

光大阳光添利债券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：中国光大银行股份有限公司

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光大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 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 7 |
| 3.2 基金净值表现 | 8 |
| 3.3 其他指标 | 9 |
| § 4 管理人报告 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 11 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 12 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 13 |
| § 5 托管人报告 | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 13 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 13 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 13 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 13 |
| 6.1 资产负债表 | 13 |
| 6.2 利润表 | 15 |
| 6.3 净资产变动表 | 16 |
| 6.4 报表附注 | 18 |
| § 7 投资组合报告 | 40 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 40 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 41 |
| 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 | 41 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 43 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 45 |

| | |
|---------------------------------------------|-----------|
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 | 45 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | 45 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 | 45 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 | 45 |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 45 |
| 7.11 投资组合报告附注 | 46 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 47 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 47 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 48 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 | 48 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 48 |
| § 10 重大事件揭示 | 49 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 49 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 | 49 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 49 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 49 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 49 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 49 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 49 |
| 10.8 其他重大事件 | 50 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 50 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 | 50 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 51 |
| § 12 备查文件目录 | 51 |
| 12.1 备查文件目录 | 51 |
| 12.2 存放地点 | 51 |
| 12.3 查阅方式 | 51 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|---------------------|---------------------------------------------------------------|-----------------|
| 基金名称 | 光大阳光添利债券型集合资产管理计划 | |
| 基金简称 | 光大阳光添利债券 | |
| 基金主代码 | 860005 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2019 年 11 月 26 日 | |
| 基金管理人 | 上海光大证券资产管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国光大银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份 额总额 | 476,092,897.96 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 | 光大阳光添利债券 A | 光大阳光添利债券 C |
| 下属分级基金的交 易代码 | 860005 | 860030 |
| 报告期末下属分级 基金的份额总额 | 452,957,566.70 份 | 23,135,331.26 份 |

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

2.2 基金产品说明

| | |
|------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 本集合计划主要投资于债券为主的固定收益类产品，辅以权益类产品，在充分考虑集合计划投资安全的基础上，实现集合计划资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>（一）资产配置策略</p> <p>本集合计划根据大类资产在不同市场环境下表现出的相关关系，对各类资产进行相对稳定的战略配置，降低组合风险，控制资产净值的波动，追求收益稳定。在此框架下，本集合计划在对各类资产在未来 3 至 6 个月的收益率与风险水平进行预测的基础上，定期对各类资产的配置比例优化，控制风险的前提下争取稳定投资收益。</p> <p>（二）固定收益类品种投资策略</p> <p>1、本集合计划采用利率预期策略和收益曲线策略等。利用市场利率波动和市场收益率曲线的动态变化构造相关资产组合以提高组合收益率。</p> <p>2、本集合计划根据不同行业及同一行业不同债券的收益水平及信用品质分析，结合信用利差的变动来配置特定债券。</p> <p>3、本集合计划通过观察市场收益率曲线的动态变化和不同期限债券的收益率基差分析，采用积极的短期交易策略来提高组合的收益水平。</p> <p>4、其他债券投资策略：对于国债、央行票据等非信用类债券投资的主要目的在于保证资产组合的流动性和灵活性，获取低风险稳定回</p> |

| | |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | <p>报。</p> <p>(三) 权益类品种的投资策略</p> <p>1、新股申购策略：通过基本面分析，参考同类公司的估值，判断一、二级市场价差，并根据过往新股情况，对新股投资的收益率进行预测，同时考虑锁定期间的投资风险以及资金成本，制定新股申购策略。</p> <p>2、股票二级市场策略：本集合计划采取自上而下的行业配置与自下而上的个股选择相结合的投资策略。在行业配置方面，除通过对包括政策、行业及市场估值等方面进行深入研究以外，根据公司的基本面以及资本回报率调整和修正折溢价，寻找合适的个股。</p> <p>(四) 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 | 沪深 300 指数收益率×15%+中债综合指数收益率×80%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5% |
| 风险收益特征 | 本集合计划为债券型集合计划，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于混合型基金、混合型集合计划、股票型基金和股票型集合计划。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 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 | 中国证券登记结算有限责任公 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

