

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  
2024 年中期报告

2024 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：2024 年 8 月 30 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 29 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 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	12
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	13
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	14
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 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63

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 .....	64
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 .....	64
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 .....	64
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 .....	64
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	64
7.12 市场中性策略执行情况 .....	64
7.13 投资组合报告附注 .....	65
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>66</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	66
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	67
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 .....	67
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>68</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>68</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	68
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 .....	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	68
10.4 基金投资策略的改变 .....	68
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	68
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 .....	69
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	69
10.8 其他重大事件 .....	69
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>70</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 .....	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	70
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>70</b>
12.1 备查文件目录 .....	70
12.2 存放地点 .....	70
12.3 查阅方式 .....	70

## § 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	168,270,136.01 份		
基金合同存续期	存续期至 2024 年 12 月 31 日，本集合计划自 2024 年 12 月 31 日后，按照中国证监会的有关规定执行		
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	2,244,997.76 份	7,603,020.51 份	158,422,117.74 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	zhuyil@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	北京市西城区菜市口大街 1 号院 2 号楼信托大厦
邮政编码		200127	100053
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	《证券时报》
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(2024年1月1日-2024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	110,882.01	885,059.02	8,156,599.79
本期利润	97,914.33	864,482.42	7,262,425.08
加权平均基金份额本期利润	0.0432	0.0579	0.0439
本期加权平均净值利润率	3.98%	5.39%	4.12%
本期基金份额净值增长率	4.07%	4.31%	4.11%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)		
期末可供分配利润	220,260.54	742,488.22	12,584,893.20

期末可供分配基金份额利润	0.0981	0.0977	0.0794
期末基金资产净值	2,465,258.30	8,345,508.73	171,007,010.94
期末基金份额净值	1.0981	1.0977	1.0794
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)		
基金份额累计净值增长率	7.44%	9.77%	7.94%

注：1、表中的“期末”均指报告期最后一日，即 2024 年 6 月 30 日；“本期”指 2024 年 1 月 1 日-2024 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	-0.35%	0.33%	0.21%	0.01%	-0.56%	0.32%
过去三个月	0.80%	0.31%	0.63%	0.01%	0.17%	0.30%
过去六个月	4.07%	0.34%	1.25%	0.01%	2.82%	0.33%
过去一年	3.10%	0.27%	2.54%	0.01%	0.56%	0.26%
过去三年	1.28%	0.25%	7.80%	0.01%	-6.52%	0.24%
自基金合同生效起至今	7.44%	0.26%	11.27%	0.01%	-3.83%	0.25%

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	-0.30%	0.33%	0.21%	0.01%	-0.51%	0.32%
过去三个月	0.93%	0.31%	0.63%	0.01%	0.30%	0.30%
过去六个月	4.31%	0.34%	1.25%	0.01%	3.06%	0.33%
过去一年	3.62%	0.27%	2.54%	0.01%	1.08%	0.26%
过去三年	2.81%	0.25%	7.80%	0.01%	-4.99%	0.24%
自基金合同生效起至今	9.77%	0.26%	11.27%	0.01%	-1.50%	0.25%

## 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	-0.34%	0.33%	0.21%	0.01%	-0.55%	0.32%
过去三个月	0.82%	0.31%	0.63%	0.01%	0.19%	0.30%
过去六个月	4.11%	0.34%	1.25%	0.01%	2.86%	0.33%
过去一年	3.19%	0.27%	2.54%	0.01%	0.65%	0.26%
过去三年	1.57%	0.25%	7.80%	0.01%	-6.23%	0.24%
自基金合同生效起至今	7.94%	0.26%	11.27%	0.01%	-3.33%	0.25%

注：1、自基金合同生效起至今指 2020 年 3 月 25 日至 2024 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 2024 年 6 月末，本公司共管理 15 只参照开放式证券投资基金管理的集合计划，公司在投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈韵聘	本集合计划投资经	2023 年 3 月 17 日	-	13 年	陈韵聘先生，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

	理				师，2015 年加入光证资管，历任研究员、投资经理助理，现任混合资产公募投资部投资经理，担任光大阳光稳健增长混合型集合资产管理计划、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、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。
崔宁	本集合计划投资经理助理	2023 年 3 月 27 日	-	7 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，现任固定收益公募投资部投资经理，担任光大阳光稳债收益 12 个月持有期债券型集合资产管理计划、光大阳光稳债中短债债券型集合资产管理计划投资经理。

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

上半年 A 股大幅波动下行，个股间分化剧烈。以红利为代表的大盘价值风格延续了去年以来的强势，一枝独秀获得正收益；其他多数风格、板块则承压下行，小盘成为重灾区持续大幅回撤。行业上，银行、公用事业涨幅较大，资源类获得正收益，传媒、计算机跌幅较大。

从经济数据来看，宏观方面有亮点有隐忧。上半年 GDP 增速 5%压线达标，但二季度 GDP 增速 4.7%低于预期。生产端景气度较好，6 月官方制造业 PMI49.5 与 5 月持平，财新 PMI51.8 较 5 月上行 0.1 个百分点，6 月工业增加值增长 5.3%，较上月回落 0.3 个百分点但超出市场预期；消费端不及预期，6 月名义消费回落 1.7 个百分点至 2.0%。投资方面，制造业投资累计同比增速 9.5%，基建累计增速 7.7%，房地产投资累计同比-10.1%，地产仍是拖累项。

从资金角度来看，美元的持续走强对 A 股产生了实质的资金流出压力，北向资金二季度累计流出近 300 亿，流出主要都集中于五月之后。市场快速下行时汇金选择买入大盘 ETF 救市，使得市场存量资金跟随救市资金流入大盘股避险，对中小盘造成抽水效应。

一季度股票的下跌，尤其是小微盘的暴跌对市场信心产生的巨大冲击仍未消弭，二季度几次出现突发式的暴跌和踩踏式的止损。在小微盘没有出现赚钱效应一定程度上修复脆弱情绪之前，小微盘仍然存在流动性风险。因此在策略选择上，上半年我们以风险中性的低跟踪误差类策略为主，规避可能暴露的小微盘股风险，同时根据基差波动在不同的对冲合约中进行调整。但是我们也看到近期出现了一些情绪修复的迹象，例如微盘股六月中旬以来持续跑赢小盘股。微盘股收益本质上是小市值暴露与股价均值回复效应的叠加，均值回复效应的出现说明市场已经出现了抄底买盘资金。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 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 1.0981 元，本报告期份额净值增长率为 4.07%；光大阳光对冲策略 6 个月持有混合 B 类份额净值为 1.0977 元，本报告期份额净值增长率为 4.31%；光大阳光对冲策略 6 个月持有混合 C 类份额净值为 1.0794 元，本报告期份额净值增长率为 4.11%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三中全会后 LPR 调降 10bp，MLF 操作利率下调 20bp，展示中央宽松货币政策以刺激经济的态度，股市的流动性将得到改善。在当前的时点，过于悲观等价于追涨杀跌，过于乐观则赔率虽大但胜率不高。在未来一个季度的周期上，我们还是会保持一个较为均衡、靠近市场主线的配置方

案，等待市场出现明确机会后再进行跟随调整。

#### 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

本集合计划过去三年未进行利润分配。

#### 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，对本基金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，未发现本基金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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	3,664,825.51	9,685,107.10
结算备付金		9,359,908.58	4,133,988.03
存出保证金		12,914,331.78	16,854,314.13
交易性金融资产	6.4.7.2	147,168,212.28	203,347,284.40
其中：股票投资		117,158,671.44	154,817,897.28
基金投资		-	-
债券投资		30,009,540.84	48,529,387.12
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	10,000,000.00	6,000,000.00
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		608,189.17	229,604.88
应收股利		-	-
应收申购款		196,210.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		183,911,677.32	240,250,298.54
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 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		453,914.48	5,702,424.43
应付赎回款		325,744.00	533,973.04
应付管理人报酬		150,803.51	200,660.11
应付托管费		29,958.83	39,925.79
应付销售服务费		56,393.96	66,213.82
应付投资顾问费		-	-
应交税费		997.72	1,359.47
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,076,086.85	530,940.22
负债合计		2,093,899.35	7,075,496.88
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	168,270,136.01	224,324,222.60
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	13,547,641.96	8,850,579.06
净资产合计		181,817,777.97	233,174,801.66
负债和净资产总计		183,911,677.32	240,250,298.54

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，集合计划份额总额 168,270,136.01 份。光大阳光对冲 6 个月持有 A 集合计划份额净值 1.0981 元，集合计划份额 2,244,997.76 份，集合计划资产净值 2,465,258.30 元。光大阳光对冲 6 个月持有 B 集合计划份额净值 1.0977 元，集合计划份额 7,603,020.51 份，集合计划资产净值 8,345,508.73 元。光大阳光对冲 6 个月持有 C 集合计划份额净值 1.0794 元，集合计划份额 158,422,117.74 份，集合计划资产净值 171,007,010.94 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		9,889,744.41	11,697,207.65
1. 利息收入		229,725.97	122,462.51
其中：存款利息收入	6.4.7.13	93,269.62	76,949.39
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		136,456.35	45,513.12
其他利息收入		-	-



