

光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券型集 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：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

集合计划管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本报告已经三分之二以上董事签字同意，并由董事长签发。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44

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	45
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	45
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	45
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	45
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	45
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12	投资组合报告附注	45
§ 8	基金份额持有人信息	47
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	48
§ 9	开放式基金份额变动	48
§ 10	重大事件揭示	49
10.1	基金份额持有人大会决议	49
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	49
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4	基金投资策略的改变	49
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	49
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	49
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8	其他重大事件	50
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	50
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	50
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	51
§ 12	备查文件目录	51
12.1	备查文件目录	51
12.2	存放地点	51
12.3	查阅方式	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券型集合资产管理计划	
基金简称	光大阳光北斗星 180 天滚动	
基金主代码	860051	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 8 月 30 日	
基金管理人	上海光大证券资产管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	49,268,588.71 份	
基金合同存续期	3 年	
下属分级基金的基金简称	光大阳光北斗星 180 天滚动 A	光大阳光北斗星 180 天滚动 C
下属分级基金的交易代码	865040	860051
报告期末下属分级基金的份额总额	41,307,433.07 份	7,961,155.64 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	本集合计划主要投资于债券为主的固定收益类产品，并在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过对不同资产类别的优化配置，充分挖掘市场潜在的投资机会，力求实现集合计划资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本集合计划采用专业的投资理念和分析方法，以系统化的研究为基础，通过对各类固定收益类资产的合理配置获取稳定收益。同时结合新股申购、权益类资产投资等，在严格控制投资风险、保持资产流动性的前提下，争取获得相对较高的资产组合投资收益水平。</p> <p>2、固定收益类品种投资策略</p> <p>本集合计划将通过分析宏观经济形势、政策预期和资金供给，并结合债券久期策略和收益率曲线结构的变化趋势来构建债券投资组合，把握利率债行情。在此基础上，积极采用信用策略，发掘市场上价值被低估的高收益信用债，获取较好的信用收益，力争达到产品债券组合安全性与收益性的统一。</p> <p>3、权益类品种的投资策略</p> <p>(1) 新股申购策略</p> <p>本集合计划通过对新股的分析，参考同类公司的估值水平，判断一、二级市场价差的大小，并根据过往新股的中签率及上市后股价涨幅的统计，对新股投资的收益率进行预测，同时综合考虑锁定期间的投资风险以及资金成本，制定新股申购策略。</p>

	<p>(2) 股票二级市场的投资策略</p> <p>本集合计划采取自上而下的行业配置与自下而上的个股选择相结合的股票二级市场投资策略。在行业配置方面，除通过对包括产业政策、行业成长性、市场竞争、行业估值等方面进行深入研究以外，根据公司盈利的持续性、稳定性、增长性以及资本回报率调整和修正折溢价，寻找合适的个股。</p> <p>4、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> <p>5、国债期货投资策略</p> <p>本集合计划对国债期货的投资以套期保值为主要目的，结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，获取超额收益。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×5%+中债综合指数收益率×90%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%
风险收益特征	<p>本集合计划为债券型集合计划，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于混合型基金、混合型集合计划、股票型基金和股票型集合计划。</p> <p>本集合计划可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本集合计划还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。</p>

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海光大证券资产管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	朱轶	石立平
	联系电话	021-32068300	010-63639180
	电子邮箱	zhuyi1@ebscn.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		95525	95595
传真		021-32068585	010-63639132
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码		200127	100033
法定代表人		熊国兵	王江

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
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)		
	光大阳光北斗星 180 天滚动 A	光大阳光北斗星 180 天滚动 C	
本期已实现收益	866,352.00	173,448.50	
本期利润	1,674,060.67	364,644.59	
加权平均基金份额本期利润	0.0406	0.0425	
本期加权平均净值利润率	2.45%	2.58%	
本期基金份额净值增长率	2.49%	2.33%	
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	27,769,033.27	5,263,661.76
	期末可供分配基金份额利润	0.6723	0.6612
	期末基金资产净值	69,076,466.34	13,224,817.40
	期末基金份额净值	1.6723	1.6612
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	-0.17%	-0.71%

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

光大阳光北斗星 180 天滚动 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	0.62%	0.14%	0.48%	0.09%	0.14%	0.05%
过去三个月	0.64%	0.12%	0.54%	0.09%	0.10%	0.03%
过去六个月	2.49%	0.11%	1.05%	0.09%	1.44%	0.02%
过去一年	2.24%	0.11%	0.26%	0.11%	1.98%	0.00%
自基金合同生效起至今	-0.17%	0.26%	0.10%	0.12%	-0.27%	0.14%

