

光大阳光香港精选混合型集合资产管理计
划（QDII）
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：中国工商银行股份有限公司

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。

集合计划托管人中国工商银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 08 月 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

| | |
|---|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 6 |
| 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人 | 6 |
| 2.5 信息披露方式 | 6 |
| 2.6 其他相关资料 | 7 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 7 |
| 3.2 基金净值表现 | 8 |
| 3.3 其他指标 | 10 |
| §4 管理人报告 | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 10 |
| 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介 | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 11 |
| 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 12 |
| 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 12 |
| 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 13 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 14 |
| 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 14 |
| §5 托管人报告 | 14 |
| 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的真实、准确和完整发表意见 | 14 |
| §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 | 16 |
| 6.3 净资产变动表 | 17 |
| 6.4 报表附注 | 19 |
| §7 投资组合报告 | 42 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 42 |
| 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 | 43 |

| | |
|---|-----------|
| 7.3 期末按行业分类的权益投资组合 | 43 |
| 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 | 43 |
| 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 | 48 |
| 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 | 50 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 | 50 |
| 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 | 50 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 | 50 |
| 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 | 50 |
| 7.11 投资组合报告附注 | 50 |
| §8 基金份额持有人信息 | 51 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 51 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 51 |
| 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 | 52 |
| §9 开放式基金份额变动 | 52 |
| §10 重大事件揭示 | 53 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 53 |
| 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 | 53 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 53 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 53 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 53 |
| 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 | 53 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 53 |
| 10.8 其他重大事件 | 54 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 | 55 |
| 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 | 55 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 55 |
| §12 备查文件目录 | 55 |
| 12.1 备查文件目录 | 55 |
| 12.2 存放地点 | 55 |
| 12.3 查阅方式 | 55 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|---------------------|---|---------------------|
| 基金名称 | 光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII） | |
| 基金简称 | 光大阳光香港精选混合（QDII） | |
| 基金主代码 | 862001 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2021 年 1 月 4 日 | |
| 基金管理人 | 上海光大证券资产管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份 额总额 | 513, 223, 070. 93 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 | 光大阳光香港精选混合（QDII）A | 光大阳光香港精选混合（QDII）C |
| 下属分级基金的交 易代码 | 862001 /862011 | 862012 |
| 报告期末下属分级 基金的份额总额 | 282, 921, 882. 77 份 | 230, 301, 188. 16 份 |

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

2.2 基金产品说明

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

| | |
|--------|---|
| | <p>（四）资产支持证券投资策略</p> <p>本集合计划将重点对区域经济、市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。</p> <p>（五）衍生品投资策略</p> <p>本集合计划主要投资于在经中国证监会认可的交易所上市交易的衍生品，也可投资在场外交易市场（OTC）进行买卖的衍生品。</p> |
| 业绩比较基准 | 经人民币汇率调整的恒生指数收益率*80%+人民币同期活期存款利率（税后）*20% |
| 风险收益特征 | <p>本集合计划为混合型集合计划，其预期风险和预期收益高于债券型基金、债券型集合计划、货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于股票型基金和股票型集合计划。</p> <p>本集合计划主要投资于境外证券市场。除了需要承担与境内集合计划类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本集合计划还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。</p> |

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

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

2.5 信息披露方式

| | |
|--------------------|------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《中国证券报》 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网 | www.ebscn-am.com |

| | |
|------------|-----------------------------------|
| 址 | |
| 基金中期报告备置地点 | 中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层 |

2.6 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数 据和指标 | 报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日) | |
|-------------------|-------------------------------------|-------------------|
| | 光大阳光香港精选混合（QDII）A | 光大阳光香港精选混合（QDII）C |
| 本期已实现收益 | -54,742,941.03 | -32,774,579.40 |
| 本期利润 | -13,426,991.16 | -8,399,867.62 |
| 加权平均基金份 额本期利润 | -0.0467 | -0.0356 |
| 本期加权平均净 值利润率 | -8.58% | -8.99% |
| 本期基金份额净 值增长率 | -7.95% | -8.23% |
| 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 | -132,548,864.14 | -141,417,439.52 |
| 期末可供分配基 金份额利润 | -0.4685 | -0.6141 |
| 期末基金资产净 值 | 150,373,018.63 | 88,883,748.64 |
| 期末基金份额净 值 | 0.5315 | 0.3859 |
| 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 | -59.37% | -61.41% |

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

光大阳光香港精选混合（QDII）A

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去一个月 | -2.82% | 1.02% | -1.28% | 0.89% | -1.54% | 0.13% |
| 过去三个月 | -0.67% | 1.53% | 6.34% | 1.11% | -7.01% | 0.42% |
| 过去六个月 | -7.95% | 1.77% | 3.97% | 1.16% | -11.92% | 0.61% |
| 过去一年 | -17.74% | 1.70% | -5.44% | 1.12% | -12.30% | 0.58% |
| 过去三年 | -62.62% | 2.25% | -25.83% | 1.27% | -36.79% | 0.98% |
| 自基金合同生效起至今 | -59.37% | 2.18% | -22.95% | 1.23% | -36.42% | 0.95% |

光大阳光香港精选混合（QDII）C

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去一个月 | -2.89% | 1.02% | -1.28% | 0.89% | -1.61% | 0.13% |
| 过去三个月 | -0.82% | 1.53% | 6.34% | 1.11% | -7.16% | 0.42% |
| 过去六个月 | -8.23% | 1.77% | 3.97% | 1.16% | -12.20% | 0.61% |

| | | | | | | |
|------------|---------|-------|---------|-------|---------|-------|
| 过去一年 | -18.24% | 1.70% | -5.44% | 1.12% | -12.80% | 0.58% |
| 过去三年 | -63.28% | 2.25% | -25.83% | 1.27% | -37.45% | 0.98% |
| 自基金合同生效起至今 | -61.41% | 2.18% | -22.95% | 1.23% | -38.46% | 0.95% |

注：1、自基金合同生效起至今指 2021 年 1 月 4 日至 2024 年 6 月 30 日；

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

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

光大阳光香港精选混合（QDII）A 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



光大阳光香港精选混合（QDII）C 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上海光大证券资产管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）成立于 2012 年 5 月 9 日，前身为原光大证券股份有限公司资产管理总部，承继了光大证券的客户资产管理业务与资格。2002 年 5 月 14 日，中国证券监督管理委员会核发证监机构字[2002]127 号《关于核准光大证券有限责任公司受托投资管理业务资格的批复》，同意光大证券从事客户资产管理业务。2011 年 11 月 23 日，中国证券监督管理委员会核发证监许可[2011]1886 号《关于核准光大证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》，同意光大证券设立资产管理子公司并核准公司章程。2012 年 2 月 21 日，公司在上海市工商行政管理局登记注册，注册资本 2 亿元，光大证券持股 100%。