2. 投资收益（损失以“-”填列）		10,587,737.43	9,241,452.79
其中：股票投资收益	6.4.7.14	878,101.31	12,656,278.68
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-300,885.06	127,104.79
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	8,550,820.77	-5,483,952.92
股利收益	6.4.7.19	1,459,700.41	1,942,022.24
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	-927,718.99	2,333,292.35
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	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>1,664,922.58</b>	<b>2,362,426.72</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	979,396.77	1,453,822.44
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	194,656.34	289,521.67
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	351,158.83	498,106.69
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		45,526.04	32,351.56
8. 其他费用	6.4.7.23	94,184.60	88,624.36
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>8,224,821.83</b>	<b>9,334,780.93</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>8,224,821.83</b>	<b>9,334,780.93</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>8,224,821.83</b>	<b>9,334,780.93</b>

### 6.3 净资产变动表

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024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	224,324,222.60	-	8,850,579.06	233,174,801.66
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	224,324,222.60	-	8,850,579.06	233,174,801.66
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-56,054,086.59	-	4,697,062.90	-51,357,023.69
(一)、综合收益总额	-	-	8,224,821.83	8,224,821.83
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-56,054,086.59	-	-3,527,758.93	-59,581,845.52
其中：1.基金申购款	24,388,575.41	-	1,942,648.63	26,331,224.04
2.基金赎回款	-80,442,662.00	-	-5,470,407.56	-85,913,069.56
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	168,270,136.01	-	13,547,641.96	181,817,777.97
项目	上年度可比期间 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	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	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净资产变动数(净资产减少以“-”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净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	260,150,911.95	-	12,500,564.75	272,651,476.70

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

常松	詹朋	杨薇
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

光大阳光对冲策略 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。本集合计划存续期至 2024 年 12 月 31 日，本集合计划自 2024 年 12 月 31 日后，按照中国证监会的有关规定执行。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持有价证券市值之和，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

本集合计划的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本集合计划合同和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划 2024 半年度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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 半年度的经营成果和净资产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未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

对集合计划通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。集合计划通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	3,664,825.51
等于：本金	3,663,984.93
加：应计利息	840.58
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	3,664,825.51

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	122,126,485.15	-	117,158,671.44	-4,967,813.71
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	78,723.89	19,910,754.54	26,439.24
	银行间市场	10,076,190.00	14,786.30	7,810.00
	合计	29,881,781.41	93,510.19	30,009,540.84
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	152,008,266.56	93,510.19	147,168,212.28	-4,933,564.47

#### 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 2024 年 6 月 30 日
----	------------------------

	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-111,099,823.65	-	-	-
其中：股指期货投资	-111,099,823.65	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-111,099,823.65	-	-	-

#### 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
IC2409	IC2409	-22.00	-21,450,880.00	1,751,840.00
IF2407	IF2407	-6.00	-6,186,600.00	88,920.00
IF2409	IF2409	-46.00	-47,245,680.00	1,064,880.00
IM2407	IM2407	-6.00	-5,829,600.00	175,840.00
IM2409	IM2409	-24.00	-22,944,960.00	2,380,543.65
IM2412	IM2412	-2.00	-1,875,600.00	104,480.00
合计				5,566,503.65
减：可抵销期货暂收款				5,566,503.65
净额				-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

#### 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无黄金衍生品。

#### 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 2024 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	10,000,000.00	-



银行间市场	-	-
合计	10,000,000.00	-

#### 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计提债权投资减值准备。

#### 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计提其他债权投资减值准备。

#### 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 2024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	1,000,502.25
其中：交易所市场	1,000,327.25
银行间市场	175.00

应付利息	-
预提费用	75,584.60
合计	1,076,086.85

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,305,889.56	2,305,889.56
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-60,891.80	-60,891.80
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	2,244,997.76	2,244,997.76

##### 光大阳光对冲 6 个月持有混合 B

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	35,917,441.41	35,917,441.41
本期申购	672,248.00	672,248.00
本期赎回（以“-”号填列）	-28,986,668.90	-28,986,668.90
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	7,603,020.51	7,603,020.51

##### 光大阳光对冲 6 个月持有混合 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	186,100,891.63	186,100,891.63
本期申购	23,716,327.41	23,716,327.41
本期赎回（以“-”号填列）	-51,395,101.30	-51,395,101.30
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	158,422,117.74	158,422,117.74

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	564,315.51	-436,938.24	127,377.27
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	564,315.51	-436,938.24	127,377.27
本期利润	110,882.01	-12,967.68	97,914.33
本期基金份额交易产生的变动数	-5,162.77	131.71	-5,031.06
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-5,162.77	131.71	-5,031.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	670,034.75	-449,774.21	220,260.54

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	2,464,027.04	-587,194.40	1,876,832.64
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,464,027.04	-587,194.40	1,876,832.64
本期利润	885,059.02	-20,576.60	864,482.42
本期基金份额交易产生的变动数	-2,073,946.42	75,119.58	-1,998,826.84
其中：基金申购款	67,400.86	-2,123.95	65,276.91
基金赎回款	-2,141,347.28	77,243.53	-2,064,103.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,275,139.64	-532,651.42	742,488.22

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	9,877,190.46	-3,030,821.31	6,846,369.15
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	9,877,190.46	-3,030,821.31	6,846,369.15
本期利润	8,156,599.79	-894,174.71	7,262,425.08
本期基金份额交易产生的变动数	-1,911,089.38	387,188.35	-1,523,901.03

其中：基金申购款	2,293,156.38	-415,784.66	1,877,371.72
基金赎回款	-4,204,245.76	802,973.01	-3,401,272.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,122,700.87	-3,537,807.67	12,584,893.20

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入		23,602.68
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		67,771.34
其他		1,895.60
合计		93,269.62

#### 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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		878,101.31
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		878,101.31

##### 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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额		915,107,857.38
减：卖出股票成本总额		913,035,811.92
减：交易费用		1,193,944.15
买卖股票差价收入		878,101.31

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

##### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	237,881.63
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-538,766.69
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	-300,885.06

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	254,582,499.79
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	253,870,516.17
减：应计利息总额	1,231,823.48
减：交易费用	18,926.83
买卖债券差价收入	-538,766.69

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

#### 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资产支持证券买卖差价收入。

##### 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无贵金属投资收益。

##### 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贵金属买卖差价收入。

##### 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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	8,801,132.40

#### 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,459,700.41
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	1,459,700.41

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-5,202,062.45
股票投资	-4,812,201.72
债券投资	-389,860.73
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-

2. 衍生工具	4,274,343.46
权证投资	-
期货投资	4,274,343.46
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	-927,718.99

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	15,912.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
合计	94,184.60

#### 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

#### 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”）	集合计划管理人的股东控制的公司

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	1,795,208,230.13	100.00	1,936,916,817.87	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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	471,002,153.50	100.00	487,800,246.34	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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	1,408,800,000.00	100.00	466,900,000.00	100.00

###### 6.4.10.1.4 权证交易

本集合计划本报告期未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 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 2024年1月1日至2024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	621,088.41	100.00	1,000,327.25	100.00



关联方名称	上年度可比期间 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

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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	979,396.77	1,453,822.44
其中：应支付销售机构的客户维护 费	478,744.62	695,593.35
应支付基金管理人的净管理费	500,652.15	758,229.09

注：不同类别份额的管理费分别计算，从相应类别份额的资产净值中扣除。

A 类份额的固定年管理费率为 1.5%

B 类、C 类份额的年管理费率为 1.0%

本集合计划的管理费计算方法如下：

$$G = E \times \text{相应类别份额的年管理费率} \div \text{当年天数}$$

G 为各类份额每日应计提的集合计划管理费

E 为各类份额前一日集合计划资产净值

集合计划管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送集合计划管理费划付指令，若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	194,656.34	289,521.67

注：本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的 0.20% 年费率计提，计算方法如下：

$$T = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

T 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	-	515.13	515.13
光证资管	-	-	1.82	1.82
合计	-	-	516.95	516.95
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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

注：本集合计划 A 类份额、B 类份额不收取销售服务费，C 类份额的销售服务费年费率为 0.40%，销售服务费按前一日 C 类份额的集合计划资产净值的 0.4% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类份额前一日集合计划资产净值

集合计划销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，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

本报告期不存在集合计划管理人运用固有资金投资本集合计划的情况。

##### 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

本报告期不存在除集合计划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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	3,664,825.51	23,602.68	2,392,899.60	58,918.03

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2024年6月30日，本集合无应付交易手续费余额。于2024年1月1日-2024年6月30日期间，本集合期间交易手续费支出16,964.14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2024年6月30日，本集合的结算备付金余额为7,554,289.78元，存出保证金余额为12,663,998.40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（2024 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
301565	中仑新材	2024年6月13日	6个月	新股流通受限	11.88	18.98	364	4,324.32	6,908.72	-
301580	爱迪特	2024年6月19日	6个月	新股流通受限	44.95	65.93	101	4,539.95	6,658.93	-

注：1、集合计划可使用以集合计划名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中集合计划参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；集合计划参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、集合计划参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

3、集合计划作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

4、集合计划通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本集合计划本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本集合计划本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### 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无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

### 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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	4,020,931.51
合计	-	4,020,931.51

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。

#### 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及上年度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及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

#### 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	2,252,798.44	4,907,633.18
AAA 以下	17,657,956.10	29,470,494.56
未评级	10,098,786.30	10,130,327.87
合计	30,009,540.84	44,508,455.61

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级中包含政策性金融债。

#### 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(2024 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 2024 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	3,664,825.51	-	-	-	3,664,825.51
结算备付金	9,359,908.58	-	-	-	9,359,908.58
存出保证金	12,914,331.78	-	-	-	12,914,331.78
交易性金融资产	10,841,737.74	17,797,864.61	1,369,938.49	117,158,671.44	147,168,212.28
买入返售金融资产	10,000,000.00	-	-	-	10,000,000.00
应收申购款	-	-	-	196,210.00	196,210.00
应收清算款	-	-	-	608,189.17	608,189.17