光大阳光北斗星 180 天滚动 C

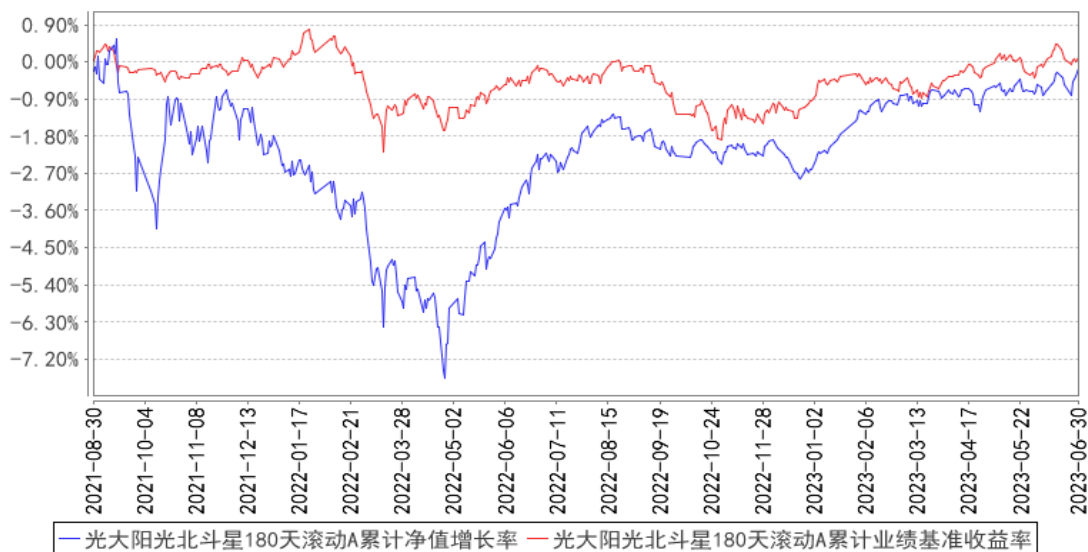
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.59%	0.14%	0.48%	0.09%	0.11%	0.05%
过去三个月	0.57%	0.12%	0.54%	0.09%	0.03%	0.03%
过去六个月	2.33%	0.11%	1.05%	0.09%	1.28%	0.02%
过去一年	1.94%	0.11%	0.26%	0.11%	1.68%	0.00%
自基金合同生效起至今	-0.71%	0.26%	0.10%	0.12%	-0.81%	0.14%

注：1、自基金合同生效起至今指 2021 年 8 月 30 日至 2023 年 6 月 30 日；

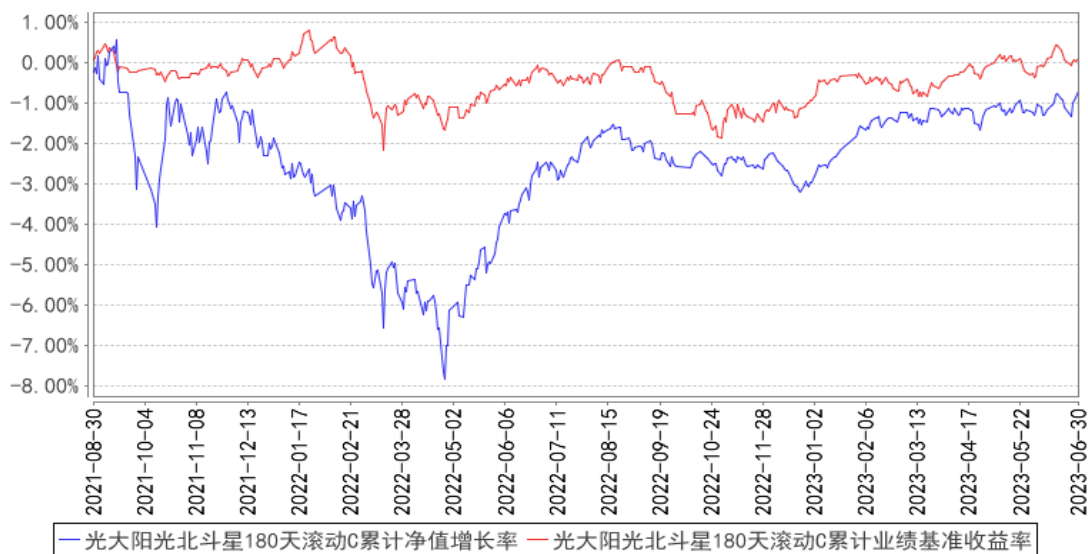
2、业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×5%+中债综合指数收益率×90%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%

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

光大阳光北斗星180天滚动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



光大阳光北斗星180天滚动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丰富经验。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张丁	公司总经理助理兼固定收益公募投资部总经理、本集合计划投资经理、光大阳光添利债券型集合资产管理计划投资经理、光大阳光北斗星 9 个月持有期债券型集合资产管理计划投资经理	2021 年 8 月 30 日	-	15 年	张丁先生, 硕士学历。先后担任九富投资顾问有限公司研究员、中诚信国际信用评级有限责任公司公司评级部总经理助理、招商证券股份有限公司研究发展中心债券研究员、华商基金管理有限公司研究部债券研究员、中国国际金融股份有限公司资产管理部债券投资经理。2017 年加入光证资管, 现任公司总经理助理兼固定收益公募投资部总经理。
陈韵骋	固定收益公募投资部投资经理、本集合计划投资经理、光大阳光对冲策略 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	2022 年 10 月 20 日	-	12 年	陈韵骋先生, 博士学位, 本硕博均毕业于上海交通大学, 曾任海通证券研究所分析师。2015 年加入光证资管, 历任研究员、投资经理助理、投资经理。
崔宁	本集合计划投资助理	2022 年 08 月 17 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。

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本集合计划本报告期末投资经理无兼任私募资产管理计划的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，上海光大证券资产管理有限公司作为本集合计划管理人，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、计划合同以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用计划资产，为集合计划份额持有人谋求最大利益，无损害集合计划持有人利益的行为，本集合计划投资组合符合有关法规及合同的约定。