| | | |
|--|---|--|
| | 司 | |
|--|---|--|

§ 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) | |
|-------------------|---------------------------|---------------|
| | 光大阳光添利债券 A | 光大阳光添利债券 C |
| 本期已实现收益 | 6,353,499.27 | 219,925.01 |
| 本期利润 | 2,719,439.91 | 76,075.43 |
| 加权平均基金份额 本期利润 | 0.0054 | 0.0028 |
| 本期加权平均净 值利润率 | 0.22% | 0.11% |
| 本期基金份额净 值增长率 | 0.33% | 0.18% |
| 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 | 640,826,864.10 | 32,963,016.73 |
| 期末可供分配基 金份额利润 | 1.4148 | 1.4248 |
| 期末基金资产净 值 | 1,124,778,175.58 | 56,752,483.11 |
| 期末基金份额净 值 | 2.4832 | 2.4531 |
| 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 | 13.61% | 9.69% |

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

光大阳光添利债券 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 | -0.49% | 0.22% | -0.07% | 0.10% | -0.42% | 0.12% |
| 过去三个月 | 0.34% | 0.23% | 0.95% | 0.14% | -0.61% | 0.09% |
| 过去六个月 | 0.33% | 0.32% | 2.49% | 0.17% | -2.16% | 0.15% |
| 过去一年 | -1.34% | 0.26% | 0.90% | 0.17% | -2.24% | 0.09% |
| 过去三年 | 1.27% | 0.36% | -2.23% | 0.21% | 3.50% | 0.15% |
| 自基金合同生效起至今 | 13.61% | 0.35% | 4.62% | 0.22% | 8.99% | 0.13% |

光大阳光添利债券 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 | -0.52% | 0.22% | -0.07% | 0.10% | -0.45% | 0.12% |
| 过去三个月 | 0.27% | 0.23% | 0.95% | 0.14% | -0.68% | 0.09% |
| 过去六个月 | 0.18% | 0.32% | 2.49% | 0.17% | -2.31% | 0.15% |
| 过去一年 | -1.65% | 0.26% | 0.90% | 0.17% | -2.55% | 0.09% |
| 过去三年 | 0.35% | 0.36% | -2.23% | 0.21% | 2.58% | 0.15% |
| 自基金合同生效起至今 | 9.69% | 0.36% | 2.75% | 0.22% | 6.94% | 0.14% |

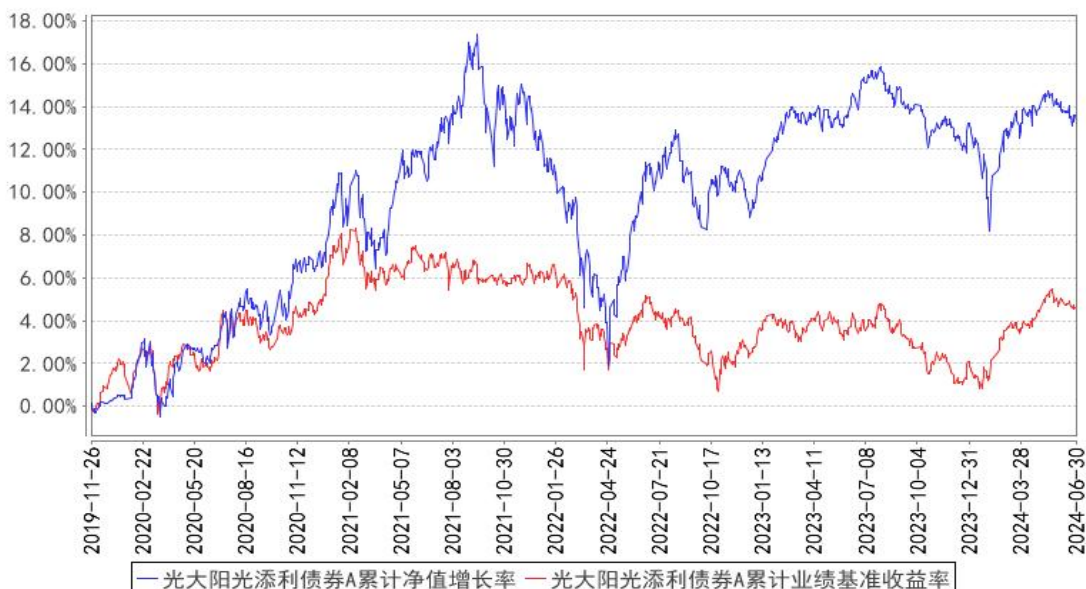
注：1、自基金合同生效起至今指 2019 年 11 月 26 日至 2024 年 6 月 30 日；