资产总计	46,780,803.61	17,797,864.61	1,369,938.49	117,963,070.61	183,911,677.32
负债					
应付赎回款	-	-	-	325,744.00	325,744.00
应付管理人报酬	-	-	-	150,803.51	150,803.51
应付托管费	-	-	-	29,958.83	29,958.83
应付清算款	-	-	-	453,914.48	453,914.48
应付销售服务费	-	-	-	56,393.96	56,393.96
应交税费	-	-	-	997.72	997.72
其他负债	-	-	-	1,076,086.85	1,076,086.85
负债总计	-	-	-	2,093,899.35	2,093,899.35
利率敏感度缺口	46,780,803.61	17,797,864.61	1,369,938.49	115,869,171.26	181,817,777.97
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	9,685,107.10	-	-	-	9,685,107.10
结算备付金	4,133,988.03	-	-	-	4,133,988.03
存出保证金	16,854,314.13	-	-	-	16,854,314.13
交易性金融资产	18,594,850.04	28,548,587.81	1,385,949.27	154,817,897.28	203,347,284.40
买入返售金融资产	6,000,000.00	-	-	-	6,000,000.00
应收清算款	-	-	-	229,604.88	229,604.88
资产总计	55,268,259.30	28,548,587.81	1,385,949.27	155,047,502.16	240,250,298.54
负债					
应付赎回款	-	-	-	533,973.04	533,973.04
应付管理人报酬	-	-	-	200,660.11	200,660.11
应付托管费	-	-	-	39,925.79	39,925.79
应付清算款	-	-	-	5,702,424.43	5,702,424.43
应付销售服务费	-	-	-	66,213.82	66,213.82
应交税费	-	-	-	1,359.47	1,359.47
其他负债	-	-	-	530,940.22	530,940.22
负债总计	-	-	-	7,075,496.88	7,075,496.88
利率敏感度缺口	55,268,259.30	28,548,587.81	1,385,949.27	147,972,005.28	233,174,801.66

注：表中所示为本集合计划资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个	23,626.11	17,634.34



	基点		
	市场利率上升 25 个基点	-23,626.11	-17,634.34

#### 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 2024年6月30日		上年度末 2023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	117,158,671.44	64.44	154,817,897.28	66.40
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	117,158,671.44	64.44	154,817,897.28	66.40

## 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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	7,109,847.09	6,312,545.71
沪深 300 指数下降 5%	-7,109,847.09	-6,312,545.71	

## 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	136,149,662.30	188,298,334.70
第二层次	11,004,982.33	14,951,477.71
第三层次	13,567.65	97,471.99
合计	147,168,212.28	203,347,284.40

## 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。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，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股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本集合计划未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本集合计划无需要说明的其他重要事项。

## § 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	117,158,671.44	63.70
	其中：股票	117,158,671.44	63.70
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	30,009,540.84	16.32
	其中：债券	30,009,540.84	16.32
	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	10,000,000.00	5.44
	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	13,024,734.09	7.08
8	其他各项资产	13,718,730.95	7.46
9	合计	183,911,677.32	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	845,968.00	0.47
B	采矿业	5,091,819.53	2.80
C	制造业	74,813,813.01	41.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,301,348.00	2.37
E	建筑业	2,992,714.00	1.65
F	批发和零售业	2,342,147.90	1.29
G	交通运输、仓储和邮政业	3,824,732.60	2.10
H	住宿和餐饮业	87,685.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,003,647.10	2.20
J	金融业	14,287,622.47	7.86
K	房地产业	923,658.00	0.51
L	租赁和商务服务业	1,544,317.00	0.85
M	科学研究和技术服务业	183,638.00	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	936,796.00	0.52
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	107,443.43	0.06
R	文化、体育和娱乐业	610,825.40	0.34
S	综合	260,496.00	0.14
	合计	117,158,671.44	64.44

### 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	600519	贵州茅台	1,819	2,669,182.41	1.47
2	601166	兴业银行	127,100	2,239,502.00	1.23
3	300750	宁德时代	9,089	1,636,292.67	0.90
4	601318	中国平安	37,726	1,560,347.36	0.86
5	601618	中国中冶	501,600	1,554,960.00	0.86
6	601658	邮储银行	252,700	1,281,189.00	0.70
7	000333	美的集团	17,600	1,135,200.00	0.62
8	601919	中远海控	70,700	1,095,143.00	0.60
9	600188	兖矿能源	44,100	1,002,393.00	0.55
10	600036	招商银行	27,309	933,694.71	0.51
11	601328	交通银行	102,800	767,916.00	0.42
12	300760	迈瑞医疗	2,600	756,366.00	0.42
13	002215	诺普信	92,900	692,105.00	0.38

14	600660	福耀玻璃	13,900	665,810.00	0.37
15	002340	格林美	102,200	651,014.00	0.36
16	600926	杭州银行	48,900	638,145.00	0.35
17	601717	郑煤机	43,100	637,880.00	0.35
18	002745	木林森	78,900	635,934.00	0.35
19	600900	长江电力	21,700	627,564.00	0.35
20	600183	生益科技	29,700	625,482.00	0.34
21	600309	万华化学	7,600	614,536.00	0.34
22	300408	三环集团	20,600	601,314.00	0.33
23	601668	中国建筑	111,600	592,596.00	0.33
24	600938	中国海油	17,900	590,700.00	0.32
25	000786	北新建材	19,300	572,438.00	0.31
26	600276	恒瑞医药	14,300	549,978.00	0.30
27	002984	森麒麟	22,800	549,252.00	0.30
28	600887	伊利股份	21,200	547,808.00	0.30
29	300308	中际旭创	3,900	537,732.00	0.30
30	300638	广和通	30,600	523,260.00	0.29
31	000651	格力电器	13,300	521,626.00	0.29
32	601225	陕西煤业	19,800	510,246.00	0.28
33	601916	浙商银行	178,900	493,764.00	0.27
34	601600	中国铝业	64,700	493,661.00	0.27
35	000600	建投能源	77,900	490,770.00	0.27
36	601899	紫金矿业	27,629	485,441.53	0.27
37	002534	西子洁能	48,100	481,481.00	0.26
38	603993	洛阳钼业	56,300	478,550.00	0.26
39	000338	潍柴动力	28,700	466,088.00	0.26
40	002519	银河电子	90,800	445,828.00	0.25
41	000625	长安汽车	32,700	439,161.00	0.24
42	603501	韦尔股份	4,400	437,228.00	0.24
43	600016	民生银行	114,200	432,818.00	0.24
44	600019	宝钢股份	64,000	425,600.00	0.23
45	300433	蓝思科技	23,200	423,400.00	0.23
46	300953	震裕科技	7,800	422,760.00	0.23
47	601872	招商轮船	48,400	408,980.00	0.22
48	000001	平安银行	39,400	399,910.00	0.22
49	000858	五粮液	3,100	396,924.00	0.22
50	300415	伊之密	18,900	392,742.00	0.22
51	600011	华能国际	40,700	391,534.00	0.22
52	000063	中兴通讯	13,900	388,783.00	0.21
53	688981	中芯国际	8,400	387,240.00	0.21
54	002906	华阳集团	14,400	385,344.00	0.21
55	000900	现代投资	104,600	382,836.00	0.21
56	002601	龙佰集团	20,300	376,971.00	0.21

57	600690	海尔智家	13,100	371,778.00	0.20
58	603733	仙鹤股份	21,100	370,938.00	0.20
59	002475	立讯精密	9,400	369,514.00	0.20
60	300821	东岳硅材	54,000	369,360.00	0.20
61	601816	京沪高铁	68,600	368,382.00	0.20
62	300274	阳光电源	5,860	363,495.80	0.20
63	002635	安洁科技	23,400	361,296.00	0.20
64	002441	众业达	46,900	355,502.00	0.20
65	600027	华电国际	51,000	353,940.00	0.19
66	000990	诚志股份	47,200	351,168.00	0.19
67	601601	中国太保	12,500	348,250.00	0.19
68	603195	公牛集团	4,515	348,196.80	0.19
69	002938	鹏鼎控股	8,700	345,912.00	0.19
70	600919	江苏银行	46,000	341,780.00	0.19
71	000703	恒逸石化	48,100	341,029.00	0.19
72	601969	海南矿业	53,200	337,288.00	0.19
73	001338	永顺泰	34,400	337,120.00	0.19
74	600050	中国联通	71,500	336,050.00	0.18
75	002142	宁波银行	14,800	326,488.00	0.18
76	600989	宝丰能源	18,800	325,804.00	0.18
77	002594	比亚迪	1,300	325,325.00	0.18
78	601319	中国人保	63,000	324,450.00	0.18
79	600089	特变电工	23,300	323,171.00	0.18
80	002701	奥瑞金	77,500	322,400.00	0.18
81	600600	青岛啤酒	4,400	320,188.00	0.18
82	000035	中国天楹	70,500	319,365.00	0.18
83	002550	千红制药	58,900	317,471.00	0.17
84	603629	利通电子	16,900	311,974.00	0.17
85	000735	罗牛山	71,700	310,461.00	0.17
86	300979	华利集团	5,100	310,335.00	0.17
87	300628	亿联网络	8,420	309,603.40	0.17
88	600000	浦发银行	37,600	309,448.00	0.17
89	000758	中色股份	60,800	308,864.00	0.17
90	002252	上海莱士	38,600	301,852.00	0.17
91	002152	广电运通	28,800	301,248.00	0.17
92	300973	立高食品	10,700	300,563.00	0.17
93	600219	南山铝业	78,200	297,942.00	0.16
94	002078	太阳纸业	21,300	297,135.00	0.16
95	688188	柏楚电子	1,600	295,280.00	0.16
96	600267	海正药业	40,800	286,416.00	0.16
97	300679	电连技术	7,100	285,633.00	0.16
98	600104	上汽集团	20,400	282,744.00	0.16
99	600598	北大荒	22,600	282,274.00	0.16