4.3 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

债券市场方面，2023 年上半年债券市场收益率下行为主，市场主要围绕“强预期”与“弱现实”进行反复博弈。春节前交易疫情放开的强修复预期，利率快速上行后震荡为主；3 月政府工作报告将经济增速目标设定为 5%，低于市场预期，推动债券市场开启下行通道。二季度开始央行货币政策保持宽松，高频数据显示经济动能减弱，随着中小银行调低存款利率，债市收益率进一步下行。降息后十年国债达到上半年收益率低点 2.62%。随着市场逐步止盈和对经济刺激政策的担忧，收益率有小幅回调，但后续地产刺激力度偏弱而利好债市，利率重归下行通道。

权益市场方面，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，光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券型集合资产管理计划持有 A 类份额净值为 1.6723 元，本报告期份额净值增长率为 2.49%；光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券型集合资产管理计划持有 C 类份额净值为 1.6612 元，本报告期份额净值增长率为 2.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为下半年将有一个相对较好的 beta 环境。从历史规律来看，7、8 月是半年报发布窗口，市场将重回基本面，财报数据优秀的公司将得到市场的追捧，部分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，而相对的主题、板块性投资三季度可能会偃旗息鼓。策略选择上，一方面我们会增加基本面因素权重，努力获取该时间窗口中的基本面 Alpha 超额；另一方面对策略整体动量进行约束，规避可能出现的热门板块、行业动量崩溃。

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种投资品

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，中国光大银行股份有限公司在光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券型集合资产管理计划（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实守信、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券型集合资产管理计划 2023 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务

会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 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：光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	390,734.49	4,116,735.48
结算备付金		273,909.24	95,561.48
存出保证金		9,355.89	26,509.20
交易性金融资产	6.4.7.2	83,079,105.07	80,067,185.05
其中：股票投资		12,530,787.15	7,248,043.00
基金投资		-	-
债券投资		70,548,317.92	72,819,142.05
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		99,299.08	-
应收股利		-	-
应收申购款		207.79	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		83,852,611.56	84,305,991.21
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		1,399,532.72	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		20,220.37	21,494.33
应付托管费		6,740.10	7,164.80
应付销售服务费		3,249.12	4,305.02
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,181.16	4,751.16
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	119,404.35	115,052.55
负债合计		1,551,327.82	152,767.86
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	49,268,588.71	51,628,298.97
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	33,032,695.03	32,524,924.38
净资产合计		82,301,283.74	84,153,223.35
负债和净资产总计		83,852,611.56	84,305,991.21

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，集合计划份额总额 49,268,588.71 份。光大阳光北斗星 180 天滚动 A 集合计划份额净值 1.6723 元，集合计划份额 41,307,433.07 份，集合计划资产净值 69,076,466.34 元。光大阳光北斗星 180 天滚动 C 集合计划份额净值 1.6612 元，集合计划份额 7,961,155.64 份，集合计划资产净值 13,224,817.40 元。

6.2 利润表

会计主体：光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		2,307,099.04	-300,355.00
1. 利息收入		32,621.34	39,007.37
其中：存款利息收入	6.4.7.13	31,722.64	39,007.37
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		898.70	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”		1,275,572.94	-3,862,101.72

填列)			
其中：股票投资收益	6.4.7.14	374,745.54	-5,731,926.75
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	780,588.44	1,692,967.20
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	120,238.96	176,857.83
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	998,904.76	3,522,739.35
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	-	-
减：二、营业总支出		268,393.78	506,867.50
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	122,974.39	187,284.48
2. 托管费	6.4.10.2.2	40,991.42	62,428.16
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	21,186.45	30,694.46
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		16,922.24	136,408.46
其中：卖出回购金融资产 支出		16,922.24	136,408.46
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		3,336.27	6,977.05
8. 其他费用	6.4.7.23	62,983.01	83,074.89
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		2,038,705.26	-807,222.50
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		2,038,705.26	-807,222.50
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		2,038,705.26	-807,222.50

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券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)	51,628,298.97	-	32,524,924.38	84,153,223.35
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)	51,628,298.97	-	32,524,924.38	84,153,223.35
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,359,710.26	-	507,770.65	-1,851,939.61
(一)、综合收益总额	-	-	2,038,705.26	2,038,705.26
(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)	-2,359,710.26	-	-1,530,934.61	-3,890,644.87
其中：1. 基金申购款	325,974.75	-	215,096.23	541,070.98
2. 基金赎回款	-2,685,685.01	-	-1,746,030.84	-4,431,715.85
(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)	49,268,588.71	-	33,032,695.03	82,301,283.74
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)	78,649,837.00	-	50,698,757.87	129,348,594.87
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)	78,649,837.00	-	50,698,757.87	129,348,594.87
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-366,427.57	-	-1,019,779.89	-1,386,207.46
(一)、综合收益总额	-	-	-807,222.50	-807,222.50
(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)	-366,427.57	-	-212,557.39	-578,984.96
其中：1. 基金申购款	48,262.46	-	29,244.80	77,507.26
2. 基金赎回款	-414,690.03	-	-241,802.19	-656,492.22
(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)	78,283,409.43	-	49,678,977.98	127,962,387.41

