

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 3 季度报告

2023 年 9 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

报告送出日期：2023 年 10 月 25 日

## § 1 重要提示

集合计划管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

集合计划托管人中国光大银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 10 月 24 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 07 月 01 日起至 2023 年 09 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	84,582,362.82 份
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</p>

	<p>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>
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
下属分级基金的基金简称	光太阳光北斗星 180 天滚动 A 光太阳光北斗星 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	32,629,184.07 份 51,953,178.75 份

注：本报告中所述的“基金”包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资

产管理业务的指导意见>操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 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
1. 本期已实现收益	-245,938.28	-315,062.00
2. 本期利润	-461,949.86	-281,997.42
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0108	-0.0080
4. 期末基金资产净值	54,380,863.31	85,950,970.69
5. 期末基金份额净值	1.6666	1.6544

注：1、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。

2、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。

#### 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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.34%	0.14%	-0.53%	0.09%	0.19%	0.05%
过去六个月	0.30%	0.13%	0.00%	0.09%	0.30%	0.04%
过去一年	1.81%	0.12%	0.85%	0.11%	0.96%	0.01%
自基金合同生效起至今	-0.51%	0.25%	-0.44%	0.12%	-0.07%	0.13%

光大阳光北斗星 180 天滚动 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

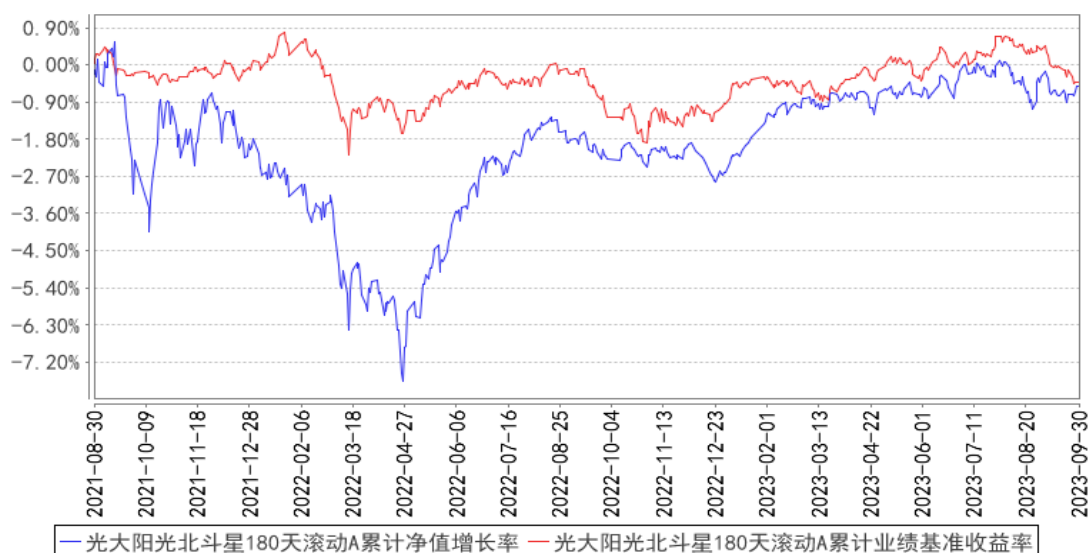
过去三个月	-0.41%	0.14%	-0.53%	0.09%	0.12%	0.05%
过去六个月	0.16%	0.13%	0.00%	0.09%	0.16%	0.04%
过去一年	1.52%	0.12%	0.85%	0.11%	0.67%	0.01%
自基金合同生效起至今	-1.12%	0.25%	-0.44%	0.12%	-0.68%	0.13%

注：1、自基金合同生效起至今指 2021 年 8 月 30 日至 2023 年 9 月 30 日；

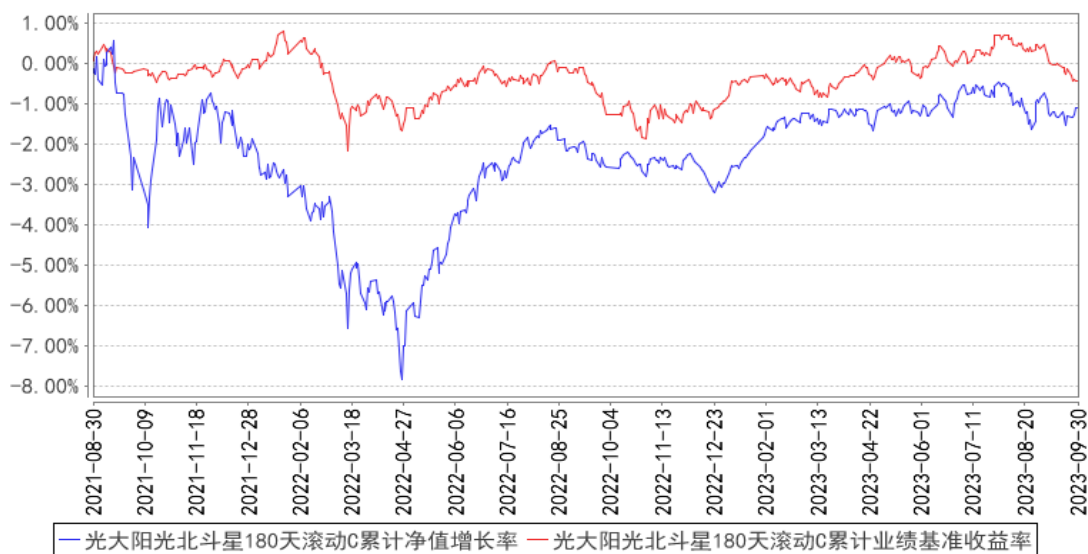
2、业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×5%+中债综合指数收益率×90%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%