2、业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×15%+中债综合指数收益率×80%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%

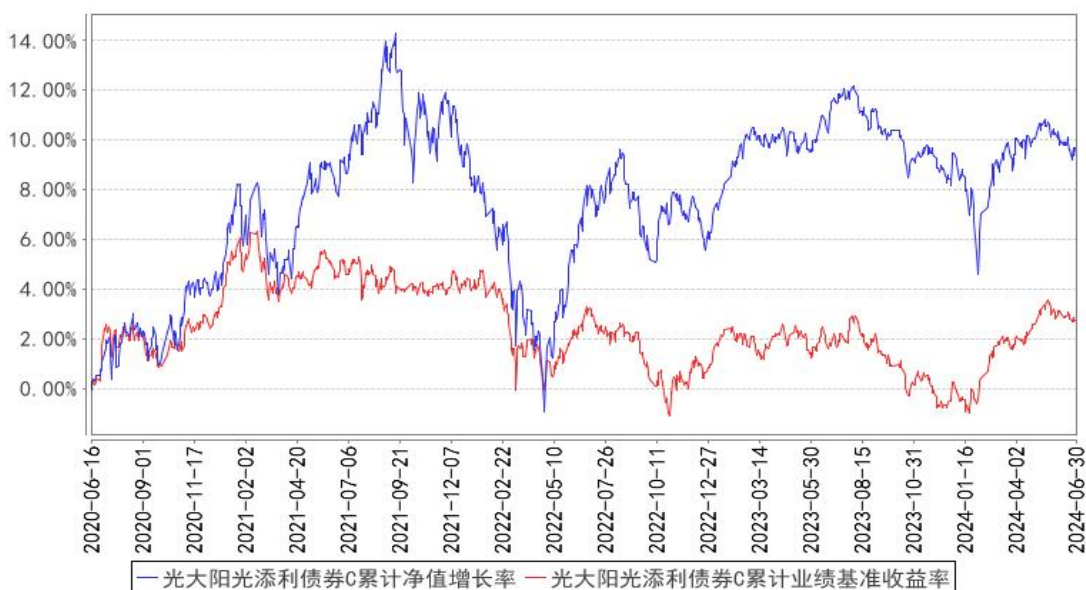
3、C 类份额设立日为 2020 年 6 月 16 日。

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

光大阳光添利债券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



光大阳光添利债券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 | | |
| 张丁 | 本集合计划投资经理 | 2019 年 11 月 26 日 | - | 16 年 | 张丁先生, 硕士学历。先后担任九富投资顾问有限公司研究员、中诚信国际信用评级有限责任公司信用评级部总经理助理、招商证券股份有限公司研究发展中心债券研究员、华商基金管理有限公司研究部债券研究员、中国国际金融股份有限公司资产管理部债券投资经理。2017 年加入光证资管, 现任公司副总经理, 担任光大阳光添利债券型集合资产管理计划、光大阳光北斗星 180 天持有债券型集合资产管理计划、光大阳光北斗星 9 个月持有期债券型集合资产管理计划投资经理。 |
| 曾炳祥 | 本集合计划投资经理 | 2021 年 7 月 8 日 | - | 7 年 | 曾炳祥先生, 硕士学历。2017 年加入光证资管, 现任混合资产公募投资部总经理, 担任光大阳光混合型集合资产管理计划、光大阳光添利债券型集合资产管理计划、光大阳光北斗星 9 个月持有期债券型集合资产管理计划投资经理。 |
| 崔宁 | 本集合计划投资经理助理 | 2022 年 8 月 17 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

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年以来债券市场整体呈现牛市格局，一季度信贷压力较去年同期有所减弱，同时地方债、国债和政金债的供给速度偏慢，市场在资产荒的压力下对于债券配置需求保持强劲。两会后政府工作报告对于全年经济增速目标设定在 5%并未超出市场预期，对地产表述温和促使债券利率进一步下行。4 月末央行严厉的喊话叠加一系列地产政策出台，债市大幅回调，市场开始交易政治局会议及地产政策放松带来的刺激效果。但是随着地产政策陆续落地，弱现实交易重新占据上风。在手工补息禁止的影响下，非银资金较为充裕，债市收益率重新下行。我们在债券部分始终保持配置思路，在提高组合流动性的同时通过波段交易增厚组合收益。