截至 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 | | |
| 孟巍 | 本集合计划投资经 | 2024 年 5 月 17 日 | - | 10 年 | 孟巍先生，复旦大学微电子学学士，复旦大学集成电路工程硕士，从事行业研究相 |

| | | | | | |
|-----|-------------|-------------|-------------|-----|---|
| | 理 | | | | 关工作多年，具有较强的复合专业背景。曾任广发证券发展研究中心研究员，上海光大证券资产管理有限公司权益部研究员及权益公募投资部副总经理，现任公司权益投资总监兼权益公募投资部总经理，担任光大阳光启明星创新驱动主题混合型集合资产管理计划、光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII）投资经理。 |
| 王海涛 | 本集合计划投资经理 | 2021年01月04日 | 2024年05月17日 | 18年 | 王海涛先生，北京师范大学硕士研究生毕业，历任首创证券、华泰证券研究员，太平资管、平安信托高级投资经理，上海人寿保险、华宝证券投资部门总经理，2019年加入光证资管，现任权益私募投资部投资经理。 |
| 何伟 | 本集合计划投资经理助理 | 2024年06月12日 | - | 9年 | 何伟先生，上海财经大学金融学学士，上海交通大学工商管理学硕士，曾任金元顺安基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理，2021年7月加入上海光大证券资产管理有限公司，具备较强的跨行业研究能力和个股挖掘能力，现任权益公募投资部投资经理，担任光大阳光价值30个月持有期混合型集合资产管理计划投资经理。 |

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

| 姓名 | 产品类型 | 产品数量（只） | 资产净值（元） | 任职时间 |
|----|----------|---------|----------------|-------------|
| 孟巍 | 公募基金 | 2 | 452,522,402.94 | 2020年08月18日 |
| | 私募资产管理计划 | 1 | 226,874,703.11 | 2024年05月24日 |
| | 其他组合 | - | - | - |
| | 合计 | 3 | 679,397,106.05 | - |

注：任职时间为投资经理在行业内首次管理本类产品的时间。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本集合计划无境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，上海光大证券资产管理有限公司作为本集合计划管理人，严格遵守《中华人民共

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

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本集合计划管理人一贯公平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》。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本集合计划未发生违法违规且对集合计划财产造成损失的异常交易行为。本报告期内未发生管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年 A 股市场和香港股市走势曲折，主要受宏观预期波动的影响。行情大致可分三段：年初，下跌，投资者对中长期发展的结构性问题预期悲观，把持仓结构收缩到盈利预期相对稳健的股票，也即市场冠以的“高股息”、“红利”标签，中小股票受流动性枯竭而持续下跌；春节后，反弹，调整风险释放，海外补库和国内设备更新等利好刺激，中下游增产补库，家电和机械等行业上涨，同时，资源股供给瓶颈的故事继续演绎，需求稍有给力即涨价，股价强势表现，红利风格大行其道；港股也在互联网公司财报催化、红利税减免等刺激下快速反弹。5-6 月，市场再下跌，内需数据再度全面走弱，居民收益预期、消费支出预期全面悲观。

对于资源股或者“红利”，我们认为部分品种仍有可观的买入回报率，但要考虑短期和长期的问题，短期的上涨当中必然存在基本面趋势投资者，而在内需压力的背景下，若价格趋势转向，基本面趋势投资者的离场恐对所谓的红利或者买入回报率造成打击，7 月中旬即有迹象，而当调整后，我们又可再度回到供给瓶颈的故事当中，投资期限应理性拉长。

对于消费，需求的中期故事难以辩驳，但也可以和红利一样，反过来想，当前的估值下，以及部分消费品本已较好的供给逻辑下，任何短期需求的预期的变化都可能带来阶段性的反弹，且目前我们观测到消费品公司账上具备较为充足的现金，在满足投资者买入回报率方面是完全有能力有所作为的，而其意愿或者其他外部约束是我们可以去关注的。

对于互联网，我们正在看到这些公司采取稳健审慎的扩展和投资策略，加大回购等提升投资者回报水平，虽然难言星辰大海的故事，但这些公司已经形成的基础设施价值在短期内仍然较为稳固，个别领域虽有竞争，但仍在动态优化，匹配当前的估值水平，仍然是稳健之选。

总的来说，我们容易受到线性外推的影响，用长期的逻辑来解释短期的现象的合理，而股票市场的难是在当前的现象当中既有中期的叙事逻辑，也有短期的交易投机，投资策略需要与投资久期相匹配，我们要警惕短期趋势对久期目标的冲击，市场当前的不均衡性同样孕育着机会，过去处在矛盾对立面的资产比如红利与消费，任何预期的反向波动都是对方的风险和机会，我们比较可以确定的是未来一段时间市场将呈现更多的结构性机会。

香港精选当前依然以互联网、医药和部分赔率较好的顺周期消费、资源资产为主，整体来讲配置比较均衡，我们对离岸市场未来在宏观经济周期触底向上的过程中的弹性抱有乐观预期。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日，光大阳光香港精选混合（QDII）A 类份额净值为 0.5315 元，本报告期份额净值增长率为-7.95%；光大阳光香港精选混合（QDII）C 类份额净值为 0.3859 元，本报告期份额净值增长率为-8.23%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，内需方面，半年度政治局会议对于稳增长和提振消费的态度提升，当前股票市场已经调整至低位，若有逆周期政策出台，上行概率明显大于下行风险，因此我们对于股市的态度中性偏积极，主要是调整相对较多，政策预期增强。外需方面，上半年补库且同期基数较低，外销增速明显，下半年基数回升，虽补库稳定，但增速较多会放缓，考虑海外降息降至，软着陆概览大，因此外需预期仍然相对稳定，但需要关注潜在的关税风险变化。综上，我们认为短期股市的主动因素仍在宏观预期，而这有赖于政策的变化，当前估值偏低，密切关注政策变化带来的机会。总体来说，当前市场有利于不利的因素复杂交织，国外不确定因素依然不少，股市或仍将处在震荡态势。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本集合计划管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和集合计划合同的约定，对集合计划所持有的投资品种进行估值，本集合计划托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。集合计划份额净值由集合计划管理人完成估值后，经集合计划托管人复核无误后由集合计划管理人对外公布。本集合计划管理人对投资品种进行估值时原则上应保持估值程序和技术的一致性，对旗下管理的不同产品持有的具有相同特征的同一投资品

种的估值调整原则、程序及技术应当一致（中国证监会规定的特殊品种除外）。为了保障集合计划能真实、准确地反映投资品种的公允价值，本集合计划管理人授权估值委员会负责建立健全估值决策体系，估值委员会成员的任命和调整由总经理办公会审议决定。运营部是估值委员会的日常办事机构，负责关注相关投资品种的动态，确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种，并提交估值委员会审议。运营部的估值人员均具有专业会计学习经历，具有基金从业人员资格。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本集合计划报告期内未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人上海光大证券资产管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对上海光大证券资产管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII）

