浩云科技	3,700	22,126.00	0.01
905	601888	中国中免	200	22,106.00	0.01
906	600114	东睦股份	2,895	22,059.90	0.01
907	000045	深纺织A	2,000	22,000.00	0.01
908	000553	安道麦A	2,600	21,944.00	0.01
909	600571	信雅达	2,400	21,936.00	0.01
910	601011	宝泰隆	6,100	21,899.00	0.01
911	603508	思维列控	1,280	21,824.00	0.01
912	600731	湖南海利	2,800	21,756.00	0.01
913	688361	中科飞测	336	21,729.12	0.01
914	688596	正帆科技	500	21,650.00	0.01
915	600196	复星医药	700	21,630.00	0.01
916	002673	西部证券	3,400	21,590.00	0.01
917	600111	北方稀土	900	21,582.00	0.01
918	603191	望变电气	1,100	21,395.00	0.01
919	600475	华光环能	1,800	21,384.00	0.01
920	002625	光启技术	1,400	21,364.00	0.01
921	002345	潮宏基	2,700	21,222.00	0.01
922	002050	三花智控	700	21,182.00	0.01
923	300691	联合光电	1,200	21,144.00	0.01

924	600893	航发动力	500	21,130.00	0.01
925	000036	华联控股	5,100	21,012.00	0.01
926	603699	纽威股份	1,400	20,832.00	0.01
927	603676	卫信康	1,500	20,730.00	0.01
928	600664	哈药股份	6,300	20,727.00	0.01
929	601827	三峰环境	2,800	20,720.00	0.01
930	603206	嘉环科技	1,200	20,700.00	0.01
931	300481	濮阳惠成	1,000	20,560.00	0.01
932	000906	浙商中拓	2,300	20,516.00	0.01
933	600503	华丽家族	7,200	20,376.00	0.01
934	603515	欧普照明	1,000	20,300.00	0.01
935	601138	工业富联	800	20,160.00	0.01
936	000534	万泽股份	1,200	20,124.00	0.01
937	688505	复旦张江	2,300	19,849.00	0.01
938	300219	鸿利智汇	2,700	19,845.00	0.01
939	688063	派能科技	100	19,825.00	0.01
940	601398	工商银行	4,100	19,762.00	0.01
941	002602	世纪华通	2,600	19,734.00	0.01
942	603399	吉翔股份	1,700	19,669.00	0.01
943	603267	鸿远电子	300	19,590.00	0.01
944	002033	丽江股份	1,800	19,584.00	0.01
945	002115	三维通信	3,000	19,560.00	0.01
946	300541	先进数通	1,500	19,545.00	0.01
947	300047	天源迪科	2,400	19,536.00	0.01
948	002791	坚朗五金	300	19,413.00	0.01
949	000404	长虹华意	2,800	19,376.00	0.01
950	002478	常宝股份	2,600	19,370.00	0.01
951	300213	佳讯飞鸿	2,900	19,343.00	0.01
952	002755	奥赛康	2,200	19,338.00	0.01
953	002660	茂硕电源	2,000	19,260.00	0.01
954	603195	公牛集团	200	19,212.00	0.01
955	600751	海航科技	8,100	19,197.00	0.01
956	603833	欧派家居	200	19,160.00	0.01
957	002599	盛通股份	2,100	19,005.00	0.01
958	600161	天坛生物	700	19,005.00	0.01
959	300286	安科瑞	500	18,930.00	0.01
960	601108	财通证券	2,600	18,824.00	0.01
961	601609	金田股份	2,900	18,821.00	0.01
962	301358	湖南裕能	438	18,785.82	0.01
963	002580	圣阳股份	2,000	18,780.00	0.01
964	000089	深圳机场	2,700	18,765.00	0.01
965	000768	中航西飞	700	18,725.00	0.01
966	002322	理工能科	1,800	18,720.00	0.01