权益市场方面，今年波动较大，且风格多变，产品净值在年初也遭遇了一定回撤，借助此次机会，我们对投资框架进行了完善，上半年陆续做了以下工作：在 1-2 月份市场剧烈波动后对持仓结构进行了调整，适度提高了对大市值股票的配置比例，同时对个股的估值标准提出了更高要

求，以确保投资组合的稳健性。其次 5 月份，我们在原有的纯价值投资策略基础上，引入了低相关性策略，以分散单一策略可能带来的风险，这一举措自实施以来，已有效降低了产品的波动性。此外我们还加强了对个股的主动研究，对一些表现不佳的消费类股票进行了剔除，并提升了投资组合的分散度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日，光大阳光添利债券 A 类份额净值为 2.4832 元，本报告期份额净值增长率为 0.33%；光大阳光添利债券 C 类份额净值为 2.4531 元，本报告期份额净值增长率为 0.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

尽管上半年市场整体表现一般，但我们对下半年的 A 股市场持乐观态度，并认为存在结构性机会：

1、自 2021 年初以来，A 股市场的估值已经经历了一定程度的调整，目前市净率（PB）估值处于历史低位，这为未来一年的投资提供了较高的胜率。2、国内经济的分子端，特别是新质生产力和人工智能（AI）等新兴需求领域，正在逐渐占据更大的比重，这为市场带来了新的增长点。3、美国的通胀压力有所缓解，降息预期逐渐明确。与此同时，除了中国市场之外，海外主要股市已经对降息预期进行了定价，这使得 A 股市场成为具有吸引力的价值洼地。

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，具有基金从业资格证书。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本集合计划报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《光大阳光添利债券型集合资产管理计划 2024 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：光大阳光添利债券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 |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 14,061,781.43 | 72,623,663.89 |
| 结算备付金 | | 13,919,821.81 | 23,158,426.17 |
| 存出保证金 | | 151,612.48 | 360,378.08 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 1,322,067,527.80 | 1,709,089,555.97 |
| 其中：股票投资 | | 211,018,520.36 | 290,887,387.28 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 1,111,049,007.44 | 1,418,202,168.69 |
| 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 | 66,014,104.11 | 57,795,845.19 |
| 债权投资 | 6.4.7.5 | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | 6.4.7.6 | - | - |
| 其他权益工具投资 | 6.4.7.7 | - | - |
| 应收清算款 | | 4,856.00 | 14,696,037.57 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 45,729.84 | 27,894.70 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 1,416,265,433.47 | 1,877,751,801.57 |
| 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 | | 229,113,955.19 | 373,987,537.74 |
| 应付清算款 | | 24,502.38 | - |
| 应付赎回款 | | 4,100,610.70 | 26,384,687.07 |
| 应付管理人报酬 | | 991,155.76 | 1,285,217.70 |
| 应付托管费 | | 178,408.04 | 231,339.16 |
| 应付销售服务费 | | 14,343.61 | 19,791.56 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 56,298.77 | 109,678.18 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |

| | | | |
|-------------|----------|------------------|------------------|
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 255,500.33 | 577,113.61 |
| 负债合计 | | 234,734,774.78 | 402,595,365.02 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 476,092,897.96 | 596,347,465.24 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | 705,437,760.73 | 878,808,971.31 |
| 净资产合计 | | 1,181,530,658.69 | 1,475,156,436.55 |
| 负债和净资产总计 | | 1,416,265,433.47 | 1,877,751,801.57 |

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，集合计划份额总额 476,092,897.96 份。光大阳光添利 A 集合计划份额净值 2.4832 元，集合计划份额 452,957,566.70 份，集合计划资产净值 1,124,778,175.58 元。光大阳光添利 C 集合计划份额净值 2.4531 元，集合计划份额 23,135,331.26 份，集合计划资产净值 56,752,483.11 元。