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 | 上年度末 |
|----|-----|-----|------|
|----|-----|-----|------|

| | | 2024 年 6 月 30 日 | 2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资 产： | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 31,658,355.11 | 18,860,051.40 |
| 结算备付金 | | - | 115.95 |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 205,743,645.29 | 253,493,937.82 |
| 其中：股票投资 | | 205,743,645.29 | 253,493,937.82 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 债权投资 | 6.4.7.5 | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | 6.4.7.6 | - | - |
| 其他权益工具投资 | 6.4.7.7 | - | - |
| 应收清算款 | | 3,976,995.73 | 2,455,772.51 |
| 应收股利 | | 959,066.61 | 205,559.61 |
| 应收申购款 | | 41,076.47 | 104,135.30 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 242,379,139.21 | 275,119,572.59 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
| 负 债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | 1,195,773.46 | 508,372.21 |
| 应付赎回款 | | 1,378,901.06 | 2,647,116.87 |
| 应付管理人报酬 | | 326,175.55 | 375,723.89 |
| 应付托管费 | | 71,350.90 | 82,189.61 |
| 应付销售服务费 | | 45,522.57 | 52,931.83 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 104,648.40 | 304,459.28 |

| | | | |
|-------------|----------|-----------------|-----------------|
| 负债合计 | | 3,122,371.94 | 3,970,793.69 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 513,223,070.93 | 535,823,654.05 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | -273,966,303.66 | -264,674,875.15 |
| 净资产合计 | | 239,256,767.27 | 271,148,778.90 |
| 负债和净资产总计 | | 242,379,139.21 | 275,119,572.59 |

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，集合计划份额总额 513,223,070.93 份。光大阳光香港精选人民币 A 集合计划份额净值 0.5315 元，集合计划份额 282,921,882.77 份，集合计划资产净值 150,373,018.63 元。光大阳光香港精选人民币 C 集合计划份额净值 0.3859 元，集合计划份额 230,301,188.16 份，集合计划资产净值 88,883,748.64 元。

6.2 利润表

会计主体：光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII）

本报告期：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 |
|-----------------------|----------|--|---|
| 一、营业总收入 | | -19,054,725.21 | -55,842,481.37 |
| 1. 利息收入 | | 216,315.96 | 168,435.28 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 216,315.96 | 168,435.28 |
| 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 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -85,090,799.71 | -62,335,602.48 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | -87,053,234.92 | -65,846,420.30 |
| 基金投资收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.16 | - | - |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.17 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.18 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.19 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.20 | 1,962,435.21 | 3,510,817.82 |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |

| | | | |
|----------------------------|------------|-----------------------|-----------------------|
| 3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列) | 6.4.7.21 | 65,690,661.65 | 5,474,478.67 |
| 4. 汇兑收益(损失以“-”号填列) | | 117,192.69 | 812,315.63 |
| 5. 其他收入(损失以“-”号填列) | 6.4.7.22 | 11,904.20 | 37,891.53 |
| 减：二、营业总支出 | | 2,772,133.57 | 4,038,079.71 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 1,983,637.85 | 2,917,697.12 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 433,920.84 | 638,246.30 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 278,238.42 | 412,417.93 |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.23 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | - | - |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.24 | 76,336.46 | 69,718.36 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -21,826,858.78 | -59,880,561.08 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -21,826,858.78 | -59,880,561.08 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -21,826,858.78 | -59,880,561.08 |

6.3 净资产变动表

会计主体：光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII）

本报告期：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 | 535,823,654.05 | - | -264,674,875.15 | 271,148,778.90 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净 | 535,823,654.05 | - | -264,674,875.1 | 271,148,778.90 |

| | | | | |
|--|----------------------|--------|-----------------|----------------|
| 资产 | | | 5 | |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -22,600,583.12 | - | -9,291,428.51 | -31,892,011.63 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | -21,826,858.78 | -21,826,858.78 |
| (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) | -22,600,583.12 | - | 12,535,430.27 | -10,065,152.85 |
| 其中：1. 基金申购款 | 19,176,187.47 | - | -10,992,474.41 | 8,183,713.06 |
| 2. 基金赎回款 | -41,776,770.59 | - | 23,527,904.68 | -18,248,865.91 |
| (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 | 513,223,070.93 | - | -273,966,303.66 | 239,256,767.27 |
| 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 | 580,342,738.38 | - | -190,731,054.04 | 389,611,684.34 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 580,342,738.38 | - | -190,731,054.04 | 389,611,684.34 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-” | -18,144,034.01 | - | -52,583,200.63 | -70,727,234.64 |

| | | | | |
|--|----------------|---|-----------------|----------------|
| 号填列) | | | | |
| (一)、综合收益总额 | - | - | -59,880,561.08 | -59,880,561.08 |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列) | -18,144,034.01 | - | 7,297,360.45 | -10,846,673.56 |
| 其中：1. 基金申购款 | 35,394,366.00 | - | -13,696,321.43 | 21,698,044.57 |
| 2. 基金赎回款 | -53,538,400.01 | - | 20,993,681.88 | -32,544,718.13 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（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 | 562,198,704.37 | - | -243,314,254.67 | 318,884,449.70 |

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

光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII）是由光大全球灵活配置型（QDII）集合资产管理计划转型而来。本集合计划管理人上海光大证券资产管理有限公司于 2020 年 12 月 3 日发布《光大全球灵活配置型（QDII）集合资产管理计划合同变更公告》。根据公告，光大全球灵活配置型（QDII）集合资产管理计划名称变更为“光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII）”，光大全球灵活配置型（QDII）集合资产管理计划份额转换为光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII）A 类人民币份额。合同变更后，本集合计划的托管人、登记机构不变。

自 2021 年 1 月 4 日起《光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII）资产管理合同》、《光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII）托管协议》生效。本集合计划存续期至 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，境内托管人为中国工商银行股份有限公司，境外托管人为布朗兄弟哈里曼银行。

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

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

本集合计划主要投资的境外市场有：中国香港特别行政区和美国。境内投资品种包括国内依法发行上市的股票（含创业板、中小板及其他经中国证监会允许集合计划投资的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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

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

本集合计划的投资组合比例为：股票资产占集合计划资产的比例为 60%~95%，其中投资于香

港证券市场相关证券的比例不低于非现金集合计划资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于集合计划资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本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[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[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》及其他相关境内外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。

对集合计划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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 目前集合计划取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前集合计划取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

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。集合计划通过沪港通/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) 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。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 | 31,658,355.11 |
| 等于：本金 | 31,657,929.15 |
| 加：应计利息 | 425.96 |
| 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 | 31,658,355.11 |

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 | 300,592,287.51 | - | 205,743,645.29 | -94,848,642.22 |
| 贵金属投资-金交所 黄金合约 | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | - | - | - |
| 资产支持证券 | - | - | - | - |
| 基金 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 300,592,287.51 | - | 205,743,645.29 | -94,848,642.22 |

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 2024年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 241.68 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 28,325.26 |

| | |
|----------|------------|
| 其中：交易所市场 | 28,325.26 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 76,081.46 |
| 合计 | 104,648.40 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