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

光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券型集合资产管理计划是由光大阳光北斗星集合资产管理

计划转型而来。本集合计划的管理人上海光大证券资产管理有限公司于 2021 年 8 月 23 日发布《光大阳光北斗星集合资产管理计划合同变更公告》。根据公告，光大阳光北斗星集合资产管理计划份额转换为光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券型集合资产管理计划份额。合同变更后，本集和计划的托管人、登记机构不变。自 2021 年 8 月 30 日起《光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》、《光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议》生效。本集和计划自资产管理合同生效日起存续期不得超过 3 年。本集和计划管理人为上海光大证券资产管理有限公司，托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》的有关规定。本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、央行票据、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、二级资本债、公开发行的次级债券、可交换债券、可转换债券（含分离型可转换债券）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具等；国内依法发行上市的股票（包含主板、创业板及其他经中国证监会核准上市或注册的股票）、港股通标的股票、国债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。

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：债券资产的比例不低于集合计划资产的 80%，其中投资于可转换债券的比例不超过集合计划资产的 20%，投资于股票等权益类资产的投资比例合计不超过集合计划资产的 20%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%）；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于集合计划资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。国债期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

本集合计划的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×5%+中债综合指数收益率×90%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务

的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本集合计划持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本集合计划本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本集合计划本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

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

1、资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴

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

2、对集合计划从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3、对集合计划取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向集合计划支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对集合计划从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对集合计划持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

4、集合计划卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

5、本集合计划的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 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	390,734.49
等于：本金	390,393.24
加：应计利息	341.25
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	390,734.49

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	12,514,072.29	-	12,530,787.15	16,714.86	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	28,526,594.57	370,963.04	29,019,256.10	121,698.49
	银行间市场	41,248,388.68	269,061.82	41,529,061.82	11,611.32
	合计	69,774,983.25	640,024.86	70,548,317.92	133,309.81
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	82,289,055.54	640,024.86	83,079,105.07	150,024.67	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本集合计划本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本集合计划本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本集合计划本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本集合计划本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本集合计划本报告期末未持有任何买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本集合计划本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本集合计划本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本集合计划本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本集合计划本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本集合计划本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本集合计划本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本集合计划本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	65,521.34
其中：交易所市场	61,008.85
银行间市场	4,512.49
应付利息	-
预提费用	53,883.01
合计	119,404.35

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

光大阳光北斗星 180 天滚动 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	41,242,328.56	41,242,328.56
本期申购	222,044.18	222,044.18
本期赎回（以“-”号填列）	-156,939.67	-156,939.67
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	41,307,433.07	41,307,433.07

光大阳光北斗星 180 天滚动 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	10,385,970.41	10,385,970.41
本期申购	103,930.57	103,930.57
本期赎回（以“-”号填列）	-2,528,745.34	-2,528,745.34
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	7,961,155.64	7,961,155.64

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不存在其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

光大阳光北斗星 180 天滚动 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	27,959,511.12	-1,907,964.00	26,051,547.12
本期利润	866,352.00	807,708.67	1,674,060.67
本期基金份额交易产生的变动数	44,709.18	-1,283.70	43,425.48
其中：基金申购款	153,415.22	-6,135.88	147,279.34
基金赎回款	-108,706.04	4,852.18	-103,853.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	28,870,572.30	-1,101,539.03	27,769,033.27

光大阳光北斗星 180 天滚动 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,953,283.45	-479,906.19	6,473,377.26
本期利润	173,448.50	191,196.09	364,644.59
本期基金份额交易产生	-1,650,348.49	75,988.40	-1,574,360.09

的变动数			
其中：基金申购款	70,997.06	-3,180.17	67,816.89
基金赎回款	-1,721,345.55	79,168.57	-1,642,176.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,476,383.46	-212,721.70	5,263,661.76

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		30,457.67
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		1,130.75
其他		134.22
合计		31,722.64

注：“其他”为交易所保证金和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		374,745.54
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		374,745.54

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		60,295,659.72
减：卖出股票成本总额		59,759,327.69
减：交易费用		161,586.49
买卖股票差价收入		374,745.54

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投资收益-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	1,230,098.51
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-449,510.07
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	780,588.44

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	126,286,774.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	124,436,253.78
减：应计利息总额	2,293,207.71
减：交易费用	6,823.28
买卖债券差价收入	-449,510.07

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内不存在债券投资收益-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内不存在债券投资收益-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内不存在资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 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内不存在资产支持证券投资收益-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内不存在资产支持证券投资收益-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内不存在贵金属投资收益-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内不存在贵金属投资收益-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内不存在贵金属投资收益-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内不存在衍生工具收益-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

本集合计划本报告期内不存在衍生工具收益-其他投资收益。

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	120,238.96
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	120,238.96

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	998,904.76
股票投资	331,826.63
债券投资	667,078.13
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	998,904.76

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	4,711.43
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
合计	62,983.01

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

截至资产负债表日，本集合计划未发生需要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
中国光大银行股份有限公司	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”）	集合计划代销机构、集合计划管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
光大证券	125,005,904.93	100.00	121,433,486.48	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	91,859,583.85	100.00	103,150,462.23	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	48,420,000.00	100.00	864,800,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