6.2 利润表

会计主体：光大阳光添利债券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 | 上年度可比期间 |
|-----------------------|----------|---------------------------------|---------------------------------|
| | | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 一、营业总收入 | | 14,370,674.76 | 137,207,165.09 |
| 1. 利息收入 | | 737,412.13 | 1,484,252.66 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 663,102.92 | 842,550.60 |
| 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 | | 74,309.21 | 641,702.06 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 17,391,112.71 | 51,543,465.72 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | -6,523,329.37 | 28,938,877.48 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.15 | 17,753,129.64 | 11,710,367.10 |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.16 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.17 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.18 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.19 | 6,161,312.44 | 10,894,221.14 |
| 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 | -3,777,908.94 | 83,897,216.53 |
| 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 | 20,058.86 | 282,230.18 |
| 减：二、营业总支出 | | 11,575,159.42 | 20,437,240.69 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 6,541,675.43 | 11,422,968.23 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 1,177,501.58 | 2,056,134.19 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 100,374.06 | 454,568.95 |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 3,587,628.42 | 6,255,830.80 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 3,587,628.42 | 6,255,830.80 |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.22 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 54,568.01 | 147,131.90 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.23 | 113,411.92 | 100,606.62 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 2,795,515.34 | 116,769,924.40 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 2,795,515.34 | 116,769,924.40 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 2,795,515.34 | 116,769,924.40 |

6.3 净资产变动表

会计主体：光大阳光添利债券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 | 596,347,465.24 | - | 878,808,971.31 | 1,475,156,436.55 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |

| | | | | |
|------------------------------------------|----------------------|--------|------------------|------------------|
| 二、本期期初净资产 | 596,347,465.24 | - | 878,808,971.31 | 1,475,156,436.55 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -120,254,567.28 | - | -173,371,210.58 | -293,625,777.86 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 2,795,515.34 | 2,795,515.34 |
| (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) | -120,254,567.28 | - | -176,166,725.92 | -296,421,293.20 |
| 其中：1. 基金申购款 | 3,319,515.51 | - | 4,843,945.65 | 8,163,461.16 |
| 2. 基金赎回款 | -123,574,082.79 | - | -181,010,671.57 | -304,584,754.36 |
| (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 | 476,092,897.96 | - | 705,437,760.73 | 1,181,530,658.69 |
| 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 | 1,023,264,054.92 | - | 1,424,423,890.78 | 2,447,687,945.70 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 1,023,264,054.92 | - | 1,424,423,890.78 | 2,447,687,945.70 |

| | | | | |
|------------------------------------------|-----------------|---|------------------|------------------|
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -191,516,843.78 | - | -165,423,348.85 | -356,940,192.63 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 116,769,924.40 | 116,769,924.40 |
| (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) | -191,516,843.78 | - | -282,193,273.25 | -473,710,117.03 |
| 其中：1. 基金申购款 | 55,676,000.36 | - | 82,251,337.35 | 137,927,337.71 |
| 2. 基金赎回款 | -247,192,844.14 | - | -364,444,610.60 | -611,637,454.74 |
| (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 | 831,747,211.14 | - | 1,259,000,541.93 | 2,090,747,753.07 |

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

光大阳光添利债券型集合资产管理计划是由光大阳光 5 号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 2019 年 11 月 14 日发布《光大阳光 5 号集合资产管理计划合同变更公告》。根据公告，光大阳光 5 号集合资产管理计划名称变更为“光大阳光添利债券型集合资产管理计划”，光大阳光 5 号集合资产管理计划份额转换为光大阳光添利债券型集合

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 2019 年 11 月 26 日起《光大阳光添利债券型集合资产管理计划资产管理合同》、《光大阳光添利债券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，托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《光大阳光添利债券型集合资产管理计划资产管理合同》的有关规定，本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、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、可交换债券、可转换债券（含分离型可转换债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款等；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上市或注册的股票）、港股通标的股票以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本集合计划的投资组合比例为：债券资产的比例不低于集合计划资产的 80%；投资于股票等权益类资产的投资比例合计不超过集合计划资产的 20%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%）；现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于集合计划资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本集合计划不参与融资融券业务。

本集合计划的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×15%+中债综合指数收益率×80%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本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) 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 | 14,061,781.43 |
| 等于：本金 | 14,040,789.81 |
| 加：应计利息 | 20,991.62 |
| 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 | 14,061,781.43 |

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 | 212,063,871.45 | - | 211,018,520.36 | -1,045,351.09 | |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市场 | 365,347,333.12 | 5,482,728.40 | 371,871,633.25 | 1,041,571.73 |
| | 银行间市场 | 724,294,030.54 | 10,242,974.19 | 739,177,374.19 | 4,640,369.46 |
| | 合计 | 1,089,641,363.66 | 15,725,702.59 | 1,111,049,007.44 | 5,681,941.19 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - | |
| 基金 | - | - | - | - | |
| 其他 | - | - | - | - | |
| 合计 | 1,301,705,235.11 | 15,725,702.59 | 1,322,067,527.80 | 4,636,590.10 | |