光大阳光香港精选混合（QDII）A

| 项目 | 本期 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 | 292,130,206.91 | 292,130,206.91 |
| 本期申购 | 3,546,281.42 | 3,546,281.42 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -12,754,605.56 | -12,754,605.56 |
| 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 | 282,921,882.77 | 282,921,882.77 |

光大阳光香港精选混合（QDII）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 | 243,693,447.14 | 243,693,447.14 |
| 本期申购 | 15,629,906.05 | 15,629,906.05 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -29,022,165.03 | -29,022,165.03 |
| 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 | 230,301,188.16 | 230,301,188.16 |

6.4.7.11 其他综合收益

本集合计划本期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

光大阳光香港精选混合（QDII）A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------|----------------|----------------|-----------------|
| 上年度末 | -51,713,401.04 | -71,742,864.70 | -123,456,265.74 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |

| | | | |
|----------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 本期期初 | -51,713,401.04 | -71,742,864.70 | -123,456,265.74 |
| 本期利润 | -54,742,941.03 | 41,315,949.87 | -13,426,991.16 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 2,231,744.39 | 2,102,648.37 | 4,334,392.76 |
| 其中：基金申购款 | -793,076.47 | -750,801.46 | -1,543,877.93 |
| 基金赎回款 | 3,024,820.86 | 2,853,449.83 | 5,878,270.69 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -104,224,597.68 | -28,324,266.46 | -132,548,864.14 |

光大阳光香港精选混合（QDII）C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 上年度末 | -87,605,672.02 | -53,612,937.39 | -141,218,609.41 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | -87,605,672.02 | -53,612,937.39 | -141,218,609.41 |
| 本期利润 | -32,774,579.40 | 24,374,711.78 | -8,399,867.62 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 5,294,331.11 | 2,906,706.40 | 8,201,037.51 |
| 其中：基金申购款 | -6,156,667.39 | -3,291,929.09 | -9,448,596.48 |
| 基金赎回款 | 11,450,998.50 | 6,198,635.49 | 17,649,633.99 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -115,085,920.31 | -26,331,519.21 | -141,417,439.52 |

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 | 215,593.26 |
| 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 | 719.62 |
| 其他 | 3.08 |
| 合计 | 216,315.96 |

注：其他为交易所结算保证金、直销申购款利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 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 | -87,053,234.92 |
| 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 | -87,053,234.92 |

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 | 78,434,083.03 |
| 减：卖出股票成本总额 | 165,234,821.81 |
| 减：交易费用 | 252,496.14 |
| 买卖股票差价收入 | -87,053,234.92 |

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 基金投资收益

本集合计划本报告期无基金投资收益。

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

本集合计划本报告期无债券投资收益。

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本集合计划本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期无债券赎回差价收入。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期无债券申购差价收入。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

本集合计划本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本集合计划本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期无资产支持证券赎回差价收入。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期无资产支持证券申购差价收入。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

本集合计划本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本集合计划本报告期无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期无贵金属申购差价收入。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本集合计划本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

本集合计划本报告期无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.20 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 | 1,962,435.21 |
| 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 | 1,962,435.21 |

6.4.7.21 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 | 65,690,661.65 |
| 股票投资 | 65,690,661.65 |
| 债券投资 | - |
| 资产支持证券投资 | - |
| 基金投资 | - |
| 贵金属投资 | - |
| 其他 | - |

| | |
|------------------------|---------------|
| 2. 衍生工具 | - |
| 权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | 65,690,661.65 |

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 11,904.20 |
| 合计 | 11,904.20 |

6.4.7.23 信用减值损失

本集合计划本报告期无信用减值损失。

6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用 | 16,409.12 |
| 信息披露费 | 59,672.34 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行费用 | 255.00 |
| 合计 | 76,336.46 |

6.4.7.25 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本集合计划未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本集合计划无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期本集合计划存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|------------------------|------------------|
| 上海光大证券资产管理有限公司（“光证资管”） | 集合计划管理人、集合计划销售机构 |

| | |
|------------------------|---------------------|
| 中国工商银行股份有限公司（“工商银行”） | 集合计划托管人、集合计划代销机构 |
| 布朗兄弟哈里曼银行（“布朗兄弟哈里曼银行”） | 境外资产托管人 |
| 光大证券股份有限公司（“光大证券”） | 集合计划代销机构、集合计划管理人的股东 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 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 | 12,673,585.77 | 9.73 | 29,389,777.81 | 20.67 |

6.4.10.1.2 债券交易

本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 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 | 9,779.90 | 8.17 | 28,325.26 | 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 | 22,718.39 | 16.66 | 22,718.39 | 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 | 1,983,637.85 | 2,917,697.12 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护 费 | 63,635.43 | 80,330.79 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 1,920,002.42 | 2,837,366.33 |

注：本集合计划管理费按前一日集合计划资产净值的1.6%年费率计提，计算方法如下：

$$G = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

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 | 433,920.84 | 638,246.30 |

注：本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的0.35%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 | 本期 |
|-------------|----|
| | |

| 方名称 | 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 | | |
| | 光大阳光香港精选混 合（QDII）A | 光大阳光香港精选混 合（QDII）C | 合计 |
| 光大证券 | - | 241,881.84 | 241,881.84 |
| 光证资管 | - | 2,326.22 | 2,326.22 |
| 合计 | - | 244,208.06 | 244,208.06 |
| 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 | | |
| | 光大阳光香港精选混 合（QDII）A | 光大阳光香港精选混 合（QDII）C | 合计 |
| 光大证券 | - | 369,670.35 | 369,670.35 |
| 光证资管 | - | 3,159.83 | 3,159.83 |
| 合计 | - | 372,830.18 | 372,830.18 |

注：本集合计划 A 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 0.6%，销售服务费按前一日 C 类份额的集合计划资产净值的 0.6% 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 类份额前一日的集合计划资产净值

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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 | |
|---------------------------|---------------------------------|-------------------|
| | 光大阳光香港精选混合（QDII）A | 光大阳光香港精选混合（QDII）C |
| 基金合同生效日（2021年1月4日）持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | 58,610,757.73 | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 58,610,757.73 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 11.4201% | - |
| 项目 | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日 | |
| | 光大阳光香港精选混合（QDII）A | 光大阳光香港精选混合（QDII）C |
| 基金合同生效日（2021年1月4日）持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | 58,610,757.73 | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 58,610,757.73 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 10.4253% | - |

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

光大阳光香港精选混合（QDII）A

| 关联方名称 | 本期末 2024年6月30日 | 上年度末 2023年12月31日 |
|-------|-------------------|---------------------|
| | | |

| | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%） | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%） |
|--------------------|--------------|-----------------------------|--------------|-----------------------------|
| 光大证券 股份有限 公司 | 5,058,602.16 | 0.9857 | 5,058,602.16 | 0.9400 |

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 |
| 布朗兄弟哈里曼 银行 | 27,670,196.85 | 203,240.49 | 19,935,125.99 | 148,590.29 |
| 工商银行 | 3,988,158.26 | 12,352.77 | 6,234,400.85 | 19,180.78 |