967	002922	伊戈尔	1,300	18,655.00	0.01
968	002436	兴森科技	1,200	18,600.00	0.01
969	002248	华东数控	1,900	18,525.00	0.01
970	600331	宏达股份	3,900	18,486.00	0.01
971	600104	上汽集团	1,300	18,421.00	0.01
972	600576	祥源文旅	2,300	18,331.00	0.01
973	688403	汇成股份	1,500	18,330.00	0.01
974	300291	百纳千成	2,600	18,304.00	0.01
975	000607	华媒控股	3,600	18,144.00	0.01
976	300136	信维通信	900	18,072.00	0.01
977	300830	金现代	1,900	18,050.00	0.01
978	002919	名臣健康	400	18,040.00	0.01
979	300429	强力新材	1,800	18,036.00	0.01
980	002301	齐心集团	2,500	17,975.00	0.01
981	600691	阳煤化工	5,700	17,955.00	0.01
982	600846	同济科技	1,600	17,920.00	0.01
983	603660	苏州科达	2,600	17,862.00	0.01
984	603899	晨光股份	400	17,856.00	0.01
985	600030	中信证券	900	17,802.00	0.01
986	002793	罗欣药业	3,300	17,787.00	0.01
987	603330	天洋新材	1,600	17,776.00	0.01
988	300363	博腾股份	600	17,754.00	0.01
989	600425	青松建化	4,000	17,680.00	0.01
990	600699	均胜电子	1,000	17,640.00	0.01
991	603528	多伦科技	2,300	17,572.00	0.01
992	300033	同花顺	100	17,528.00	0.01
993	300452	山河药辅	1,000	17,440.00	0.01
994	300415	伊之密	900	17,280.00	0.01
995	002399	海普瑞	1,500	17,205.00	0.01
996	600376	首开股份	4,400	17,160.00	0.01
997	000962	东方钨业	1,400	17,150.00	0.01
998	300831	派瑞股份	1,300	17,147.00	0.01
999	603067	振华股份	1,400	17,010.00	0.01
1,000	603056	德邦股份	1,100	16,962.00	0.01
1,001	301293	三博脑科	236	16,855.12	0.01
1,002	600604	市北高新	3,600	16,848.00	0.01
1,003	688246	嘉和美康	400	16,748.00	0.01
1,004	300404	博济医药	1,600	16,720.00	0.01
1,005	603686	福龙马	1,600	16,688.00	0.01
1,006	600575	淮河能源	6,500	16,640.00	0.01
1,007	603227	雪峰科技	2,000	16,560.00	0.01
1,008	605337	李子园	900	16,452.00	0.01
1,009	603966	法兰泰克	1,300	16,419.00	0.01

1,010	300315	掌趣科技	2,100	16,380.00	0.01
1,011	002533	金杯电工	2,000	16,320.00	0.01
1,012	601360	三六零	1,300	16,302.00	0.01
1,013	605183	确成股份	900	16,290.00	0.01
1,014	300396	迪瑞医疗	500	16,245.00	0.01
1,015	002483	润邦股份	2,800	16,240.00	0.01
1,016	002560	通达股份	1,700	16,184.00	0.01
1,017	300231	银信科技	1,800	16,038.00	0.01
1,018	603901	永创智能	1,100	16,016.00	0.01
1,019	002364	中恒电气	1,900	15,941.00	0.01
1,020	300909	汇创达	600	15,852.00	0.01
1,021	002169	智光电气	1,900	15,751.00	0.01
1,022	688012	中微公司	100	15,645.00	0.01
1,023	000903	云内动力	6,600	15,576.00	0.01
1,024	300177	中海达	2,300	15,571.00	0.01
1,025	688469	中芯集成	2,876	15,559.16	0.01
1,026	300568	星源材质	900	15,471.00	0.01
1,027	688248	南网科技	400	15,356.00	0.01
1,028	600229	城市传媒	1,800	15,336.00	0.01
1,029	601007	金陵饭店	1,800	15,336.00	0.01
1,030	002454	松芝股份	1,800	15,246.00	0.01
1,031	002907	华森制药	1,000	15,220.00	0.01
1,032	002419	天虹股份	2,600	15,210.00	0.01
1,033	688981	中芯国际	300	15,156.00	0.01
1,034	300005	探路者	1,800	15,120.00	0.01
1,035	601666	平煤股份	2,000	15,080.00	0.01
1,036	301339	通行宝	600	15,078.00	0.01
1,037	300307	慈星股份	2,200	15,026.00	0.01
1,038	601512	中新集团	1,600	14,928.00	0.01
1,039	002438	江苏神通	1,300	14,924.00	0.01
1,040	002713	东易日盛	1,700	14,790.00	0.01
1,041	600461	洪城环境	1,800	14,706.00	0.01
1,042	600745	闻泰科技	300	14,670.00	0.01
1,043	600019	宝钢股份	2,600	14,612.00	0.01
1,044	000026	飞亚达	1,200	14,472.00	0.01
1,045	002042	华孚时尚	4,600	14,444.00	0.01
1,046	002270	华明装备	1,300	14,235.00	0.01
1,047	603126	中材节能	1,800	13,932.00	0.01
1,048	300529	健帆生物	600	13,908.00	0.01
1,049	000828	东莞控股	1,500	13,725.00	0.01
1,050	603993	洛阳钼业	2,538	13,527.54	0.00
1,051	601166	兴业银行	857	13,412.05	0.00
1,052	002841	视源股份	200	13,368.00	0.00