100	301015	百洋医药	11,900	280,007.00	0.15
101	601865	福莱特	13,900	279,390.00	0.15
102	603299	苏盐井神	29,400	279,300.00	0.15
103	601688	华泰证券	22,400	277,536.00	0.15
104	600662	外服控股	69,200	277,492.00	0.15
105	000725	京东方A	67,800	277,302.00	0.15
106	002646	天佑德酒	27,100	277,233.00	0.15
107	002008	大族激光	13,300	276,640.00	0.15
108	688408	中信博	3,000	276,240.00	0.15
109	002053	云南能投	22,700	274,443.00	0.15
110	600663	陆家嘴	31,100	274,302.00	0.15
111	301301	川宁生物	21,400	273,492.00	0.15
112	605333	沪光股份	9,800	272,930.00	0.15
113	002557	洽洽食品	9,600	270,624.00	0.15
114	002950	奥美医疗	40,900	269,940.00	0.15
115	603606	东方电缆	5,500	268,455.00	0.15
116	002007	华兰生物	16,900	266,851.00	0.15
117	000517	荣安地产	99,500	266,660.00	0.15
118	601138	工业富联	9,700	265,780.00	0.15
119	300837	浙矿股份	12,600	261,576.00	0.14
120	002661	克明食品	35,000	261,450.00	0.14
121	001207	联科科技	18,000	261,360.00	0.14
122	000532	华金资本	21,600	260,496.00	0.14
123	000933	神火股份	12,600	254,898.00	0.14
124	002648	卫星化学	14,100	253,518.00	0.14
125	300502	新易盛	2,400	253,320.00	0.14
126	300005	探路者	50,300	252,003.00	0.14
127	002204	大连重工	58,600	250,222.00	0.14
128	002273	水晶光电	14,700	249,606.00	0.14
129	002286	保龄宝	45,200	249,052.00	0.14
130	000513	丽珠集团	6,600	245,586.00	0.14
131	000301	东方盛虹	30,700	244,679.00	0.13
132	601888	中国中免	3,900	243,711.00	0.13
133	600415	小商品城	32,400	240,408.00	0.13
134	603348	文灿股份	8,600	238,134.00	0.13
135	688036	传音控股	3,100	237,274.00	0.13
136	600803	新奥股份	11,300	235,040.00	0.13
137	601398	工商银行	41,000	233,700.00	0.13
138	601375	中原证券	68,000	231,880.00	0.13
139	002423	中粮资本	30,600	229,194.00	0.13
140	000999	华润三九	5,350	227,803.00	0.13
141	300856	科思股份	7,100	227,271.00	0.12
142	002832	比音勒芬	9,400	227,198.00	0.12

143	688012	中微公司	1,600	226,016.00	0.12
144	600285	羚锐制药	9,100	220,311.00	0.12
145	300307	慈星股份	36,400	216,580.00	0.12
146	601898	中煤能源	17,100	213,408.00	0.12
147	600861	北京人力	13,000	212,160.00	0.12
148	002311	海大集团	4,500	211,725.00	0.12
149	603786	科博达	3,300	211,695.00	0.12
150	002282	博深股份	33,100	211,509.00	0.12
151	300190	维尔利	76,700	210,925.00	0.12
152	002062	宏润建设	60,400	210,192.00	0.12
153	600176	中国巨石	19,000	209,950.00	0.12
154	300673	佩蒂股份	16,000	209,920.00	0.12
155	600612	老凤祥	3,600	209,484.00	0.12
156	603676	卫信康	26,000	208,260.00	0.11
157	600030	中信证券	11,400	207,822.00	0.11
158	600038	中直股份	5,000	205,550.00	0.11
159	601877	正泰电器	10,600	202,036.00	0.11
160	601901	方正证券	26,100	201,753.00	0.11
161	600299	安迪苏	20,500	198,850.00	0.11
162	603658	安图生物	4,300	198,101.00	0.11
163	300379	东方通	24,500	197,960.00	0.11
164	601633	长城汽车	7,800	197,340.00	0.11
165	002154	报喜鸟	36,000	195,840.00	0.11
166	603156	养元饮品	9,100	193,557.00	0.11
167	300122	智飞生物	6,900	193,407.00	0.11
168	600694	大商股份	11,490	193,146.90	0.11
169	600866	星湖科技	34,800	192,096.00	0.11
170	002128	电投能源	9,100	192,010.00	0.11
171	300577	开润股份	9,200	191,636.00	0.11
172	300014	亿纬锂能	4,800	191,616.00	0.11
173	300160	秀强股份	40,900	191,412.00	0.11
174	600061	国投资本	33,700	190,405.00	0.10
175	002025	航天电器	4,100	190,158.00	0.10
176	601702	华峰铝业	10,400	189,904.00	0.10
177	600886	国投电力	10,400	189,696.00	0.10
178	600724	宁波富达	52,100	189,123.00	0.10
179	601500	通用股份	35,400	189,036.00	0.10
180	600489	中金黄金	12,700	187,960.00	0.10
181	603096	新经典	11,100	187,590.00	0.10
182	300434	金石亚药	25,000	187,500.00	0.10
183	002241	歌尔股份	9,600	187,296.00	0.10
184	000963	华东医药	6,700	186,327.00	0.10
185	000650	仁和药业	31,400	185,260.00	0.10



186	002782	可立克	16,700	185,036.00	0.10
187	003006	百亚股份	7,800	184,860.00	0.10
188	002801	微光股份	9,700	183,912.00	0.10
189	300226	上海钢联	10,800	182,952.00	0.10
190	603530	神马电力	6,900	182,781.00	0.10
191	000559	万向钱潮	40,900	182,414.00	0.10
192	300677	英科医疗	6,800	182,308.00	0.10
193	688111	金山办公	800	182,000.00	0.10
194	002019	亿帆医药	14,700	181,692.00	0.10
195	000788	北大医药	36,400	181,636.00	0.10
196	000795	英洛华	32,500	180,050.00	0.10
197	600585	海螺水泥	7,600	179,284.00	0.10
198	300737	科顺股份	41,300	177,590.00	0.10
199	600642	申能股份	20,000	176,600.00	0.10
200	600315	上海家化	9,900	176,022.00	0.10
201	002556	辉隆股份	41,900	174,723.00	0.10
202	000997	新大陆	12,500	173,875.00	0.10
203	000800	一汽解放	22,200	173,826.00	0.10
204	002249	大洋电机	36,700	173,591.00	0.10
205	002722	物产金轮	15,300	172,890.00	0.10
206	600420	国药现代	16,100	171,948.00	0.09
207	000582	北部湾港	22,700	168,888.00	0.09
208	688041	海光信息	2,400	168,768.00	0.09
209	601838	成都银行	11,100	168,609.00	0.09
210	300775	三角防务	5,500	168,300.00	0.09
211	000848	承德露露	21,400	168,204.00	0.09
212	600400	红豆股份	77,500	168,175.00	0.09
213	601336	新华保险	5,600	168,168.00	0.09
214	002020	京新药业	16,000	167,520.00	0.09
215	300303	聚飞光电	34,400	167,184.00	0.09
216	600028	中国石化	26,400	166,848.00	0.09
217	002004	华邦健康	43,800	166,440.00	0.09
218	000408	藏格矿业	6,900	166,083.00	0.09
219	600436	片仔癀	800	165,736.00	0.09
220	600515	海南机场	52,600	165,164.00	0.09
221	002139	拓邦股份	15,400	163,548.00	0.09
222	600125	铁龙物流	27,300	162,981.00	0.09
223	300170	汉得信息	26,500	162,710.00	0.09
224	001872	招商港口	8,400	161,700.00	0.09
225	300034	钢研高纳	10,100	160,489.00	0.09
226	601169	北京银行	27,400	160,016.00	0.09
227	000729	燕京啤酒	18,100	159,823.00	0.09
228	601801	皖新传媒	23,000	159,390.00	0.09