本集合计划本报告期无权证交易。

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	91,751.01	100.00	61,008.85	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	89,328.98	100.00	15,666.26	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经手费的净额列示。

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	122,974.39	187,284.48
其中：支付销售机构的客户维护费	530.11	735.01

注：本集合计划不同类别份额的管理费分别计算，A 类份额固定年管理费率为 0.3%，C 类份额固定年管理费率为 0.3%，本集合计划固定管理费的计算方法如下：

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

G 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日的集合计划资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	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托管费	40,991.42	62,428.16

注：集合计划托管费按前一日的集合计划资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	光大阳光北斗星 180 天 滚动 A	光大阳光北斗星 180 天 滚动 C	合计
光证资管	-	20,966.58	20,966.58
合计	-	20,966.58	20,966.58
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		
	光大阳光北斗星 180 天 滚动 A	光大阳光北斗星 180 天 滚动 C	合计
	光证资管	-	30,642.18
合计	-	30,642.18	30,642.18

注：C 类份额集合计划销售服务费按前一日的 C 类份额集合计划资产净值的 0.3% 的年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划销售服务费

E 为前一日的 C 类份额集合计划资产净值

C 类份额集合计划销售服务费每日计算，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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本集合计划本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内管理人未运用自有资金投资本集合计划。

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

报告期末不存在除管理人之外的其他关联方投资本集合计划的情况。

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
中国光大银行股份有限公司	390,734.49	30,457.67	6,325,367.75	27,847.66

注：本集合计划的银行存款由托管人中国光大银行保管，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

本集合计划在承销期内未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

无。

6.4.11 利润分配情况

本集合计划本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本集合计划本报告期末未持有因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本集合计划本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本集合计划本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本集合计划本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本集合计划本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划在日常经营活动中面临的与金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险

及市场风险。管理人制定内部风险管理制度来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本集合计划的银行存款存放在本集合计划的托管行中国光大银行股份有限公司，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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	13,034,703.55	16,832,895.61
合计	13,034,703.55	16,832,895.61

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。

6.4.13.2.2 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	40,718,860.25	38,509,348.65
AAA 以下	6,744,890.47	12,388,833.41
未评级	10,049,863.65	5,088,064.38
合计	57,513,614.37	55,986,246.44

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的证券大部分具有良好的流动性，本集合计划本报告期末未持有流通受限的证券，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	390,734.49	-	-	-	390,734.49
结算备付金	273,909.24	-	-	-	273,909.24
存出保证金	9,355.89	-	-	-	9,355.89
交易性金融资产	40,727,388.64	24,359,979.75	5,460,949.53	12,530,787.15	83,079,105.07
应收申购款	-	-	-	207.79	207.79
应收清算款	-	-	-	99,299.08	99,299.08
资产总计	41,401,388.26	24,359,979.75	5,460,949.53	12,630,294.02	83,852,611.56
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	20,220.37	20,220.37
应付托管费	-	-	-	6,740.10	6,740.10

卖出回购金融资产款	1,399,532.72	-	-	-	1,399,532.72
应付销售服务费	-	-	-	3,249.12	3,249.12
应交税费	-	-	-	2,181.16	2,181.16
其他负债	-	-	-	119,404.35	119,404.35
负债总计	1,399,532.72	-	-	151,795.10	1,551,327.82
利率敏感度缺口	40,001,855.54	24,359,979.75	5,460,949.53	12,478,498.92	82,301,283.74
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	4,116,735.48	-	-	-	4,116,735.48
结算备付金	95,561.48	-	-	-	95,561.48
存出保证金	26,509.20	-	-	-	26,509.20
交易性金融资产	64,207,610.58	8,611,531.47	-	7,248,043.00	80,067,185.05
资产总计	68,446,416.74	8,611,531.47	-	7,248,043.00	84,305,991.21
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	21,494.33	21,494.33
应付托管费	-	-	-	7,164.80	7,164.80
应付销售服务费	-	-	-	4,305.02	4,305.02
应交税费	-	-	-	4,751.16	4,751.16
其他负债	-	-	-	115,052.55	115,052.55
负债总计	-	-	-	152,767.86	152,767.86
利率敏感度缺口	68,446,416.74	8,611,531.47	-	7,095,275.14	84,153,223.35

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	-150,917.86	-65,066.98
	市场利率下降 25 个基点	150,917.86	65,066.98

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

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的敏感性分析。

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	12,530,787.15	15.23	7,248,043.00	8.61
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	12,530,787.15	15.23	7,248,043.00	8.61

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）
	沪深 300 指数上升	457,884.33	273,597.26

	5%		
	沪深 300 指数下降	-457, 884. 33	-273, 597. 26
	5%		

6. 4. 13. 4. 4 采用风险价值法管理风险

本集合计划本报告期无采用风险价值法管理的风险。

6. 4. 14 公允价值

6. 4. 14. 1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6. 4. 14. 2 持续的以公允价值计量的金融工具

6. 4. 14. 2. 1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	20, 027, 753. 11	10, 732, 875. 84
第二层次	63, 051, 351. 96	69, 334, 309. 21
第三层次	-	-
合计	83, 079, 105. 07	80, 067, 185. 05