1,053	002915	中欣氟材	800	13,368.00	0.00
1,054	301017	漱玉平民	700	13,328.00	0.00
1,055	300997	欢乐家	900	13,113.00	0.00
1,056	000791	甘肃能源	2,500	13,075.00	0.00
1,057	002662	京威股份	3,900	12,987.00	0.00
1,058	601155	新城控股	900	12,969.00	0.00
1,059	603987	康德莱	1,000	12,920.00	0.00
1,060	600176	中国巨石	900	12,744.00	0.00
1,061	300306	远方信息	1,000	12,610.00	0.00
1,062	000888	峨眉山A	1,100	12,606.00	0.00
1,063	688065	凯赛生物	200	12,452.00	0.00
1,064	600219	南山铝业	4,100	12,382.00	0.00
1,065	000958	电投产融	2,800	12,124.00	0.00
1,066	300999	金龙鱼	300	11,997.00	0.00
1,067	600814	杭州解百	1,400	11,970.00	0.00
1,068	688336	三生国健	700	11,963.00	0.00
1,069	603777	来伊份	800	11,808.00	0.00
1,070	002010	传化智联	2,200	11,704.00	0.00
1,071	000876	新希望	1,000	11,680.00	0.00
1,072	600756	浪潮软件	700	11,634.00	0.00
1,073	600935	华塑股份	3,100	11,625.00	0.00
1,074	002293	罗莱生活	1,000	11,500.00	0.00
1,075	000987	越秀资本	1,800	11,430.00	0.00
1,076	603050	科林电气	700	11,277.00	0.00
1,077	688478	晶升股份	266	11,270.42	0.00
1,078	000623	吉林敖东	700	11,228.00	0.00
1,079	002644	佛慈制药	900	10,980.00	0.00
1,080	688484	南芯科技	298	10,939.58	0.00
1,081	002527	新时达	800	10,880.00	0.00
1,082	300450	先导智能	300	10,851.00	0.00
1,083	600370	三房巷	4,000	10,720.00	0.00
1,084	601919	中远海控	1,140	10,716.00	0.00
1,085	300394	天孚通信	100	10,683.00	0.00
1,086	688356	键凯科技	100	10,655.00	0.00
1,087	688562	航天软件	467	10,418.77	0.00
1,088	603667	五洲新春	700	10,416.00	0.00
1,089	600096	云天化	600	10,242.00	0.00
1,090	603019	中科曙光	200	10,180.00	0.00
1,091	600981	汇鸿集团	3,500	10,150.00	0.00
1,092	300258	精锻科技	700	10,143.00	0.00
1,093	603708	家家悦	800	10,032.00	0.00
1,094	600551	时代出版	900	9,945.00	0.00
1,095	600269	赣粤高速	2,700	9,909.00	0.00