229	300463	迈克生物	14,000	159,320.00	0.09
230	600776	东方通信	16,200	159,246.00	0.09
231	002583	海能达	39,000	158,730.00	0.09
232	300707	威唐工业	12,800	158,464.00	0.09
233	002140	东华科技	20,400	158,100.00	0.09
234	002274	华昌化工	21,300	158,046.00	0.09
235	300767	震安科技	18,600	157,728.00	0.09
236	002537	海联金汇	30,400	157,168.00	0.09
237	002913	奥士康	5,800	155,498.00	0.09
238	002267	陕天然气	20,500	154,980.00	0.09
239	000550	江铃汽车	7,100	154,141.00	0.08
240	002489	浙江永强	64,500	152,865.00	0.08
241	000557	西部创业	40,500	152,280.00	0.08
242	000157	中联重科	19,800	152,064.00	0.08
243	002106	莱宝高科	13,900	151,510.00	0.08
244	601881	中国银河	13,900	150,954.00	0.08
245	301020	密封科技	9,500	150,290.00	0.08
246	300115	长盈精密	12,500	149,875.00	0.08
247	000030	富奥股份	30,500	149,755.00	0.08
248	300866	安克创新	2,100	149,541.00	0.08
249	002990	盛视科技	7,400	148,962.00	0.08
250	002027	分众传媒	24,500	148,470.00	0.08
251	301003	江苏博云	6,900	148,419.00	0.08
252	600903	贵州燃气	23,700	147,888.00	0.08
253	002799	环球印务	25,100	147,588.00	0.08
254	300687	赛意信息	10,600	147,552.00	0.08
255	001965	招商公路	12,400	147,064.00	0.08
256	600346	恒力石化	10,500	146,475.00	0.08
257	300627	华测导航	4,900	146,265.00	0.08
258	600132	重庆啤酒	2,400	145,680.00	0.08
259	600787	中储股份	30,200	145,262.00	0.08
260	603368	柳药集团	8,300	145,250.00	0.08
261	300969	恒帅股份	2,100	145,173.00	0.08
262	600547	山东黄金	5,300	145,114.00	0.08
263	601390	中国中铁	22,200	144,744.00	0.08
264	000568	泸州老窖	1,002	143,776.98	0.08
265	601700	风范股份	32,500	142,675.00	0.08
266	301262	海看股份	6,300	142,065.00	0.08
267	300441	鲍斯股份	23,800	141,134.00	0.08
268	000897	津滨发展	68,300	140,015.00	0.08
269	603328	依顿电子	17,600	138,336.00	0.08
270	000977	浪潮信息	3,800	138,206.00	0.08
271	603277	银都股份	4,600	138,184.00	0.08

272	603806	福斯特	9,180	134,946.00	0.07
273	601799	星宇股份	1,200	134,448.00	0.07
274	603986	兆易创新	1,400	133,868.00	0.07
275	601236	红塔证券	20,800	133,536.00	0.07
276	300002	神州泰岳	16,400	133,168.00	0.07
277	002242	九阳股份	12,700	133,096.00	0.07
278	601991	大唐发电	43,900	132,139.00	0.07
279	600332	白云山	4,500	131,985.00	0.07
280	600066	宇通客车	5,100	131,580.00	0.07
281	600933	爱柯迪	8,800	130,152.00	0.07
282	688009	中国通号	21,600	129,600.00	0.07
283	605499	东鹏饮料	600	129,450.00	0.07
284	300296	利亚德	28,700	129,150.00	0.07
285	300017	网宿科技	16,200	127,980.00	0.07
286	002422	科伦药业	4,200	127,386.00	0.07
287	001218	丽臣实业	8,500	127,245.00	0.07
288	300682	朗新集团	14,800	125,948.00	0.07
289	002979	雷赛智能	6,900	125,580.00	0.07
290	601377	兴业证券	24,700	124,982.00	0.07
291	002625	光启技术	7,200	124,920.00	0.07
292	603025	大豪科技	8,900	122,998.00	0.07
293	002573	清新环境	31,700	122,679.00	0.07
294	002429	兆驰股份	25,500	122,655.00	0.07
295	600529	山东药玻	4,800	121,632.00	0.07
296	000807	云铝股份	9,000	121,590.00	0.07
297	688777	中控技术	3,200	120,640.00	0.07
298	600905	三峡能源	27,600	120,336.00	0.07
299	002835	同为股份	7,100	119,919.00	0.07
300	002532	天山铝业	14,700	119,217.00	0.07
301	600398	海澜之家	12,900	119,196.00	0.07
302	603345	安井食品	1,600	118,896.00	0.07
303	603707	健友股份	10,000	118,800.00	0.07
304	002966	苏州银行	15,800	118,500.00	0.07
305	002191	劲嘉股份	32,800	118,408.00	0.07
306	600741	华域汽车	7,200	117,936.00	0.06
307	300872	天阳科技	8,900	117,925.00	0.06
308	688278	特宝生物	2,200	117,810.00	0.06
309	002563	森马服饰	20,100	116,781.00	0.06
310	000828	东莞控股	12,900	116,229.00	0.06
311	605369	拱东医疗	2,900	115,710.00	0.06
312	300136	信维通信	5,800	113,564.00	0.06
313	000921	海信家电	3,500	112,840.00	0.06
314	300003	乐普医疗	7,600	112,784.00	0.06

315	300144	宋城演艺	13,980	112,259.40	0.06
316	600497	驰宏锌锗	21,000	112,140.00	0.06
317	002893	京能热力	11,800	111,628.00	0.06
318	300587	天铁股份	27,600	111,504.00	0.06
319	003019	宸展光电	4,400	111,452.00	0.06
320	000544	中原环保	14,100	110,967.00	0.06
321	601088	中国神华	2,500	110,925.00	0.06
322	002972	科安达	12,100	110,836.00	0.06
323	300790	宇瞳光学	8,200	110,700.00	0.06
324	600351	亚宝药业	19,700	110,517.00	0.06
325	002774	快意电梯	17,400	110,490.00	0.06
326	300881	盛德鑫泰	4,300	110,467.00	0.06
327	603165	荣晟环保	10,400	110,448.00	0.06
328	002083	孚日股份	26,100	110,403.00	0.06
329	002969	嘉美包装	38,700	110,295.00	0.06
330	000551	创元科技	12,600	109,998.00	0.06
331	603980	吉华集团	29,400	109,956.00	0.06
332	002697	红旗连锁	23,700	109,731.00	0.06
333	300879	大叶股份	8,200	109,716.00	0.06
334	605018	长华集团	12,100	109,626.00	0.06
335	300194	福安药业	29,300	109,582.00	0.06
336	002454	松芝股份	19,600	109,564.00	0.06
337	600784	鲁银投资	23,100	109,494.00	0.06
338	002763	汇洁股份	16,500	109,395.00	0.06
339	000639	西王食品	45,900	109,242.00	0.06
340	605166	聚合顺	10,400	109,096.00	0.06
341	002365	永安药业	15,100	109,022.00	0.06
342	301116	益客食品	12,200	108,946.00	0.06
343	301077	星华新材	6,100	108,946.00	0.06
344	301222	浙江恒威	4,400	108,944.00	0.06
345	002752	昇兴股份	21,500	108,790.00	0.06
346	600488	津药药业	31,700	108,731.00	0.06
347	688187	时代电气	2,200	108,636.00	0.06
348	603239	浙江仙通	7,900	108,309.00	0.06
349	603579	荣泰健康	7,000	108,220.00	0.06
350	002303	美盈森	44,900	108,209.00	0.06
351	300382	斯莱克	18,300	108,153.00	0.06
352	300915	海融科技	4,100	107,174.00	0.06
353	002050	三花智控	5,600	106,848.00	0.06
354	600963	岳阳林纸	28,800	105,696.00	0.06
355	603379	三美股份	2,700	105,678.00	0.06
356	301267	华夏眼科	5,100	105,672.00	0.06
357	300442	润泽科技	4,400	105,380.00	0.06

358	000960	锡业股份	6,800	105,332.00	0.06
359	600863	内蒙华电	22,700	105,328.00	0.06
360	600862	中航高科	5,600	105,168.00	0.06
361	002294	信立泰	3,900	103,857.00	0.06
362	601186	中国铁建	12,100	103,697.00	0.06
363	001323	慕思股份	3,600	103,572.00	0.06
364	603567	珍宝岛	9,800	103,194.00	0.06
365	002595	豪迈科技	2,700	103,059.00	0.06
366	300037	新宙邦	3,600	102,816.00	0.06
367	000543	皖能电力	11,600	102,660.00	0.06
368	000875	吉电股份	19,200	102,336.00	0.06
369	688363	华熙生物	1,800	101,826.00	0.06
370	002064	华峰化学	14,200	101,814.00	0.06
371	300957	贝泰妮	2,100	101,472.00	0.06
372	301102	兆讯传媒	8,600	101,394.00	0.06
373	600426	华鲁恒升	3,800	101,232.00	0.06
374	600153	建发股份	11,300	100,909.00	0.06
375	605319	无锡振华	5,700	100,890.00	0.06
376	000425	徐工机械	14,100	100,815.00	0.06
377	002823	凯中精密	8,200	100,040.00	0.06
378	002266	浙富控股	35,500	99,045.00	0.05
379	002891	中宠股份	4,700	98,089.00	0.05
380	601156	东航物流	4,800	97,680.00	0.05
381	000895	双汇发展	4,100	97,457.00	0.05
382	600827	XD 百联股	13,000	95,940.00	0.05
383	600535	天士力	7,600	95,608.00	0.05
384	601288	农业银行	21,900	95,484.00	0.05
385	600580	卧龙电驱	7,800	94,770.00	0.05
386	603568	伟明环保	4,600	94,668.00	0.05
387	688223	晶科能源	13,300	94,430.00	0.05
388	603766	隆鑫通用	13,900	94,242.00	0.05
389	000750	国海证券	32,300	93,993.00	0.05
390	603317	天味食品	8,200	93,562.00	0.05
391	603225	新风鸣	6,000	93,540.00	0.05
392	002011	盾安环境	9,500	93,385.00	0.05
393	002939	长城证券	13,900	93,130.00	0.05
394	300120	经纬辉开	17,900	92,901.00	0.05
395	601636	旗滨集团	14,400	92,880.00	0.05
396	300390	天华新能	5,400	92,772.00	0.05
397	301155	海力风电	2,300	92,529.00	0.05
398	002368	太极股份	4,100	92,455.00	0.05
399	001286	陕西能源	8,000	92,240.00	0.05
400	600707	彩虹股份	13,500	91,935.00	0.05