### 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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张丁	公司总经理助理、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。
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、光大阳光对冲策略灵活配置混合型集合资产管理计划投资经理、光大阳光稳健增长混合型集合资产管理计划投资经理	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。

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。

#### 4.1.1 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 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本集合计划管理人一贯公平对待旗下管理的所有集合计划和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《上海光大证券资产管理有限公司公平交易与利益冲突防范管理办法》等规定。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本集合计划存在异常交易行为。报告期内，未出现涉及本集合计划的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

债券方面，三季度震荡下行后出现一定回调。具体来看，7 月以来经济修复的力度仍然不强，市场对于政治局会议的预期普遍偏低。7 月 24 日政治局会议召开，对地产政策的定调发生了较大调整。虽然资金的宽松对于市场有一定呵护作用，但债市长端有明显的调整。8 月央行超预期降低公开市场操作利率，资金面宽松叠加经济数据显著走弱，债市重回下行趋势。8 月底开始资金边际收紧，短端利率上行加快，曲线熊平。政治局会议部署的各项政策在逐步兑现当中。9 月初开始，地产政策加速出台落地，一线城市先后宣布执行“认房不认贷”超出市场预期，资金面收敛的助推下，债市快速调整。此外，受到利率供给、信贷投放、汇率压力、跨季等多方因素影响，

9 月资金紧张局面一直持续到跨季结束。展望四季度，稳增长政策逐步落地后进入效果观察期，基本面有所恢复但地产低迷的状态仍未发生根本性转变，阶段性的调整压力过后，债券资产仍具有配置价值。

权益资产方面，三季度 A 股呈现震荡探底走势。在明显风险偏好收缩的情绪背景下，大盘优于小盘，价值优于成长。属性相对抗跌的高分红个股出现一定的涨幅，红利风格的强势得到延续。

市场的低迷有外因也有内因。外因上，外资流出一方面压制市场价格，另一方面也冲击了市场的情绪面。三季度北向流出近千亿，8 月开始单边净流出的态势一直持续。就现况来看，美国新增非农就业大幅超出预期，制造业 PMI 也持续回升，美债利率保持高位的趋势将会延续。与此同时，美强欧弱格局下美元持续上行，美元强势也很难改变。我们预期流出压力短期内始终存在。

内因我们认为主要是情绪面。宏观经济上，各类经济指标已经触底反弹中。8 月工业企业利润强劲回升，单月利润同比大幅转正，PPI 的脉冲式回升，量价指标年内首次共振，推升工业利润周期明确见底。9 月 PMI 六个月以来首次站上荣枯线，供需全面走高价格也有抬升，同时呈现被动去库存特征。非制造业中建筑业大幅改善，服务业也触底反弹。对于经济指标的好转，市场仍是犹疑观望态度，当然这是可以理解的，在市场情绪低迷的情况下市场底晚于经济底也有过不少先例。

风险偏好的极端化通常提示了市场情绪在一个方向的过度反应。A 股市场已经进行了接近两年时间的风险释放，本身的估值水平，与其他大类资产如债券的相对性价比，都说明大幅下跌的风险并不大。但是中短期来看，能否出现反转上行行情也受到一些外在因素的制约。从历史来看拐点的出现都难以提前预测，我们认为接下来做多 A 股市场类似于买入看涨期权，下行空间有限，持有需要支付一定的期权费，盈利点就在于何时市场认知发生变化，向上空间打开。

策略配置上我们也持类似逻辑。价值风格的强势已经到了有风险释放需求的阶段，我们将逐渐增加成长风格策略的配置，买入成长风格看涨期权，等待市场风格的切换。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 9 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 1.6666 元，本报告期份额净值增长率为-0.34%；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 1.6544 元，本报告期份额净值增长率为-0.41%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本集合计划未出现连续二十个工作日集合计划份额持有人数量不满二百人或集合计划资产净值低于五千万元的情形。



## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	20,560,155.00	13.51
	其中：股票	20,560,155.00	13.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	128,761,190.48	84.63
	其中：债券	128,761,190.48	84.63
	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	2,799,911.07	1.84
8	其他资产	28,568.97	0.02
9	合计	152,149,825.52	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。