1,096	603920	世运电路	500	9,765.00	0.00
1,097	688352	硕中科技	805	9,716.35	0.00
1,098	000977	浪潮信息	200	9,700.00	0.00
1,099	002812	恩捷股份	100	9,635.00	0.00
1,100	002202	金风科技	900	9,558.00	0.00
1,101	600132	重庆啤酒	100	9,216.00	0.00
1,102	601229	上海银行	1,600	9,200.00	0.00
1,103	000893	亚钾国际	400	9,176.00	0.00
1,104	600460	士兰微	300	9,081.00	0.00
1,105	301315	威士顿	177	9,048.24	0.00
1,106	688629	华丰科技	482	8,960.38	0.00
1,107	600737	中粮糖业	1,100	8,855.00	0.00
1,108	002237	恒邦股份	800	8,712.00	0.00
1,109	600000	浦发银行	1,200	8,688.00	0.00
1,110	688523	航天环宇	353	8,419.05	0.00
1,111	002709	天赐材料	200	8,238.00	0.00
1,112	000537	广宇发展	700	8,169.00	0.00
1,113	688185	康希诺	100	8,150.00	0.00
1,114	688433	华曙高科	257	8,095.50	0.00
1,115	000027	深圳能源	1,200	7,908.00	0.00
1,116	603486	科沃斯	100	7,777.00	0.00
1,117	301317	鑫磊股份	296	7,746.32	0.00
1,118	688234	天岳先进	100	7,394.00	0.00
1,119	688429	时创能源	289	7,378.17	0.00
1,120	600559	老白干酒	300	7,353.00	0.00
1,121	000895	双汇发展	300	7,347.00	0.00
1,122	603260	合盛硅业	100	7,002.00	0.00
1,123	688631	莱斯信息	232	6,929.84	0.00
1,124	000408	藏格矿业	300	6,771.00	0.00
1,125	600089	特变电工	300	6,687.00	0.00
1,126	000617	中油资本	900	6,507.00	0.00
1,127	002756	永兴材料	100	6,261.00	0.00
1,128	300919	中伟股份	100	6,025.00	0.00
1,129	002481	双塔食品	1,300	5,798.00	0.00
1,130	001287	中电港	274	5,759.48	0.00
1,131	688005	容百科技	100	5,402.00	0.00
1,132	688232	新点软件	100	5,381.00	0.00
1,133	600018	上港集团	1,000	5,250.00	0.00
1,134	603135	中重科技	292	5,223.88	0.00
1,135	301429	森泰股份	246	5,170.92	0.00
1,136	601916	浙商银行	1,940	5,121.60	0.00
1,137	601216	君正集团	1,200	4,920.00	0.00
1,138	300979	华利集团	100	4,874.00	0.00



1,139	601133	柏诚股份	339	4,156.14	0.00
1,140	688690	纳微科技	100	3,885.00	0.00
1,141	600973	宝胜股份	700	3,395.00	0.00
1,142	601012	隆基绿能	109	3,125.03	0.00
1,143	001328	登康口腔	111	2,829.39	0.00
1,144	600011	华能国际	300	2,778.00	0.00
1,145	001360	南矿集团	122	1,814.14	0.00
1,146	001367	海森药业	40	1,579.20	0.00
1,147	001324	长青科技	73	1,430.80	0.00
1,148	603137	恒尚节能	67	1,145.03	0.00
1,149	603172	万丰股份	60	967.80	0.00