401	301219	腾远钴业	2,400	91,824.00	0.05
402	300685	艾德生物	5,200	91,728.00	0.05
403	601311	骆驼股份	11,400	91,428.00	0.05
404	300841	康华生物	1,800	91,152.00	0.05
405	600586	金晶科技	15,700	91,060.00	0.05
406	603517	绝味食品	5,900	90,860.00	0.05
407	600416	湘电股份	9,100	90,454.00	0.05
408	300476	胜宏科技	2,800	90,328.00	0.05
409	002402	和而泰	8,400	89,964.00	0.05
410	601168	西部矿业	5,000	89,750.00	0.05
411	300596	利安隆	3,300	89,529.00	0.05
412	603858	步长制药	5,900	89,385.00	0.05
413	300039	上海凯宝	16,700	89,345.00	0.05
414	688578	艾力斯	1,400	89,236.00	0.05
415	300428	立中集团	4,800	89,232.00	0.05
416	002498	汉缆股份	27,100	89,159.00	0.05
417	603883	老百姓	4,850	89,046.00	0.05
418	601975	招商南油	24,800	89,032.00	0.05
419	600458	时代新材	8,800	88,880.00	0.05
420	002985	北摩高科	4,000	88,120.00	0.05
421	300233	金城医药	5,900	88,028.00	0.05
422	002349	精华制药	13,400	87,904.00	0.05
423	600354	敦煌种业	18,400	87,768.00	0.05
424	600258	首旅酒店	7,100	87,685.00	0.05
425	300832	新产业	1,300	87,672.00	0.05
426	600517	国网英大	20,200	87,466.00	0.05
427	300119	瑞普生物	6,400	87,168.00	0.05
428	000987	越秀资本	17,500	86,800.00	0.05
429	600359	新农开发	15,500	86,645.00	0.05
430	600196	复星医药	3,900	86,346.00	0.05
431	600643	爱建集团	22,900	86,333.00	0.05
432	603187	海容冷链	7,400	86,284.00	0.05
433	002283	天润工业	20,100	86,229.00	0.05
434	300888	稳健医疗	3,400	86,020.00	0.05
435	600941	中国移动	800	86,000.00	0.05
436	002034	旺能环境	6,600	85,866.00	0.05
437	603995	甬金股份	4,900	85,848.00	0.05
438	600967	内蒙一机	11,800	84,960.00	0.05
439	603693	江苏新能	7,300	84,826.00	0.05
440	002135	东南网架	21,400	84,744.00	0.05
441	600761	安徽合力	3,900	84,396.00	0.05
442	000785	居然之家	34,700	84,321.00	0.05
443	000156	华数传媒	13,400	84,152.00	0.05

444	601568	北元集团	22,600	83,846.00	0.05
445	000988	华工科技	2,800	83,804.00	0.05
446	002651	利君股份	15,200	83,448.00	0.05
447	300755	华致酒行	6,100	83,326.00	0.05
448	603983	丸美股份	3,000	82,590.00	0.05
449	300770	新媒股份	2,400	80,112.00	0.04
450	688779	长远锂科	17,300	80,099.00	0.04
451	301177	迪阿股份	4,300	79,980.00	0.04
452	603056	德邦股份	6,100	79,910.00	0.04
453	603393	新天然气	2,300	79,902.00	0.04
454	600549	厦门钨业	4,600	79,350.00	0.04
455	600015	华夏银行	12,381	79,238.40	0.04
456	300059	东方财富	7,500	79,200.00	0.04
457	603305	旭升集团	7,500	79,200.00	0.04
458	300634	彩讯股份	4,700	79,101.00	0.04
459	003012	东鹏控股	12,900	78,819.00	0.04
460	600750	江中药业	3,400	78,574.00	0.04
461	603369	今世缘	1,700	78,540.00	0.04
462	600821	金开新能	15,200	78,128.00	0.04
463	002968	新大正	8,700	77,517.00	0.04
464	600993	马应龙	2,900	77,343.00	0.04
465	603296	华勤技术	1,400	77,322.00	0.04
466	600667	太极实业	13,500	77,085.00	0.04
467	301580	爱迪特	1,006	76,524.93	0.04
468	600999	招商证券	5,500	76,505.00	0.04
469	301028	东亚机械	8,700	76,299.00	0.04
470	300263	隆华科技	13,600	76,160.00	0.04
471	002866	传艺科技	5,900	75,933.00	0.04
472	300768	迪普科技	6,400	75,840.00	0.04
473	603979	金诚信	1,500	75,795.00	0.04
474	300482	万孚生物	3,100	75,640.00	0.04
475	600966	博汇纸业	15,800	75,524.00	0.04
476	688127	蓝特光学	4,100	75,399.00	0.04
477	000012	南玻A	14,900	75,096.00	0.04
478	600459	贵研铂业	5,500	74,305.00	0.04
479	601886	江河集团	15,100	73,688.00	0.04
480	600928	西安银行	22,500	73,575.00	0.04
481	002465	海格通信	7,000	72,520.00	0.04
482	000821	京山轻机	6,400	72,512.00	0.04
483	600252	中恒集团	33,300	72,261.00	0.04
484	002436	兴森科技	7,000	72,240.00	0.04
485	603899	晨光股份	2,300	71,944.00	0.04
486	601615	明阳智能	7,600	71,744.00	0.04

487	002444	巨星科技	2,900	71,630.00	0.04
488	002993	奥海科技	1,900	70,680.00	0.04
489	603699	纽威股份	4,100	70,192.00	0.04
490	000966	长源电力	15,900	70,119.00	0.04
491	300783	三只松鼠	3,200	69,984.00	0.04
492	600623	华谊集团	12,100	69,938.00	0.04
493	000887	中鼎股份	5,700	69,768.00	0.04
494	301071	力量钻石	2,500	69,275.00	0.04
495	002262	恩华药业	2,900	68,846.00	0.04
496	002850	科达利	900	68,742.00	0.04
497	000034	神州数码	3,000	68,670.00	0.04
498	688016	心脉医疗	700	68,635.00	0.04
499	300073	当升科技	2,000	68,620.00	0.04
500	688389	普门科技	4,200	68,292.00	0.04
501	002245	蔚蓝锂芯	8,800	68,200.00	0.04
502	688213	思特威	1,400	67,900.00	0.04
503	603919	金徽酒	3,700	67,229.00	0.04
504	300699	光威复材	2,700	67,041.00	0.04
505	600335	国机汽车	11,600	66,932.00	0.04
506	002991	甘源食品	1,100	66,715.00	0.04
507	300058	蓝色光标	12,200	66,368.00	0.04
508	600073	光明肉业	12,000	66,120.00	0.04
509	002932	明德生物	3,900	65,559.00	0.04
510	603229	奥翔药业	6,480	65,124.00	0.04
511	002415	海康威视	2,100	64,911.00	0.04
512	600004	白云机场	6,800	64,464.00	0.04
513	600867	通化东宝	7,700	64,449.00	0.04
514	600498	烽火通信	4,000	63,600.00	0.03
515	002056	横店东磁	5,000	62,350.00	0.03
516	600995	南网储能	6,400	61,824.00	0.03
517	002372	伟星新材	4,000	61,680.00	0.03
518	002624	完美世界	8,100	61,560.00	0.03
519	002831	裕同科技	2,400	61,416.00	0.03
520	002299	圣农发展	4,500	61,380.00	0.03
521	300748	金力永磁	4,700	60,912.00	0.03
522	002080	中材科技	4,700	60,630.00	0.03
523	600801	华新水泥	4,400	60,500.00	0.03
524	301171	易点天下	4,100	60,270.00	0.03
525	000636	风华高科	4,600	60,076.00	0.03
526	002268	电科网安	4,200	59,766.00	0.03
527	688007	光峰科技	3,700	59,570.00	0.03
528	601928	凤凰传媒	5,400	59,184.00	0.03
529	603871	嘉友国际	3,340	59,084.60	0.03



530	601689	拓普集团	1,100	58,971.00	0.03
531	300031	宝通科技	4,100	58,917.00	0.03
532	002127	南极电商	22,400	58,240.00	0.03
533	600284	浦东建设	10,800	57,672.00	0.03
534	601965	中国汽研	3,400	57,426.00	0.03
535	601609	金田股份	10,100	57,166.00	0.03
536	300409	道氏技术	6,500	55,640.00	0.03
537	603218	日月股份	5,400	55,458.00	0.03
538	000682	东方电子	5,000	55,200.00	0.03
539	601808	中海油服	3,200	55,040.00	0.03
540	688819	天能股份	2,300	54,878.00	0.03
541	688271	联影医疗	500	54,850.00	0.03
542	003022	联泓新科	4,000	54,840.00	0.03
543	688349	三一重能	2,200	54,648.00	0.03
544	003816	中国广核	11,800	54,634.00	0.03
545	000739	普洛药业	4,000	54,280.00	0.03
546	002768	国恩股份	2,900	54,230.00	0.03
547	002741	光华科技	6,000	53,880.00	0.03
548	601126	四方股份	2,800	53,816.00	0.03
549	600018	上港集团	9,300	53,754.00	0.03
550	002838	道恩股份	5,900	53,454.00	0.03
551	601939	建设银行	7,200	53,280.00	0.03
552	688778	厦钨新能	1,700	53,108.00	0.03
553	000708	中信特钢	3,900	52,923.00	0.03
554	300919	中伟股份	1,700	52,683.00	0.03
555	688006	杭可科技	3,000	52,350.00	0.03
556	002736	国信证券	6,000	52,140.00	0.03
557	600362	江西铜业	2,200	52,096.00	0.03
558	601066	中信建投	2,700	51,948.00	0.03
559	600438	通威股份	2,700	51,597.00	0.03
560	600918	中泰证券	9,100	51,597.00	0.03
561	688008	澜起科技	900	51,444.00	0.03
562	300124	汇川技术	1,000	51,300.00	0.03
563	000538	云南白药	1,000	51,150.00	0.03
564	300661	圣邦股份	600	49,668.00	0.03
565	688029	南微医学	800	49,248.00	0.03
566	600211	西藏药业	1,500	48,870.00	0.03
567	002304	洋河股份	600	48,444.00	0.03
568	300705	九典制药	1,800	48,132.00	0.03
569	603881	数据港	3,780	48,043.80	0.03
570	600572	康恩贝	10,700	47,829.00	0.03
571	688475	萤石网络	1,400	47,754.00	0.03
572	600406	国电南瑞	1,900	47,424.00	0.03