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售等情况，本集合计划不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6. 4. 14. 3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本集合计划本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本集合计划持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	12,530,787.15	14.94
	其中：股票	12,530,787.15	14.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	70,548,317.92	84.13
	其中：债券	70,548,317.92	84.13
	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	-	-
	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	664,643.73	0.79
8	其他各项资产	108,862.76	0.13
9	合计	83,852,611.56	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	351,350.00	0.43
B	采矿业	619,725.00	0.75
C	制造业	8,251,299.25	10.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	265,392.00	0.32
E	建筑业	159,006.40	0.19
F	批发和零售业	623,697.00	0.76
G	交通运输、仓储和邮政业	268,466.00	0.33
H	住宿和餐饮业	143,620.00	0.17

I	信息传输、软件和信息技术服务业	776,142.00	0.94
J	金融业	714,828.00	0.87
K	房地产业	34,748.00	0.04
L	租赁和商务服务业	173,948.50	0.21
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	148,565.00	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	12,530,787.15	15.23

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	002154	报喜鸟	54,300	299,736.00	0.36
2	601328	交通银行	43,100	249,980.00	0.30
3	600585	海螺水泥	10,400	246,896.00	0.30
4	601168	西部矿业	23,200	243,832.00	0.30
5	600546	山煤国际	15,700	227,179.00	0.28
6	601998	中信银行	32,200	192,556.00	0.23
7	300970	华绿生物	7,000	163,520.00	0.20
8	002847	盐津铺子	1,900	161,595.00	0.20
9	002763	汇洁股份	18,200	161,252.00	0.20
10	603688	石英股份	1,400	159,376.00	0.19
11	603877	太平鸟	6,300	159,264.00	0.19
12	002371	北方华创	500	158,825.00	0.19
13	002128	电投能源	12,000	158,640.00	0.19
14	300511	雪榕生物	20,700	157,320.00	0.19
15	300389	艾比森	7,700	156,849.00	0.19
16	300118	东方日升	6,100	156,343.00	0.19
17	002920	德赛西威	1,000	155,810.00	0.19
18	605499	东鹏饮料	900	155,610.00	0.19
19	300842	帝科股份	1,700	155,448.00	0.19
20	002612	朗姿股份	6,500	154,570.00	0.19
21	605066	天正电气	16,400	154,324.00	0.19
22	603121	华培动力	17,300	154,143.00	0.19
23	600488	津药药业	27,400	153,988.00	0.19

24	603628	清源股份	9,700	153,551.00	0.19
25	002568	百润股份	4,200	152,670.00	0.19
26	300274	阳光电源	1,300	151,619.00	0.18
27	000625	长安汽车	11,700	151,281.00	0.18
28	601966	玲珑轮胎	6,800	151,096.00	0.18
29	002976	瑞玛精密	5,400	151,038.00	0.18
30	601816	京沪高铁	28,700	150,962.00	0.18
31	300973	立高食品	2,200	150,524.00	0.18
32	600728	佳都科技	21,700	150,381.00	0.18
33	002419	天虹股份	25,700	150,345.00	0.18
34	688390	固德威	900	150,174.00	0.18
35	600011	华能国际	16,200	150,012.00	0.18
36	603027	千禾味业	7,100	149,952.00	0.18
37	002056	横店东磁	8,200	149,322.00	0.18
38	688599	天合光能	3,500	149,135.00	0.18
39	688618	三旺通信	2,200	148,984.00	0.18
40	600702	舍得酒业	1,200	148,740.00	0.18
41	603199	九华旅游	4,300	148,565.00	0.18
42	000596	古井贡酒	600	148,428.00	0.18
43	300795	米奥会展	3,550	148,070.50	0.18
44	601857	中国石油	19,800	147,906.00	0.18
45	002728	特一药业	9,680	147,620.00	0.18
46	600438	通威股份	4,300	147,533.00	0.18
47	300308	中际旭创	1,000	147,450.00	0.18
48	300633	开立医疗	2,700	147,150.00	0.18
49	603218	日月股份	7,700	146,223.00	0.18
50	688083	中望软件	1,000	144,890.00	0.18
51	605108	同庆楼	4,300	143,620.00	0.17
52	002959	小熊电器	1,700	141,950.00	0.17
53	002737	葵花药业	5,800	141,172.00	0.17
54	600582	天地科技	24,200	141,086.00	0.17
55	688037	芯源微	800	136,760.00	0.17
56	002489	浙江永强	29,800	120,690.00	0.15
57	300532	今天国际	5,800	119,248.00	0.14
58	300729	乐歌股份	6,590	117,565.60	0.14
59	600035	楚天高速	28,800	117,504.00	0.14
60	002929	润建股份	2,700	117,207.00	0.14
61	002179	中航光电	2,580	117,003.00	0.14
62	000538	云南白药	2,200	115,456.00	0.14
63	601038	一拖股份	9,800	115,052.00	0.14
64	600332	白云山	3,600	114,768.00	0.14
65	601336	新华保险	3,100	113,987.00	0.14
66	002588	史丹利	18,700	113,696.00	0.14