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本集合计划本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本集合计划本报告期无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本集合计划本报告期未进行利润分配。

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

本集合计划本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票 代码 | 股 票 名 称 | 停牌 日期 | 停牌 原因 | 期末 估值 单价 | 复 牌 日期 | 复牌 开盘 单价 | 数量 (股) | 期末 成本总额 | 期末 估值总额 | 备注 |
|------------|------------------|------------------------|------------|----------------|--------------|----------------|-----------|--------------|--------------|----|
| 6606 HK | 诺辉 健康 | 2024 年3 月28 日 | 重大事 项停牌 | 12.91 | - | - | 90,000 | 3,774,746.41 | 1,161,476.57 | - |

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。

本集合计划的管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本集合计划的货币资金存放在本集合计划的托管人开立的托管账户或其他大中型商业银行开立的存款账户，因而与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通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易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。

于本期末，本集合计划未持有债券和资产支持证券。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指集合计划管理人未能以合理价格及时变现集合计划资产以支付投资者赎回款项的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于集合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)本集合计划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 | 31,658,355.11 | - | - | - | 31,658,355.11 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 205,743,645.29 | 205,743,645.29 |
| 应收股利 | - | - | - | 959,066.61 | 959,066.61 |
| 应收申购款 | - | - | - | 41,076.47 | 41,076.47 |
| 应收清算款 | - | - | - | 3,976,995.73 | 3,976,995.73 |
| 资产总计 | 31,658,355.11 | - | - | 210,720,784.10 | 242,379,139.21 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 1,378,901.06 | 1,378,901.06 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 326,175.55 | 326,175.55 |
| 应付托管费 | - | - | - | 71,350.90 | 71,350.90 |
| 应付清算款 | - | - | - | 1,195,773.46 | 1,195,773.46 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 45,522.57 | 45,522.57 |
| 其他负债 | - | - | - | 104,648.40 | 104,648.40 |
| 负债总计 | - | - | - | 3,122,371.94 | 3,122,371.94 |
| 利率敏感度缺口 | 31,658,355.11 | - | - | -207,598,412.16 | 239,256,767.27 |

| 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 | 18,860,051.40 | - | - | - | 18,860,051.40 |
| 结算备付金 | 115.95 | - | - | - | 115.95 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | -253,493,937.82 | 253,493,937.82 |
| 应收股利 | - | - | - | 205,559.61 | 205,559.61 |
| 应收申购款 | - | - | - | 104,135.30 | 104,135.30 |
| 应收清算款 | - | - | - | 2,455,772.51 | 2,455,772.51 |
| 资产总计 | 18,860,167.35 | - | - | -256,259,405.24 | 275,119,572.59 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 2,647,116.87 | 2,647,116.87 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 375,723.89 | 375,723.89 |
| 应付托管费 | - | - | - | 82,189.61 | 82,189.61 |
| 应付清算款 | - | - | - | 508,372.21 | 508,372.21 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 52,931.83 | 52,931.83 |
| 其他负债 | - | - | - | 304,459.28 | 304,459.28 |
| 负债总计 | - | - | - | 3,970,793.69 | 3,970,793.69 |
| 利率敏感度缺口 | 18,860,167.35 | - | - | -252,288,611.55 | 271,148,778.90 |

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

本集合计划本报告期末及上年度末未持有交易性债券投资(不含可转债)，因此市场利率的变动对于集合计划资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | | | 合计 |
|----------|------------------------|---------------|---------------|---------------|
| | 美元 折合人民币 | 港币 折合人民币 | 其他币种 折合人民币 | |
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 货币资金 | 2,477,129 | 25,189,999.03 | - | 27,667,128.33 |

| | | | | |
|-------------------|--------------------------|----------------|---------------|----------------|
| | . 30 | | | |
| 交易性金融资产 | - | 205,055,445.29 | - | 205,055,445.29 |
| 应收股利 | 205,406.85 | 647,054.88 | - | 852,461.73 |
| 资产合计 | 2,682,536.15 | 230,892,499.20 | - | 233,575,035.35 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 应付清算款 | - | 552,152.22 | - | 552,152.22 |
| 负债合计 | - | 552,152.22 | - | 552,152.22 |
| 资产负债表外 汇风险敞口净额 | 2,682,536.15 | 230,340,346.98 | - | 233,022,883.13 |
| | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 | | | |
| 项目 | 美元 折合人民币 | 港币 折合人民币 | 其他币种 折合人民币 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 货币资金 | 1,968,755.95 | 8,683,164.14 | - | 10,651,920.09 |
| 交易性金融资产 | - | 253,493,937.82 | - | 253,493,937.82 |
| 应收股利 | 123,947.25 | 72,497.60 | - | 196,444.85 |
| 资产合计 | 2,092,703.20 | 262,249,599.56 | - | 264,342,302.76 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 应付清算款 | - | 508,372.21 | - | 508,372.21 |
| 负债合计 | - | 508,372.21 | - | 508,372.21 |
| 资产负债表外 汇风险敞口净额 | 2,092,703.20 | 261,741,227.35 | - | 263,833,930.55 |

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场汇率以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|--------------------|-----------------------------|-------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2024年6月30日） | 上年度末（2023年12月31日） |
| | 港币相对人民币升值 5% | 11,512,272.22 | 13,108,855.10 |
| | 美元相对人民币升值 5% | 123,856.47 | 98,437.80 |
| | 港币相对人民币贬值 5% | -11,512,272.22 | -13,108,855.10 |
| | 美元相对人民币贬值 5% | -123,856.47 | -98,437.80 |

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是集计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素发生变动时产生的价格波动风险。本集计划主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本集计划严格按照合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，管理人每日对本集计划所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对集计划进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 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 | 205,743,645.29 | 85.99 | 253,493,937.82 | 93.49 |
| 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 | 205,743,645.29 | 85.99 | 253,493,937.82 | 93.49 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| | | | |
|----|--------------------|-----------------------------|-------------------|
| 假设 | 除恒生指数以外的其他市场变量保持不变 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2024年6月30日） | 上年度末（2023年12月31日） |
| | 恒生指数上升5% | 12,035,077.70 | 14,278,434.82 |
| | 恒生指数下降5% | -12,035,077.70 | -14,278,434.82 |

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 2024年6月30日 | 上年度末 2023年12月31日 |
|---------------|-------------------|---------------------|
| 第一层次 | 204,582,168.72 | 253,493,937.82 |
| 第二层次 | 1,161,476.57 | - |
| 第三层次 | - | - |

| | | |
|----|----------------|----------------|
| 合计 | 205,743,645.29 | 253,493,937.82 |
|----|----------------|----------------|

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 | 205,743,645.29 | 84.89 |
| | 其中：普通股 | 205,743,645.29 | 84.89 |
| | 存托凭证 | - | - |
| | 优先股 | - | - |
| | 房地产信托凭证 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| | 其中：远期 | - | - |
| | 期货 | - | - |
| | 期权 | - | - |
| | 权证 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 货币市场工具 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 31,658,355.11 | 13.06 |
| 8 | 其他各项资产 | 4,977,138.81 | 2.05 |
| 9 | 合计 | 242,379,139.21 | 100.00 |