573	300207	欣旺达	3,100	47,027.00	0.03
574	600710	苏美达	5,600	45,640.00	0.03
575	603583	捷昌驱动	2,200	44,836.00	0.02
576	600197	伊力特	2,400	42,744.00	0.02
577	688510	航亚科技	2,300	42,343.00	0.02
578	600810	神马股份	6,800	42,160.00	0.02
579	688733	壹石通	2,800	41,860.00	0.02
580	002533	金杯电工	4,200	41,790.00	0.02
581	300383	光环新网	4,900	41,405.00	0.02
582	301117	佳缘科技	1,600	41,280.00	0.02
583	002296	辉煌科技	4,000	41,240.00	0.02
584	600062	华润双鹤	2,100	41,118.00	0.02
585	600160	巨化股份	1,700	41,021.00	0.02
586	000728	国元证券	6,700	40,602.00	0.02
587	300291	百纳千成	9,500	40,470.00	0.02
588	002315	焦点科技	1,500	40,440.00	0.02
589	002884	凌霄泵业	2,100	40,320.00	0.02
590	300049	福瑞股份	800	40,272.00	0.02
591	300512	中亚股份	6,800	40,256.00	0.02
592	002463	沪电股份	1,100	40,150.00	0.02
593	300016	北陆药业	9,100	40,131.00	0.02
594	002032	苏泊尔	800	40,080.00	0.02
595	300987	川网传媒	3,300	40,062.00	0.02
596	001228	永泰运	1,900	40,052.00	0.02
597	603909	建发合诚	4,800	39,936.00	0.02
598	300485	赛升药业	6,500	39,910.00	0.02
599	600609	金杯汽车	11,500	39,905.00	0.02
600	688089	嘉必优	3,000	39,720.00	0.02
601	300550	和仁科技	4,200	39,690.00	0.02
602	300453	三鑫医疗	6,200	39,618.00	0.02
603	300196	长海股份	3,900	39,507.00	0.02
604	603337	杰克股份	1,500	39,480.00	0.02
605	600864	哈投股份	8,300	39,425.00	0.02
606	301206	三元生物	1,600	39,328.00	0.02
607	600480	凌云股份	4,000	39,320.00	0.02
608	300867	圣元环保	3,700	39,257.00	0.02
609	603496	恒为科技	1,600	39,120.00	0.02
610	688071	华依科技	1,800	39,006.00	0.02
611	300978	东箭科技	4,200	38,766.00	0.02
612	300348	长亮科技	5,500	37,510.00	0.02
613	688357	建龙微纳	1,600	37,280.00	0.02
614	002353	杰瑞股份	1,000	35,080.00	0.02
615	300896	爱美客	200	34,420.00	0.02

616	688621	阳光诺和	800	34,160.00	0.02
617	300251	光线传媒	4,000	33,640.00	0.02
618	002517	恺英网络	3,500	33,425.00	0.02
619	301018	申菱环境	1,700	33,048.00	0.02
620	603260	合盛硅业	700	32,697.00	0.02
621	002958	青农商行	12,000	32,160.00	0.02
622	601016	节能风电	10,700	31,993.00	0.02
623	300088	长信科技	6,800	31,960.00	0.02
624	688772	珠海冠宇	2,100	31,290.00	0.02
625	600958	东方证券	4,100	31,160.00	0.02
626	002901	大博医疗	1,200	30,996.00	0.02
627	000623	吉林敖东	2,300	30,820.00	0.02
628	600845	宝信软件	960	30,652.80	0.02
629	300332	天壕能源	5,700	30,267.00	0.02
630	301216	万凯新材	2,700	30,213.00	0.02
631	300070	碧水源	7,200	30,168.00	0.02
632	600399	抚顺特钢	5,300	29,839.00	0.02
633	300938	信测标准	1,500	29,820.00	0.02
634	600210	紫江企业	5,600	29,792.00	0.02
635	600929	雪天盐业	5,600	29,680.00	0.02
636	000825	太钢不锈	8,600	29,068.00	0.02
637	001213	中铁特货	7,300	28,835.00	0.02
638	300997	欢乐家	2,400	28,368.00	0.02
639	002558	巨人网络	3,000	28,320.00	0.02
640	600361	创新新材	7,000	28,210.00	0.02
641	000027	深圳能源	3,800	27,740.00	0.02
642	000898	鞍钢股份	12,800	27,136.00	0.01
643	002612	朗姿股份	1,900	26,258.00	0.01
644	300765	新诺威	1,000	25,230.00	0.01
645	002129	TCL中环	2,800	24,220.00	0.01
646	002466	天齐锂业	800	23,928.00	0.01
647	601100	恒立液压	500	23,290.00	0.01
648	002221	东华能源	2,800	22,988.00	0.01
649	002787	华源控股	3,400	22,984.00	0.01
650	603681	永冠新材	1,800	22,950.00	0.01
651	601607	XD上海医	1,200	22,932.00	0.01
652	002709	天赐材料	1,300	22,828.00	0.01
653	605007	五洲特纸	1,800	22,734.00	0.01
654	002753	永东股份	3,900	22,659.00	0.01
655	688396	华润微	600	22,464.00	0.01
656	300154	瑞凌股份	4,200	22,386.00	0.01
657	300247	融捷健康	9,200	22,356.00	0.01
658	002351	漫步者	1,700	22,355.00	0.01

659	300759	康龙化成	1,200	22,296.00	0.01
660	600575	淮河能源	5,700	22,173.00	0.01
661	601728	中国电信	3,500	21,525.00	0.01
662	601998	中信银行	3,200	21,440.00	0.01
663	600901	江苏金租	4,200	21,210.00	0.01
664	300602	飞荣达	1,400	21,154.00	0.01
665	300773	拉卡拉	1,700	21,131.00	0.01
666	600809	山西汾酒	100	21,088.00	0.01
667	002410	广联达	2,200	21,076.00	0.01
668	000885	城发环境	1,700	20,689.00	0.01
669	002851	麦格米特	800	20,672.00	0.01
670	002815	崇达技术	2,200	20,636.00	0.01
671	000426	兴业银锡	1,500	20,370.00	0.01
672	000791	甘肃能源	3,300	20,361.00	0.01
673	300470	中密控股	600	20,286.00	0.01
674	300454	深信服	400	20,212.00	0.01
675	000025	特力A	1,500	20,160.00	0.01
676	002250	联化科技	4,200	20,160.00	0.01
677	002006	精工科技	1,500	20,130.00	0.01
678	002023	海特高新	2,200	20,130.00	0.01
679	600874	创业环保	3,600	20,124.00	0.01
680	002028	思源电气	300	20,070.00	0.01
681	000928	中钢国际	3,600	19,980.00	0.01
682	600703	三安光电	1,700	19,924.00	0.01
683	000420	吉林化纤	6,300	19,908.00	0.01
684	603308	应流股份	1,600	19,872.00	0.01
685	300080	易成新能	6,900	19,872.00	0.01
686	300232	洲明科技	3,800	19,836.00	0.01
687	300065	海兰信	3,000	19,830.00	0.01
688	300134	大富科技	2,900	19,778.00	0.01
689	002446	盛路通信	3,500	19,775.00	0.01
690	300267	尔康制药	9,500	19,760.00	0.01
691	300663	科蓝软件	2,000	19,740.00	0.01
692	002233	塔牌集团	2,700	19,737.00	0.01
693	002961	瑞达期货	1,800	19,710.00	0.01
694	000065	北方国际	1,900	19,703.00	0.01
695	000567	海德股份	3,500	19,635.00	0.01
696	300702	天宇股份	1,100	19,613.00	0.01
697	002434	万里扬	4,000	19,600.00	0.01
698	300319	麦捷科技	2,100	19,593.00	0.01
699	000581	威孚高科	1,200	19,536.00	0.01
700	300369	绿盟科技	3,800	19,418.00	0.01
701	603877	太平鸟	1,400	19,222.00	0.01