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。

## 7.4 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	002929	润建股份	5,550,965.00	1.78
2	002179	中航光电	5,167,085.90	1.66
3	300783	三只松鼠	5,128,205.00	1.65
4	601319	中国人保	5,058,489.00	1.63
5	600546	山煤国际	4,824,406.00	1.55
6	300593	新雷能	4,394,644.28	1.41
7	002422	科伦药业	4,331,569.00	1.39
8	603688	石英股份	4,140,511.00	1.33
9	002737	葵花药业	3,728,237.00	1.20
10	600073	上海梅林	3,727,451.00	1.20
11	601328	交通银行	3,703,381.00	1.19
12	600398	海澜之家	3,689,104.00	1.19
13	603689	皖天然气	3,303,255.00	1.06
14	600690	海尔智家	3,268,945.00	1.05
15	002990	盛视科技	3,196,660.00	1.03
16	002038	双鹭药业	3,177,529.00	1.02
17	603877	太平鸟	3,016,588.00	0.97
18	601336	新华保险	2,888,725.00	0.93
19	603230	内蒙新华	2,870,905.00	0.92
20	000063	中兴通讯	2,866,162.00	0.92

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(%)
----	------	------	----------	----------------

	码			
1	601319	中国人保	4,834,467.00	1.55
2	002929	润建股份	4,549,165.00	1.46
3	300783	三只松鼠	4,524,204.00	1.45
4	601998	中信银行	4,257,849.00	1.37
5	603688	石英股份	4,173,525.00	1.34
6	300593	新雷能	3,703,312.60	1.19
7	600398	海澜之家	3,644,110.00	1.17
8	601088	中国神华	3,544,757.00	1.14
9	002422	科伦药业	3,517,354.00	1.13
10	002038	双鹭药业	3,502,016.00	1.13
11	002179	中航光电	3,377,751.70	1.09
12	601166	兴业银行	3,124,830.00	1.00
13	000063	中兴通讯	3,119,116.00	1.00
14	600073	上海梅林	3,087,409.00	0.99
15	603877	太平鸟	3,026,967.00	0.97
16	300130	新国都	2,995,893.62	0.96
17	601288	农业银行	2,768,304.00	0.89
18	600690	海尔智家	2,748,617.00	0.88
19	603689	皖天然气	2,717,695.20	0.87
20	002737	葵花药业	2,712,537.00	0.87

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	954,070,649.60
卖出股票收入（成交）总额	982,846,168.27

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	10,234,353.42	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
----	----	---------------	-------

## 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	200009	20 附息国债 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

## 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 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 10,915,966.55 元，公允价值变动损益为 1,558,296.79 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“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。

### 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	18,930,517.30
2	应收清算款	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	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,983,207.60

### 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	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

### 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 (%)
光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	15	153,725.97	-	-	2,305,889.56	100.00
光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	192	190,294.12	28,146,931.88	77.04	8,389,538.81	22.96
光大阳光对冲 6 个月持有混合 C	28,896	7,658.80	-	-	221,308,551.70	100.00
合计	29,103	8,938.97	28,146,931.88	10.82	232,003,980.07	89.18

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	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	46,501.00	2.0166
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	96,792.43	0.2649
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C	1,005.80	0.0005
	合计	144,299.23	0.0555

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	光大阳光对冲 6 个月持有混	0

金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	合 A	
	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	2,615,678.28	37,128,843.54	266,975,830.96
本报告期基金总申购份额	-	63,392.85	872,157.96
减：本报告期基金总赎回份额	309,788.72	655,765.70	46,539,437.22
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,305,889.56	36,536,470.69	221,308,551.70

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，本集合计划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，本集合计划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	2	1,936,916,817.87	100.00	641,294.77	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	487,800,246.34	100.00	466,900,000.00	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	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 4 季度报告	中国证监会规定的媒介	2023 年 01 月 20 日
2	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	中国证监会规定的媒介	2023 年 03 月 09 日
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基金经理变更公告	中国证监会规定的媒介	2023 年 03 月 16 日
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、产品资料概要（更新）	中国证监会规定的媒介	2023 年 03 月 21 日
5	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	中国证监会规定的媒介	2023 年 03 月 27 日
6	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 年年度报告	中国证监会规定的媒介	2023 年 03 月 31 日
7	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	中国证监会规定的媒介	2023 年 04 月 23 日
8	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	中国证监会规定的媒介	2023 年 06 月 19 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](http://www.ebscn-am.com)

上海光大证券资产管理有限公司

2023 年 8 月 31 日