67	600486	扬农化工	1,300	113,646.00	0.14
68	688617	惠泰医疗	300	112,125.00	0.14
69	601009	南京银行	14,000	112,000.00	0.14
70	600050	中国联通	23,200	111,360.00	0.14
71	601668	中国建筑	19,300	110,782.00	0.13
72	603883	老百姓	3,700	110,445.00	0.13
73	300017	网宿科技	15,200	108,072.00	0.13
74	002152	广电运通	9,200	107,824.00	0.13
75	603868	飞科电器	1,700	107,253.00	0.13
76	601717	郑煤机	4,500	56,025.00	0.07
77	603071	物产环能	2,800	46,452.00	0.06
78	600919	江苏银行	6,300	46,305.00	0.06
79	600167	联美控股	6,600	46,002.00	0.06
80	600887	伊利股份	1,600	45,312.00	0.06
81	000906	浙商中拓	5,000	44,600.00	0.05
82	002216	三全食品	2,800	43,624.00	0.05
83	600985	淮北矿业	3,600	41,472.00	0.05
84	002274	华昌化工	5,400	40,446.00	0.05
85	002304	洋河股份	300	39,405.00	0.05
86	600863	内蒙华电	9,400	39,010.00	0.05
87	600639	浦东金桥	2,800	34,748.00	0.04
88	000858	五粮液	200	32,714.00	0.04
89	002772	众兴菌业	2,700	30,510.00	0.04
90	600803	新奥股份	1,600	30,368.00	0.04
91	603519	立霸股份	2,000	29,640.00	0.04
92	600612	老凤祥	400	27,952.00	0.03
93	601958	金钼股份	2,500	27,875.00	0.03
94	603180	金牌厨柜	800	26,816.00	0.03
95	603801	志邦家居	800	26,416.00	0.03
96	603611	诺力股份	1,000	26,340.00	0.03
97	002027	分众传媒	3,800	25,878.00	0.03
98	003011	海象新材	800	25,800.00	0.03
99	603118	共进股份	1,900	25,251.00	0.03
100	603279	景津装备	800	25,088.00	0.03
101	000922	佳电股份	1,900	25,004.00	0.03
102	300349	金卡智能	1,800	24,984.00	0.03
103	300514	友讯达	1,700	24,803.00	0.03
104	603600	永艺股份	2,600	24,726.00	0.03
105	002533	金杯电工	3,000	24,480.00	0.03
106	002345	潮宏基	3,100	24,366.00	0.03
107	002014	永新股份	2,800	24,304.00	0.03
108	600502	安徽建工	4,600	24,288.00	0.03
109	003025	思进智能	1,495	24,144.25	0.03

110	002270	华明装备	2,200	24,090.00	0.03
111	605088	冠盛股份	1,400	24,010.00	0.03
112	605009	豪悦护理	500	24,000.00	0.03
113	603966	法兰泰克	1,900	23,997.00	0.03
114	600039	四川路桥	2,440	23,936.40	0.03
115	605599	菜百股份	1,800	23,778.00	0.03
116	603889	新澳股份	3,140	23,581.40	0.03
117	688425	铁建重工	4,900	23,569.00	0.03
118	603165	荣晟环保	1,400	22,456.00	0.03
119	300951	博硕科技	400	21,852.00	0.03
120	600755	厦门国贸	2,700	20,898.00	0.03
121	301039	中集车辆	1,400	18,522.00	0.02

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	000048	京基智农	499,348.00	0.59
2	002154	报喜鸟	496,327.00	0.59
3	603551	奥普家居	471,755.00	0.56
4	000513	丽珠集团	423,849.00	0.50
5	002911	佛燃能源	405,064.00	0.48
6	002737	葵花药业	400,378.00	0.48
7	002479	富春环保	390,209.00	0.46
8	002807	江阴银行	380,690.00	0.45
9	603408	建霖家居	374,746.00	0.45
10	600488	津药药业	366,417.00	0.44
11	600050	中国联通	357,200.00	0.42
12	300842	帝科股份	342,988.00	0.41
13	601998	中信银行	338,269.00	0.40
14	601939	建设银行	332,640.00	0.40
15	603797	联泰环保	330,313.00	0.39
16	002250	联化科技	328,296.00	0.39
17	603886	元祖股份	327,241.00	0.39
18	002925	盈趣科技	326,443.00	0.39
19	002677	浙江美大	326,302.00	0.39
20	300684	中石科技	325,606.00	0.39

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(%)
1	000513	丽珠集团	656,662.00	0.78
2	603515	欧普照明	559,265.00	0.66
3	000048	京基智农	501,111.00	0.60
4	600919	江苏银行	475,214.00	0.56
5	603551	奥普家居	459,654.00	0.55
6	300684	中石科技	444,904.00	0.53
7	603920	世运电路	417,087.00	0.50
8	002911	佛燃能源	410,597.00	0.49
9	603886	元祖股份	407,834.00	0.48
10	601939	建设银行	388,589.00	0.46
11	002479	富春环保	380,721.00	0.45
12	002807	江阴银行	371,600.00	0.44
13	603408	建霖家居	361,321.00	0.43
14	601088	中国神华	354,842.00	0.42
15	601398	工商银行	345,886.00	0.41
16	601138	工业富联	338,366.00	0.40
17	002925	盈趣科技	329,795.00	0.39
18	002677	浙江美大	324,786.00	0.39
19	601288	农业银行	323,398.00	0.38
20	603797	联泰环保	322,927.00	0.38

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	64,710,245.21
卖出股票收入（成交）总额	60,295,659.72

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,432,832.89	49.13
	其中：政策性金融债	23,084,567.20	28.05
4	企业债券	22,618,519.07	27.48
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	7,496,965.96	9.11
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	70,548,317.92	85.72