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

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 | - | - |
| 银行间市场 | 66,014,104.11 | - |
| 合计 | 66,014,104.11 | - |

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本集合于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 | 643.73 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 166,342.72 |
| 其中：交易所市场 | 137,400.77 |
| 银行间市场 | 28,941.95 |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 88,513.88 |
| 合计 | 255,500.33 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

光大阳光添利债券 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 | 565,299,461.52 | 565,299,461.52 |
| 本期申购 | 2,711,195.36 | 2,711,195.36 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -115,053,090.18 | -115,053,090.18 |
| 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 | 452,957,566.70 | 452,957,566.70 |

光大阳光添利债券 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 | 31,048,003.72 | 31,048,003.72 |
| 本期申购 | 608,320.15 | 608,320.15 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -8,520,992.61 | -8,520,992.61 |
| 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 | 23,135,331.26 | 23,135,331.26 |

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

光大阳光添利债券 A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|-----------------|---------------|-----------------|
| 上年度末 | 791,689,910.84 | 42,140,693.19 | 833,830,604.03 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | 791,689,910.84 | 42,140,693.19 | 833,830,604.03 |
| 本期利润 | 6,353,499.27 | -3,634,059.36 | 2,719,439.91 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -157,216,546.01 | -7,512,889.05 | -164,729,435.06 |
| 其中：基金申购款 | 3,780,018.02 | 187,390.48 | 3,967,408.50 |

| | | | |
|---------|-----------------|---------------|-----------------|
| 基金赎回款 | -160,996,564.03 | -7,700,279.53 | -168,696,843.56 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 640,826,864.10 | 30,993,744.78 | 671,820,608.88 |

光大阳光添利债券 C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|--------------|----------------|
| 上年度末 | 43,912,490.12 | 1,065,877.16 | 44,978,367.28 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | 43,912,490.12 | 1,065,877.16 | 44,978,367.28 |
| 本期利润 | 219,925.01 | -143,849.58 | 76,075.43 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -11,169,398.40 | -267,892.46 | -11,437,290.86 |
| 其中：基金申购款 | 855,643.99 | 20,893.16 | 876,537.15 |
| 基金赎回款 | -12,025,042.39 | -288,785.62 | -12,313,828.01 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 32,963,016.73 | 654,135.12 | 33,617,151.85 |

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 | 523,963.28 |
| 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 | 136,880.98 |
| 其他 | 2,258.66 |
| 合计 | 663,102.92 |

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 | -6,523,329.37 |
| 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 | -6,523,329.37 |

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 | 695,248,465.08 |
| 减：卖出股票成本总额 | 701,012,606.70 |
| 减：交易费用 | 759,187.75 |
| 买卖股票差价收入 | -6,523,329.37 |

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 | 22,000,660.91 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -4,247,531.27 |
| 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 | 17,753,129.64 |

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 | 1,442,447,258.93 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,424,667,953.30 |
| 减：应计利息总额 | 22,001,581.54 |
| 减：交易费用 | 25,255.36 |
| 买卖债券差价收入 | -4,247,531.27 |

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买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期无资产支持证券赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期无资产支持证券申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本集合计划本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本集合本报告期无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本集合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

本集合计划本报告期无衍生工具其他投资收益。

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 | 6,161,312.44 |
| 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 | 6,161,312.44 |

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 | -3,777,908.94 |
| 股票投资 | -10,760,377.94 |
| 债券投资 | 6,982,469.00 |
| 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 | -3,777,908.94 |

6.4.7.21 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 | 20,058.86 |
| 合计 | 20,058.86 |

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 | 28,841.54 |
| 信息披露费 | 59,672.34 |
| 证券出借违约金 | - |
| 账户维护费 | 24,898.04 |
| 合计 | 113,411.92 |

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本集合计划未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本集合计划无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本集合本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|------------------------|---------------------|
| 上海光大证券资产管理有限公司（“光证资管”） | 集合计划管理人、集合计划销售机构 |
| 中国光大银行股份有限公司 | 集合计划托管人、集合计划代销机构 |
| 光大证券股份有限公司（“光大证券”） | 集合计划销售机构、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 | 1,327,152,582.80 | 100.00 | 683,180,646.64 | 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 | 170,502,904.27 | 100.00 | 1,612,619,064.40 | 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 | 16,825,000,000.00 | 100.00 | 28,301,600,000.00 | 100.00 |