注：本集合计划本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 17,536,416.06 元人民币，占期末集合计划资产净值比例 7.33%。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

| 国家（地区） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|----------------|--------------|
| 中国香港 | 205,055,445.29 | 85.71 |
| 中国 | 688,200.00 | 0.29 |
| 合计 | 205,743,645.29 | 85.99 |

注：本集合计划本报告期末未持有权证。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

| 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---------|----------------|--------------|
| 基础材料 | 3,750,699.53 | 1.57 |
| 消费者非必需品 | 65,001,553.75 | 27.17 |
| 消费者常用品 | 11,129,994.90 | 4.65 |
| 能源 | 2,695,674.13 | 1.13 |
| 金融 | 4,630,795.18 | 1.94 |
| 医疗保健 | 46,333,893.95 | 19.37 |
| 工业 | 10,718,290.06 | 4.48 |
| 信息技术 | 9,908,185.51 | 4.14 |
| 电信服务 | 39,935,817.63 | 16.69 |
| 公用事业 | - | - |
| 房地产 | 10,950,540.65 | 4.58 |
| 合计 | 205,055,445.29 | 85.71 |

注：以上行业分类采用港交所二级分类标准。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文） | 公司名称（中文） | 证券代码 | 所在证券市场 | 所属国家（地区） | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------------------|----------|--------|---------|----------|--------|---------------|--------------|
| 1 | TENCENT HOLDINGS LTD | 腾讯控股 | 700 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 63,712 | 21,654,564.02 | 9.05 |

| | | | | | | | | |
|----|--------------------------------------|------------|---------|-----------------|------------|---------------|---------------|------|
| 2 | MEITUAN DIANPING- CLASS B | 美团-W | 3690 HK | 香港联 合交易 所 | 中 国 香 港 | 180,563 | 18,308,862.14 | 7.65 |
| 3 | NETEASE INC | 网易 | 9999 HK | 香港联 合交易 所 | 中 国 香 港 | 82,921 | 11,283,938.44 | 4.72 |
| 4 | ANTA SPORTS PRODUCTS LTD | 安踏体 育 | 2020 HK | 香港联 合交易 所 | 中 国 香 港 | 147,000 | 10,062,297.00 | 4.21 |
| 5 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 阿里巴 巴 | 9988 HK | 香港联 合交易 所 | 中 国 香 港 | 138,900 | 8,937,373.27 | 3.74 |
| 6 | INNOVENT BIOLOGICS INC | 信达生 物 | 1801 HK | 香港联 合交易 所 | 中 国 香 港 | 259,276 | 8,708,205.52 | 3.64 |
| 7 | BEIGENE LTD | 百济神 州 | 6160 HK | 香港联 合交易 所 | 中 国 香 港 | 107,035 | 8,420,766.27 | 3.52 |
| 8 | AKESO INC | 康方生 物 | 9926 HK | 香港联 合交易 所 | 中 国 香 港 | 236,728 | 8,156,148.39 | 3.41 |
| 9 | FU SHOU YUAN INTERNATI ONAL | 福寿园 | 1448 HK | 香港联 合交易 所 | 中 国 香 港 | 1,569,8 41 | 6,991,880.92 | 2.92 |
| 10 | XIAOMI CORP-CLAS S B | 小米集 团 | 1810 HK | 香港联 合交易 所 | 中 国 香 港 | 420,000 | 6,317,205.89 | 2.64 |
| 11 | KUAISHOU TECHNOL | 快手 | 1024 HK | 香港联 合交易 所 | 中 国 香 港 | 147,655 | 6,219,255.47 | 2.60 |
| 12 | TSINGTAO BREWERY CO LTD-H | 青岛啤 酒 | 168 HK | 香港联 合交易 所 | 中 国 香 港 | 130,000 | 6,181,581.64 | 2.58 |
| 13 | BOSIDENG INTL | 波司登 | 3998 HK | 香港联 合交易 所 | 中 国 香 港 | 1,100,0 00 | 4,889,226.76 | 2.04 |
| 14 | HANSOH PHARMACEU | 翰森制 药 | 3692 HK | 香港联 合交易 所 | 中 国 香 港 | 300,000 | 4,468,481.28 | 1.87 |
| 15 | CHINA OVERSEAS | 中国海 外发展 | 688 HK | 香港联 合交易 | 中 国 香 港 | 349,879 | 4,323,695.24 | 1.81 |

| | | | | | | | | |
|----|------------------------------|--------------|---------|---------|------|-----------|--------------|------|
| | LAND & INVEST | | | 所 | | | | |
| 16 | CHINA RESOURCES BEER HOLDIN | 华润啤酒 | 291 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 180,000 | 4,312,413.00 | 1.80 |
| 17 | LIFETECH SCI | 先健科技 | 1302 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 3,200,000 | 4,059,600.64 | 1.70 |
| 18 | POLY PROPERTY-H | 保利物业服务股份有限公司 | 6049 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 150,000 | 3,956,467.80 | 1.65 |
| 19 | HAIER SMART H-H | 海尔智家 | 6690 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 152,200 | 3,625,548.29 | 1.52 |
| 20 | DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-H | 东方电气 | 1072 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 294,362 | 3,342,109.38 | 1.40 |
| 21 | CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT | 石药集团 | 1093 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 500,000 | 2,838,434.80 | 1.19 |
| 22 | ASCENTAGE PHARMA | 亚盛医药-B | 6855 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 120,000 | 2,798,276.88 | 1.17 |
| 23 | LI NING CO LTD | 李宁 | 2331 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 180,000 | 2,776,372.56 | 1.16 |
| 24 | ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H | 紫金矿业 | 2899 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 170,000 | 2,556,964.29 | 1.07 |
| 25 | MAN WAH HOLDINGS | 敏华控股 | 1999 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 500,000 | 2,445,982.40 | 1.02 |
| 26 | SINOTRUK HONG KONG LTD | 中国重汽 | 3808 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 130,109 | 2,410,582.01 | 1.01 |
| 27 | HYGEIA HEALTH | 海吉亚医疗 | 6078 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 90,000 | 2,312,274.78 | 0.97 |
| 28 | SUNNY | 舜宇光 | 2382 HK | 香港联 | 中国 | 50,000 | 2,201,840.50 | 0.92 |