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	230206	23 国开 06	80,000	8,020,655.74	9.75
2	1680445	16 溧水经开债	300,000	6,149,934.58	7.47
3	188341	21 宁铁 13	50,000	5,185,518.08	6.30
4	2028006	20 邮储银行永续债	50,000	5,128,344.26	6.23
5	1928011	19 工商银行二级 03	50,000	5,114,824.66	6.21

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

本集合计划投资范围中不包括股指期货。

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

本集合计划对国债期货的投资以套期保值为主要目的，结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，获取超额收益。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本集合计划本报告期末进行国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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：

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；

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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本集合计划投资的前十名股票未超出集合计划合同规定的备选股票库。

7.12.3 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	9,355.89
2	应收清算款	99,299.08
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	207.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	108,862.76

7.12.4 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	1,186,351.01	1.44
2	110045	海澜转债	1,109,519.03	1.35
3	110053	苏银转债	1,096,244.95	1.33
4	113651	松霖转债	255,658.59	0.31
5	123104	卫宁转债	171,585.01	0.21
6	127052	西子转债	170,557.34	0.21
7	113519	长久转债	168,130.44	0.20
8	127054	双箭转债	167,739.55	0.20
9	110060	天路转债	167,450.41	0.20
10	113549	白电转债	167,057.25	0.20
11	127028	英特转债	166,004.93	0.20
12	128133	奇正转债	165,741.31	0.20
13	128075	远东转债	165,607.79	0.20
14	113516	苏农转债	163,963.48	0.20
15	128130	景兴转债	162,931.50	0.20
16	113061	拓普转债	90,466.28	0.11
17	128083	新北转债	89,453.88	0.11
18	113057	中银转债	88,608.62	0.11
19	123004	铁汉转债	88,479.80	0.11
20	128129	青农转债	88,127.14	0.11
21	113631	皖天转债	87,779.06	0.11
22	113042	上银转债	87,655.09	0.11
23	110059	浦发转债	87,554.74	0.11

24	113021	中信转债	87,487.12	0.11
25	128035	大族转债	87,370.60	0.11
26	113588	润达转债	86,037.36	0.10
27	127036	三花转债	85,920.27	0.10
28	113638	台 21 转债	83,812.50	0.10
29	113045	环旭转债	81,897.55	0.10
30	113632	鹤 21 转债	81,721.99	0.10
31	128136	立讯转债	81,684.30	0.10
32	113627	太平转债	81,646.21	0.10
33	113623	凤 21 转债	81,470.96	0.10
34	113053	隆 22 转债	81,437.94	0.10
35	123119	康泰转 2	80,954.76	0.10
36	128134	鸿路转债	80,852.08	0.10
37	123090	三诺转债	80,717.88	0.10
38	123117	健帆转债	80,563.15	0.10
39	113639	华正转债	60,724.09	0.07

7.12.5 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未存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 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 (%)
光大阳光北斗星 180 天滚动 A	352	117,350.66	40,748,236.02	98.65	559,197.05	1.35
光大阳光北斗星 180 天滚动 C	198	40,207.86	7,813,693.39	98.15	147,462.25	1.85

合计	550	89,579.25	48,561,929.41	98.57	706,659.30	1.43
----	-----	-----------	---------------	-------	------------	------

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	光大阳光北斗星 180 天滚动 A	112,956.16	0.2735
	光大阳光北斗星 180 天滚动 C	35,402.34	0.4447
	合计	148,358.50	0.3011

注：从业人员持有集合占集合总份额比例的计算中，对下属分级集合，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级集合份额的合计数（即期末集合份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	光大阳光北斗星 180 天滚动 A	0~10
	光大阳光北斗星 180 天滚动 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	光大阳光北斗星 180 天滚动 A	0~10
	光大阳光北斗星 180 天滚动 C	0~10
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	光大阳光北斗星 180 天滚动 A	光大阳光北斗星 180 天滚动 C
基金合同生效日 (2021 年 8 月 30 日) 基金份额总额	104,154,773.55	25,863,693.39
本报告期期初基金份额总额	41,242,328.56	10,385,970.41
本报告期基金总申购份额	222,044.18	103,930.57
减：本报告期基金总赎回份额	156,939.67	2,528,745.34
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份	41,307,433.07	7,961,155.64

额总额		
-----	--	--

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末改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
光大证券	2	125,005,904.	100.00	91,751.01	100.00	-

		93			
--	--	----	--	--	--

注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易（如有）而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

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	91,859,583.85	100.00	48,420,000.00	100.00	-	-

注：本集合计划本报告期末未进行权证交易。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券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	光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券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
3	光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券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

§ 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

投资者	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-----	----------------	------------

类别	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20230101-20230630	40,748,236.02	0.00	0.00	40,748,236.02	82.7063
产品特有风险							
本集合计划在报告期内存在单一投资者持有集合计划份额比例达到或者超过 20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，集合计划管理人可能无法以合理的价格及时变现集合计划资产，有可能对集合计划净值产生一定的影响，甚至可能引发集合计划的流动性风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予《光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》变更批复的文件；

- 2、《光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券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：

- 1、中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层

12.3 查阅方式

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

上海光大证券资产管理有限公司

2023 年 8 月 31 日