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,125,717.00	0.80
C	制造业	12,397,655.00	8.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	610,275.00	0.43
E	建筑业	623,173.00	0.44
F	批发和零售业	674,295.00	0.48
G	交通运输、仓储和邮政业	113,328.00	0.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	989,245.00	0.70
J	金融业	2,724,766.00	1.94
K	房地产业	226,756.00	0.16
L	租赁和商务服务业	370,949.00	0.26
M	科学研究和技术服务业	179,703.00	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	185,932.00	0.13

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	338,361.00	0.24
S	综合	-	-
	合计	20,560,155.00	14.65

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601166	兴业银行	25,900	421,911.00	0.30
2	601288	农业银行	116,400	419,040.00	0.30
3	601168	西部矿业	32,300	415,055.00	0.30
4	601998	中信银行	70,700	404,404.00	0.29
5	601939	建设银行	63,500	400,050.00	0.29
6	300532	今天国际	20,000	375,600.00	0.27
7	000550	江铃汽车	21,500	371,520.00	0.26
8	601088	中国神华	11,800	368,160.00	0.26
9	603661	恒林股份	9,500	337,630.00	0.24
10	300193	佳士科技	34,700	299,114.00	0.21

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

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	51,200,463.97	36.49
	其中：政策性金融债	33,862,865.67	24.13
4	企业债券	39,371,212.32	28.06
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	31,127,759.39	22.18
7	可转债（可交换债）	7,061,754.80	5.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	128,761,190.48	91.75

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	163060	19 常高 06	100,000	10,650,994.52	7.59

2	101901380	19 南通国投 MTN001	100,000	10,562,876.16	7.53
3	210203	21 国开 03	100,000	10,402,147.54	7.41
4	102280118	22 先行控股 MTN001	100,000	10,297,261.37	7.34
5	2280002	22 临安新锦债	100,000	10,275,501.37	7.32

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本集合计划本报告期末未持有贵金属投资。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本集合计划本报告期末未持有权证投资。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末未持有股指期货。

### 5.9.2 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。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

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。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末未持有国债期货持仓。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本集合计划本报告期末未持有国债期货持仓。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或

### 在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本本报告编制日前一年内：

本集合计划持有的“21 华泰 G3”债券发行主体因涉嫌违反法律法规，于 2023 年 8 月 25 日被国家外汇管理局江苏省分局罚款 5 万元。

该类情形对上述发行主体没有重大影响，该证券的投资决策程序符合相关法律法规以及产品合同的要求。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本集合计划投资的前十名股票未超出集合计划合同规定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	18,568.97
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,000.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	28,568.97

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	127032	苏行转债	2,424,479.73	1.73
2	113519	长久转债	430,322.97	0.31
3	113549	白电转债	429,137.57	0.31
4	113530	大丰转债	426,455.46	0.30
5	123035	利德转债	287,631.77	0.20
6	127054	双箭转债	285,150.31	0.20
7	113627	太平转债	284,086.12	0.20
8	128133	奇正转债	283,511.78	0.20
9	113545	金能转债	283,168.56	0.20
10	113651	松霖转债	280,449.00	0.20
11	113602	景 20 转债	144,048.42	0.10
12	118013	道通转债	143,739.25	0.10
13	123161	强联转债	142,697.02	0.10
14	123101	拓斯转债	142,623.26	0.10
15	128134	鸿路转债	141,536.09	0.10
16	123090	三诺转债	141,162.77	0.10

17	113053	隆 22 转债	141,054.26	0.10
18	113659	莱克转债	139,898.13	0.10
19	123104	卫宁转债	139,868.42	0.10
20	113638	台 21 转债	139,766.21	0.10
21	128075	远东转债	90,886.76	0.06

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

## §6 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
报告期期初基金份额总额	41,307,433.07	7,961,155.64
报告期期间基金总申购份额	32,102,525.65	43,997,681.98
减：报告期期间基金总赎回份额	40,780,774.65	5,658.87
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	32,629,184.07	51,953,178.75

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内集合计划管理人未持有本集合计划份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内集合计划管理人未运用固有资金投资本集合计划。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
	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

机构	1	20230701-20230821	40,748,236.02		-40,748,236.02	-	-
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。							

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1) 2023 年 7 月 24 日，关于旗下光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券型集合资产管理计划增加代理销售机构并开通定期定额投资业务的公告；

2) 2023 年 8 月 21 日，关于旗下光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券型集合资产管理计划增加代理销售机构并开通定期定额投资业务的公告；

3) 2023 年 9 月 13 日，关于投资经理休假的公告。

## §9 备查文件目录

### 9.1 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。

### 9.2 存放地点

备查文件存放于集合计划管理人的办公场所：

1、中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层

### 9.3 查阅方式

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

上海光大证券资产管理有限公司

2023 年 10 月 25 日