| | | | | | | | | |
|----|---------------------------------------|-----------------|---------|-----------------|-----------|---------|--------------|------|
| | OPTICAL TECH | 学科技 | | 合交易 所 | 香港 | | | |
| 29 | CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD | 中海物 业 | 2669 HK | 香港联 合交易 所 | 中 国 香港 | 500,000 | 2,135,671.20 | 0.89 |
| 30 | CNOOC LTD | 中国海 油 | 883 HK | 香港联 合交易 所 | 中 国 香港 | 97,447 | 1,992,209.59 | 0.83 |
| 31 | FUYAO GLASS IN-H | 福耀玻 璃 | 3606 HK | 香港联 合交易 所 | 中 国 香港 | 44,425 | 1,838,752.44 | 0.77 |
| 32 | TECHTRONI C IND | 创科实 业 | 669 HK | 香港联 合交易 所 | 中 国 香港 | 21,499 | 1,750,256.29 | 0.73 |
| 33 | CHINA MERCHANTS BANK | 招商银 行 | 3968 HK | 深港通 联合市 场 | 中 国 香港 | 50,000 | 1,617,725.30 | 0.68 |
| 34 | HONG KONG EXCHANGES & CLEAR | 香港交 易所 | 388 HK | 香港联 合交易 所 | 中 国 香港 | 7,000 | 1,598,467.75 | 0.67 |
| 35 | KEYMED BIOSCIENC | 康诺亚 -B | 2162 HK | 香港联 合交易 所 | 中 国 香港 | 50,000 | 1,540,147.50 | 0.64 |
| 36 | CHINA CONSTRUCT ION BANK-H | 建设银 行 | 939 HK | 香港联 合交易 所 | 中 国 香港 | 268,621 | 1,414,602.13 | 0.59 |
| 37 | H WORLD GROUP LTD | 华住集 团-S | 1179 HK | 香港联 合交易 所 | 中 国 香港 | 59,600 | 1,414,288.93 | 0.59 |
| 38 | NH HEALTH-B | 诺辉健 康 | 6606 HK | 香港联 合交易 所 | 中 国 香港 | 90,000 | 1,161,476.57 | 0.49 |
| 39 | COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H | 中远海 能 | 1138 HK | 香港联 合交易 所 | 中 国 香港 | 123,887 | 1,146,521.56 | 0.48 |
| 40 | GENSCRIPT BIOTEC | 金斯瑞 生物科 技 | 1548 HK | 深港通 联合市 场 | 中 国 香港 | 150,000 | 1,139,024.64 | 0.48 |
| 41 | YADEA GROUP HOLDINGS | 雅迪控 股 | 1585 HK | 香港联 合交易 所 | 中 国 香港 | 108,956 | 981,492.17 | 0.41 |

| | | | | | | | | |
|----|---------------------------------------|---------|--------------|---------|------|---------|------------|------|
| | LTD | | | | | | | |
| 42 | JD.COM INC-CL A | 京东集团 | 9618 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 10,000 | 942,798.44 | 0.39 |
| 43 | ZTE CORP-H | 中兴通讯 | 763 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 49,800 | 785,401.30 | 0.33 |
| 44 | XINYI GLASS HOLDINGS LTD | 信义玻璃 | 868 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 100,000 | 781,254.08 | 0.33 |
| 45 | Baidu, Inc . | 百度集团-SW | 9888 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 10,000 | 778,059.70 | 0.33 |
| 46 | TRIP.COM GROUP LTD | 携程集团-S | 9961 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 2,206 | 754,209.18 | 0.32 |
| 47 | COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H | 中远海控 | 1919 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 59,956 | 747,483.97 | 0.31 |
| 48 | SINO BIOPHARMA CEUTIC | 中国生物制药 | 1177 HK | 深港通联合市场 | 中国香港 | 300,000 | 731,056.68 | 0.31 |
| 49 | JIANGXI COPPER CO LTD-H | 江西铜业 | 358 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 50,000 | 710,977.72 | 0.30 |
| 50 | CHINA SHENHUA ENERGY CO-H | 中国神华 | 1088 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 21,440 | 703,464.54 | 0.29 |
| 51 | 许继电气 股份有限公司 | 许继电气 | 000400 SZ | 深圳证券交易所 | 中国 | 20,000 | 688,200.00 | 0.29 |
| 52 | MINISO GROUP-A | 名创优品 | 9896 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 20,000 | 683,597.32 | 0.29 |
| 53 | CHINA FEIHE LTD | 中国飞鹤 | 6186 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 193,033 | 636,000.26 | 0.27 |
| 54 | HUA HONG SEMICONDU CTOR LTD | 华虹半导体 | 1347 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 30,000 | 603,737.82 | 0.25 |
| 55 | CHINA | 海螺创 | 586 HK | 香港联 | 中国 | 81,285 | 540,082.77 | 0.23 |

| | | | | | | | | |
|----|--------------------------------------|--------|---------|---------|------|---------|------------|------|
| | CONCH VENTURE HOLDINGS | 业 | | 合交易所 | 香港 | | | |
| 56 | GREENTOWN MANAGEMENT HOLDINGS CO LTD | 绿城管理控股 | 9979 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 108,093 | 534,706.41 | 0.22 |
| 57 | CHINA HONGQIAO GROUP LTD | 中国宏桥 | 1378 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 44,750 | 482,757.52 | 0.20 |
| 58 | SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP | 申洲国际 | 2313 HK | 深港通联合市场 | 中国香港 | 5,000 | 348,871.93 | 0.15 |

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

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文） | 证券代码 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|------------------------------|---------|--------------|----------------|
| 1 | CHINA OVERSEAS LAND & INVEST | 688 HK | 4,701,848.40 | 1.73 |
| 2 | DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-H | 1072 HK | 3,531,408.89 | 1.30 |
| 3 | SUNNY OPTICAL TECH | 2382 HK | 2,262,370.56 | 0.83 |
| 4 | DONGYUE GROUP | 189 HK | 2,237,844.41 | 0.83 |
| 5 | SINOTRUK HONG KONG LTD | 3808 HK | 2,233,024.95 | 0.82 |
| 6 | HAIER SMART H-H | 6690 HK | 2,150,898.53 | 0.79 |
| 7 | FUYAO GLASS IN-H | 3606 HK | 1,843,239.14 | 0.68 |
| 8 | CNOOC LTD | 883 HK | 1,768,635.44 | 0.65 |
| 9 | H WORLD GROUP LTD | 1179 HK | 1,655,181.22 | 0.61 |
| 10 | CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 939 HK | 1,450,124.38 | 0.53 |
| 11 | LI NING CO LTD | 2331 HK | 1,439,634.68 | 0.53 |
| 12 | YADEA GROUP HOLDINGS LTD | 1585 HK | 1,423,679.59 | 0.53 |
| 13 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 9988 HK | 1,343,239.07 | 0.50 |
| 14 | Wuxi Apttec Co., Ltd. | 2359 HK | 1,313,416.49 | 0.48 |
| 15 | MAN WAH HOLDINGS | 1999 HK | 1,249,192.82 | 0.46 |

| | | | | |
|----|------------------------------|---------|--------------|------|
| 16 | COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H | 1138 HK | 1,205,763.73 | 0.44 |
| 17 | ANTA SPORTS PRODUCTS LTD | 2020 HK | 1,102,935.19 | 0.41 |
| 18 | TENCENT HOLDINGS LTD | 700 HK | 1,056,969.15 | 0.39 |
| 19 | TECHTRONIC IND | 669 HK | 1,031,594.31 | 0.38 |
| 20 | HANSOH PHARMACEU | 3692 HK | 996,810.86 | 0.37 |