6.4.10.1.4 权证交易

本集合计划本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 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 | 326,386.69 | 100.00 | 137,400.77 | 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 | 166,311.15 | 100.00 | 93,378.86 | 100.00 |

注：1、上述佣金按市场佣金率计算。

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 | 6,541,675.43 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护 费 | 3,115,320.64 | 5,289,492.67 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 3,426,354.79 | 6,133,475.56 |

注：本集合计划管理费按前一日集合计划资产净值的1.0%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 | 上年度可比期间 |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 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 | 1,177,501.58 | 2,056,134.19 |

注：本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的 0.18% 的年费率计提。托管费计算方法如下：

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

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 | | |
| | 光大阳光添利债券 A | 光大阳光添利债券 C | 合计 |
| 光大证券 | - | 5,515.66 | 5,515.66 |
| 光证资管 | - | 1,812.43 | 1,812.43 |
| 合计 | - | 7,328.09 | 7,328.09 |
| 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 | | |
| | 光大阳光添利债券 A | 光大阳光添利债券 C | 合计 |
| 光大证券 | - | 298,761.42 | 298,761.42 |
| 光证资管 | - | 2,168.88 | 2,168.88 |
| 合计 | - | 300,930.30 | 300,930.30 |

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 0.3%，销售服务费按前一日 C 类份额的集合计划资产净值的 0.3% 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及上年度可比期间未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及上年度可比期间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

本集合计划本报告期及上年度可比期间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自有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间管理人未运用自有资金投资本集合计划。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除管理人之外的其他关联方未投资本集合计划。

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 |
| 中国光大银行股份有限公司 | 14,061,781.43 | 523,963.28 | 156,198,977.55 | 643,708.73 |

注：本集合计划的银行存款由集合计划托管人保管，按银行约定利率计息。

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及上年度可比期间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末未进行利润分配。

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

本集合计划本报告期末未持有的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

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本集合计划从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 129,113,955.19 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量（张） | 期末估值总额 |
|-----------|----------------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 102280002 | 22 开福城投 MTN001 | 2024 年 7 月 1 日 | 102.36 | 38,000 | 3,889,619.37 |
| 230024 | 23 附息国债 24 | 2024 年 7 月 3 日 | 101.85 | 600,000 | 61,110,622.95 |
| 230208 | 23 国开 08 | 2024 年 7 月 3 日 | 102.20 | 53,000 | 5,416,358.96 |
| 240301 | 24 进出 01 | 2024 年 7 月 3 日 | 101.09 | 400,000 | 40,435,912.57 |
| 2028014 | 20 中国银行永续债 01 | 2024 年 7 月 4 日 | 101.72 | 274,000 | 27,871,835.51 |
| 合计 | | | | 1,365,000 | 138,724,349.36 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本集合计划从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 100,000,000.00 元，于 2024 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本集合计划在回购期内持有的证券交易所交易的债券和在质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

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 | 172,953,727.86 | 192,089,211.81 |
| 合计 | 172,953,727.86 | 192,089,211.81 |

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。未评级中包含国债、政策性金融债、短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2024年6月30日 | 上年度末 2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | 590,946,694.69 | 618,759,239.04 |
| AAA 以下 | 133,871,046.84 | 353,084,765.48 |
| 未评级 | 213,277,538.05 | 254,268,952.36 |
| 合计 | 938,095,279.58 | 1,226,112,956.88 |

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。未评级中包含国债、政策性金融债，未有第三方评级的其他债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指集合计划管理人未能以合理价格及时变现集合计划资产以支付投资者赎回款项的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于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 | 14,061,781.43 | - | - | - | 14,061,781.43 |
| 结算备付金 | 13,919,821.81 | - | - | - | 13,919,821.81 |
| 存出保证金 | 151,612.48 | - | - | - | 151,612.48 |
| 交易性金融资产 | 588,163,827.36 | 452,728,334.26 | 70,156,845.82 | 211,018,520.36 | 1,322,067,527.80 |
| 买入返售金融资产 | 66,014,104.11 | - | - | - | 66,014,104.11 |
| 应收申购款 | - | - | - | 45,729.84 | 45,729.84 |
| 应收清算款 | - | - | - | 4,856.00 | 4,856.00 |