702	601233	桐昆股份	1,200	19,152.00	0.01
703	301316	慧博云通	1,300	19,084.00	0.01
704	603171	税友股份	700	18,928.00	0.01
705	605111	新洁能	600	18,354.00	0.01
706	600977	中国电影	1,700	18,292.00	0.01
707	300723	一品红	900	17,685.00	0.01
708	002714	牧原股份	400	17,440.00	0.01
709	002439	启明星辰	900	15,534.00	0.01
710	600699	均胜电子	1,000	14,820.00	0.01
711	000830	鲁西化工	1,200	13,908.00	0.01
712	301011	华立科技	900	13,869.00	0.01
713	002100	天康生物	2,000	13,860.00	0.01
714	688525	佰维存储	200	12,830.00	0.01
715	601566	九牧王	1,500	12,630.00	0.01
716	688680	海优新材	400	11,496.00	0.01
717	300857	协创数据	200	11,400.00	0.01
718	002126	银轮股份	600	10,446.00	0.01
719	600961	株冶集团	1,100	10,384.00	0.01
720	301348	蓝箭电子	335	10,180.65	0.01
721	603055	台华新材	1,000	10,130.00	0.01
722	688148	芳源股份	2,400	10,104.00	0.01
723	002468	申通快递	1,200	10,080.00	0.01
724	601107	四川成渝	1,900	9,975.00	0.01
725	600509	天富能源	1,800	9,918.00	0.01
726	300294	博雅生物	300	9,900.00	0.01
727	688208	道通科技	400	9,656.00	0.01
728	301308	江波龙	100	9,474.00	0.01
729	301200	大族数控	300	9,468.00	0.01
730	603013	亚普股份	700	9,429.00	0.01
731	603358	华达科技	300	8,655.00	0.00
732	688348	昱能科技	140	8,260.00	0.00
733	688390	固德威	140	7,856.80	0.00
734	300904	威力传动	180	7,194.60	0.00
735	601058	赛轮轮胎	500	7,000.00	0.00
736	301510	固高科技	252	6,993.00	0.00
737	301565	中仑新材	364	6,908.72	0.00
738	603288	海天味业	200	6,894.00	0.00
739	002839	张家港行	1,700	6,834.00	0.00
740	601096	宏盛华源	1,575	6,441.75	0.00
741	688702	盛科通信	157	6,358.50	0.00
742	600566	济川药业	200	6,342.00	0.00
743	301202	朗威股份	225	6,021.00	0.00
744	688099	晶晨股份	100	5,932.00	0.00

745	601857	中国石油	500	5,160.00	0.00
746	603896	寿仙谷	200	4,694.00	0.00
747	002230	科大讯飞	100	4,295.00	0.00
748	688185	康希诺	100	4,109.00	0.00
749	688303	大全能源	200	4,078.00	0.00
750	000552	甘肃能化	1,100	3,817.00	0.00
751	688716	中研股份	178	3,773.60	0.00
752	688651	盛邦安全	116	3,393.00	0.00
753	603119	浙江荣泰	161	2,852.92	0.00
754	603107	上海汽配	147	2,335.83	0.00
755	688005	容百科技	100	2,328.00	0.00
756	001306	夏厦精密	33	1,781.67	0.00
757	301293	三博脑科	47	1,771.43	0.00
758	301358	湖南裕能	38	1,195.48	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	600519	贵州茅台	4,269,183.00	1.83
2	600188	兖矿能源	3,788,336.00	1.62
3	601166	兴业银行	3,674,269.92	1.58
4	601658	邮储银行	3,446,205.00	1.48
5	601618	中国中冶	3,372,911.00	1.45
6	600926	杭州银行	3,313,908.00	1.42
7	300750	宁德时代	2,987,310.20	1.28
8	601328	交通银行	2,896,167.00	1.24
9	601919	中远海控	2,783,820.00	1.19
10	000333	美的集团	2,565,730.00	1.10
11	601225	陕西煤业	2,450,716.00	1.05
12	600887	伊利股份	2,242,810.00	0.96
13	601318	中国平安	2,240,262.00	0.96
14	600938	中国海油	2,168,761.00	0.93
15	002701	奥瑞金	2,159,099.00	0.93
16	002236	大华股份	2,148,626.90	0.92
17	600066	宇通客车	2,126,441.00	0.91
18	600933	爱柯迪	2,113,965.00	0.91
19	002745	木林森	2,110,594.00	0.91
20	000338	潍柴动力	2,088,890.00	0.90

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	600188	兖矿能源	3,667,065.00	1.57
2	601998	中信银行	3,531,110.00	1.51
3	601225	陕西煤业	3,452,776.00	1.48
4	601288	农业银行	3,291,227.00	1.41
5	600926	杭州银行	2,770,292.00	1.19
6	600066	宇通客车	2,766,606.00	1.19
7	601618	中国中冶	2,747,916.00	1.18
8	000338	潍柴动力	2,683,326.00	1.15
9	601328	交通银行	2,672,590.00	1.15
10	600887	伊利股份	2,499,468.00	1.07
11	600519	贵州茅台	2,486,521.00	1.07
12	603920	世运电路	2,413,741.85	1.04
13	600019	宝钢股份	2,359,143.00	1.01
14	601688	华泰证券	2,298,075.00	0.99
15	601658	邮储银行	2,251,978.00	0.97
16	601857	中国石油	2,189,201.00	0.94
17	300687	赛意信息	2,176,627.00	0.93
18	002236	大华股份	2,176,194.00	0.93
19	600312	平高电气	2,159,980.62	0.93
20	600623	华谊集团	2,158,571.00	0.93

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	880,188,788.12
卖出股票收入（成交）总额	915,107,857.39

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	10,098,786.30	5.55
	其中：政策性金融债	10,098,786.30	5.55
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）	19,910,754.54	10.95
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	30,009,540.84	16.51

## 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	220303	22 进出 03	100,000	10,098,786.30	5.55
2	127049	希望转 2	11,800	1,221,342.19	0.67
3	113647	禾丰转债	9,380	977,803.32	0.54
4	128119	龙大转债	10,500	974,783.75	0.54
5	113639	华正转债	8,630	922,614.15	0.51

## 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投资。

## 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 117,158,671.44 元，占基金资产净值的比例为 64.44%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 -105,533,320.00 元，占基金资产净值的比例为 -58.04%，空头合约市值占股票资产的比例为 -90.08%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 10,640,069.37 元，公允价值变动损益为 -537,858.58 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：

本集合计划持有的“邮储银行”股票因违反反洗钱法，被中国人民银行罚款3186万元；

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	12,914,331.78
2	应收清算款	608,189.17
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	196,210.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,718,730.95

#### 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	127049	希望转2	1,221,342.19	0.67
2	113647	禾丰转债	977,803.32	0.54
3	128119	龙大转债	974,783.75	0.54
4	113639	华正转债	922,614.15	0.51
5	132026	G三峡EB2	906,196.03	0.50
6	113048	晶科转债	904,430.55	0.50
7	123101	拓斯转债	771,888.08	0.42
8	113058	友发转债	760,195.60	0.42
9	113632	鹤21转债	713,932.32	0.39
10	110095	双良转债	524,467.36	0.29
11	128144	利民转债	500,618.79	0.28
12	111009	盛泰转债	482,066.08	0.27
13	113602	景20转债	482,012.51	0.27
14	128042	凯中转债	476,720.95	0.26
15	123130	设研转债	474,303.08	0.26

16	113669	景 23 转债	472,405.38	0.26
17	111010	立昂转债	471,458.28	0.26
18	113651	松霖转债	470,949.04	0.26
19	128132	交建转债	463,411.85	0.25
20	127100	神码转债	462,334.25	0.25
21	127028	英特转债	462,030.29	0.25
22	127082	亚科转债	459,674.87	0.25
23	128109	楚江转债	457,705.27	0.25
24	128130	景兴转债	457,222.32	0.25
25	123145	药石转债	453,923.21	0.25
26	123104	卫宁转债	385,656.70	0.21
27	128081	海亮转债	385,202.82	0.21
28	128133	奇正转债	384,760.63	0.21
29	110090	爱迪转债	382,442.94	0.21
30	128083	新北转债	382,153.15	0.21
31	111002	特纸转债	381,121.10	0.21
32	128105	长集转债	371,793.74	0.20
33	118031	天 23 转债	370,476.42	0.20
34	127050	麒麟转债	368,029.93	0.20
35	113519	长久转债	266,230.49	0.15
36	127015	希望转债	125,260.22	0.07

### 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	14	160,356.98	-	-	2,244,997.76	100.00

光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	235	32,353.28	-	-	7,603,020.51	100.00
光大阳光对冲 6 个月持有混合 C	21,387	7,407.40	-	-	158,422,117.74	100.00
合计	21,636	7,777.32	-	-	168,270,136.01	100.00

注：分级集合计划机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级集合计划，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计划份额的合计数（即期末集合计划份额总额）。

### 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	-	0.0000
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	75,901.94	0.9983
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C	1,005.80	0.0006
	合计	76,907.74	0.0457

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	0~10
	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	2,305,889.56	35,917,441.41	186,100,891.63
本报告期基金总申购份额	-	672,248.00	23,716,327.41
减：本报告期基金总赎回份额	60,891.80	28,986,668.90	51,395,101.30
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	2,244,997.76	7,603,020.51	158,422,117.74

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

- 2024 年 6 月 25 日，本集合计划管理人增聘张丁为公司副总经理。
- 本报告期内，本集合计划基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及集合计划管理人、集合计划财产、集合计划托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本集合计划投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本集合计划本报告期未改聘会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中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	1,795,208,230.13	100.00	621,088.41	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	471,002,153.50	100.00	1,408,800,000.00	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恢复申购、转换转入、定期定额投资公告	中国证监会规定的媒介	2024 年 01 月 16 日
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 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定的媒介	2024 年 01 月 22 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 2023 年年度报告	中国证监会规定的媒介	2024 年 03 月 29 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 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定的媒介	2024 年 04 月 22 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

2024年8月30日