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文） | 证券代码 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|----------------------------|---------|---------------|----------------|
| 1 | NETEASE INC | 9999 HK | 12,116,384.36 | 4.47 |
| 2 | TENCENT HOLDINGS LTD | 700 HK | 10,595,889.54 | 3.91 |
| 3 | MEITUAN DIANPING-CLASS B | 3690 HK | 6,672,172.52 | 2.46 |
| 4 | WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC | 2269 HK | 4,719,335.94 | 1.74 |
| 5 | GENSCRIPT BIOTEC | 1548 HK | 4,127,317.68 | 1.52 |
| 6 | FU SHOU YUAN INTERNATIONAL | 1448 HK | 3,841,245.65 | 1.42 |
| 7 | AKESO INC | 9926 HK | 3,724,204.35 | 1.37 |
| 8 | Wuxi Apptec Co.,Ltd. | 2359 HK | 3,601,926.96 | 1.33 |
| 9 | Baidu, Inc. | 9888 HK | 2,899,386.64 | 1.07 |
| 10 | DONGYUE GROUP | 189 HK | 1,985,895.71 | 0.73 |
| 11 | BEIGENE LTD | 6160 HK | 1,918,291.83 | 0.71 |
| 12 | KUAISHOU TECHNOL | 1024 HK | 1,563,621.72 | 0.58 |
| 13 | PEIJIA-B | 9996 HK | 1,460,658.78 | 0.54 |
| 14 | AIA GROUP LTD | 1299 HK | 1,420,133.97 | 0.52 |
| 15 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 9988 HK | 1,416,896.10 | 0.52 |
| 16 | CHINA MERCHANTS BANK | 3968 HK | 1,386,984.05 | 0.51 |
| 17 | ALPHAMAB ONCOLOGY | 9966 HK | 1,290,580.50 | 0.48 |
| 18 | INNOVENT BIOLOGICS INC | 1801 HK | 1,202,726.16 | 0.44 |
| 19 | JD HEALTH INTERN | 6618 HK | 1,092,096.74 | 0.40 |
| 20 | CANSINO BIOLOGICS INC-H | 6185 HK | 1,029,177.24 | 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。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

| | |
|------------|---------------|
| 买入成本（成交）总额 | 51,793,867.63 |
| 卖出收入（成交）总额 | 78,434,083.03 |

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本集合计划本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本集合计划本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本集合计划本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本集合计划本报告期末未持有基金投资。

7.11 投资组合报告附注

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

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

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本集合计划投资的前十名股票未超出集合计划合同规定的备选股票库。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|-------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收清算款 | 3,976,995.73 |
| 3 | 应收股利 | 959,066.61 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 41,076.47 |
| 6 | 其他应收款 | - |

| | | |
|---|------|--------------|
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 4,977,138.81 |

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本集合计划本报告期末未持有可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数（户） | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|-------------------|----------|-----------|---------------|-----------|----------------|-----------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例（%） | 持有份额 | 占总份额比例（%） |
| 光大阳光香港精选混合（QDII）A | 3,905 | 72,451.19 | 63,669,359.89 | 22.50 | 219,252,522.88 | 77.50 |
| 光大阳光香港精选混合（QDII）C | 4,352 | 52,918.47 | 301.96 | 0.00 | 230,300,886.20 | 100.00 |
| 合计 | 8,257 | 62,156.12 | 63,669,661.85 | 12.41 | 449,553,409.08 | 87.59 |

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 | 光大阳光香港精选混合（QDII）A | 6,104,455.44 | 2.1576 |
| | 光大阳光香港精选混合（QDII）C | 244,255.78 | 0.1061 |

| | | | |
|------|----|--------------|--------|
| 有本基金 | | | |
| | 合计 | 6,348,711.22 | 1.2370 |

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 光大阳光香港精选混合（QDII）A | >100 |
| | 光大阳光香港精选混合（QDII）C | 0 |
| | 合计 | >100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 光大阳光香港精选混合（QDII）A | - |
| | 光大阳光香港精选混合（QDII）C | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 光大阳光香港精选混合（QDII）A | 光大阳光香港精选混合（QDII）C |
|----------------------------------|-------------------|-------------------|
| 基金合同生效日 （2021年1月4日） 基金份额总额 | 43,936,167.89 | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | 292,130,206.91 | 243,693,447.14 |
| 本报告期基金总申购份额 | 3,546,281.42 | 15,629,906.05 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 12,754,605.56 | 29,022,165.03 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 282,921,882.77 | 230,301,188.16 |

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

- 1、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。
- 2、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 | 1 | 12,673,585.77 | 9.73 | 9,779.90 | 8.17 | - |

| | | | | | | |
|----------|---|---------------|-------|-----------|-------|---|
| 新鸿基 | 1 | 35,160,446.52 | 27.00 | 19,331.85 | 16.15 | - |
| 海通证券（香港） | 1 | 71,489,618.39 | 54.90 | 78,089.14 | 65.24 | - |
| 国泰君安（香港） | 1 | 10,904,299.98 | 8.37 | 12,493.08 | 10.44 | - |

注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票交易而合计支付该券商的佣金合计。

2、交易单元的选择标准和程序

(1) 选择标准

券商财务状况良好、经营行为规范，最近一年无重大违规行为；具有较强的研究服务能力；交易佣金收费合理。

(2) 选择程序

集合计划管理人根据以上标准对不同券商进行综合评价，然后根据评价选择券商，与其签订协议租用交易单元。

3、本报告期内无新增券商交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

注：本集合计划本报告期未进行债券交易、债券回购交易、基金交易以及权证交易。

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|---|------------|------------------|
| 1 | 光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII）2023 年第 4 季度报告 | 中国证监会规定的媒介 | 2024 年 01 月 22 日 |
| 2 | 光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII）2023 年年度报告 | 中国证监会规定的媒介 | 2024 年 03 月 29 日 |
| 3 | 光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII）2024 年第 1 季度报告 | 中国证监会规定的媒介 | 2024 年 04 月 22 日 |
| 4 | 光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII）基金经理变更公告 | 中国证监会规定的媒介 | 2024 年 05 月 17 日 |

| | | | |
|---|---------------|------------|------------------|
| 5 | 关于聘任投资经理助理的公告 | 中国证监会规定的媒介 | 2024 年 06 月 12 日 |
|---|---------------|------------|------------------|

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本集合计划本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

2、《光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII）资产管理合同》；

3、《光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII）托管协议》；

4、《光大阳光香港精选混合型集合资产管理计划（QDII）招募说明书》；

5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；

6、集合计划管理人业务资格批件、营业执照；

7、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

备查文件存放于集合计划管理人的办公场所：

1、中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层

12.3 查阅方式

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

上海光大证券资产管理有限公司

2024 年 8 月 30 日