| | | | | | |
|--------------------------|----------------|----------------|---------------|----------------|------------------|
| 资产总计 | 682,311,147.19 | 452,728,334.26 | 70,156,845.82 | 211,069,106.20 | 1,416,265,433.47 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 4,100,610.70 | 4,100,610.70 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 991,155.76 | 991,155.76 |
| 应付托管费 | - | - | - | 178,408.04 | 178,408.04 |
| 应付清算款 | - | - | - | 24,502.38 | 24,502.38 |
| 卖出回购金融资产款 | 229,113,955.19 | - | - | - | 229,113,955.19 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 14,343.61 | 14,343.61 |
| 应交税费 | - | - | - | 56,298.77 | 56,298.77 |
| 其他负债 | - | - | - | 255,500.33 | 255,500.33 |
| 负债总计 | 229,113,955.19 | - | - | 5,620,819.59 | 234,734,774.78 |
| 利率敏感度缺口 | 453,197,192.00 | 452,728,334.26 | 70,156,845.82 | 205,448,286.61 | 1,181,530,658.69 |
| 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 | 72,623,663.89 | - | - | - | 72,623,663.89 |
| 结算备付金 | 23,158,426.17 | - | - | - | 23,158,426.17 |
| 存出保证金 | 360,378.08 | - | - | - | 360,378.08 |
| 交易性金融资产 | 729,418,860.18 | 616,667,398.43 | 72,115,910.08 | 290,887,387.28 | 1,709,089,555.97 |
| 买入返售金融资产 | 57,795,845.19 | - | - | - | 57,795,845.19 |
| 应收申购款 | - | - | - | 27,894.70 | 27,894.70 |
| 应收清算款 | - | - | - | 14,696,037.57 | 14,696,037.57 |
| 资产总计 | 883,357,173.51 | 616,667,398.43 | 72,115,910.08 | 305,611,319.55 | 1,877,751,801.57 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 26,384,687.07 | 26,384,687.07 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,285,217.70 | 1,285,217.70 |
| 应付托管费 | - | - | - | 231,339.16 | 231,339.16 |
| 卖出回购金融资产款 | 373,987,537.74 | - | - | - | 373,987,537.74 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 19,791.56 | 19,791.56 |
| 应交税费 | - | - | - | 109,678.18 | 109,678.18 |
| 其他负债 | - | - | - | 577,113.61 | 577,113.61 |
| 负债总计 | 373,987,537.74 | - | - | 28,607,827.28 | 402,595,365.02 |
| 利率敏感度缺口 | 509,369,635.77 | 616,667,398.43 | 72,115,910.08 | 277,003,492.27 | 1,475,156,436.55 |

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 个基点 | 4,831,737.75 | 4,899,086.75 |
| | 市场利率上升 25 个基点 | -4,831,737.75 | -4,899,086.75 |

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，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

本集合计划本报告期末及上年度末无外汇风险敞口。

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及上年度末无外汇风险敞口。

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 | 211,018,520.36 | 17.86 | 290,887,387.28 | 19.72 |
| 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 | 211,018,520.36 | 17.86 | 290,887,387.28 | 19.72 |

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% | 10,917,356.07 | 14,330,167.61 |
| 沪深 300 指数下降 5% | -10,917,356.07 | -14,330,167.61 | |

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 | 247,238,048.39 | 372,345,562.75 |
| 第二层次 | 1,074,829,479.41 | 1,336,743,993.22 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 1,322,067,527.80 | 1,709,089,555.97 |

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 | 211,018,520.36 | 14.90 |
| | 其中：股票 | 211,018,520.36 | 14.90 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 1,111,049,007.44 | 78.45 |
| | 其中：债券 | 1,111,049,007.44 | 78.45 |
| | 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 | 66,014,104.11 | 4.66 |
| | 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 | 27,981,603.24 | 1.98 |
| 8 | 其他各项资产 | 202,198.32 | 0.01 |
| 9 | 合计 | 1,416,265,433.47 | 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 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 155,764,859.76 | 13.18 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 12,631,729.00 | 1.07 |
| E | 建筑业 | 2,149,248.60 | 0.18 |
| F | 批发和零售业 | 11,176,251.80 | 0.95 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 4,439,040.00 | 0.38 |
| H | 住宿和餐饮业 | 2,015,520.00 | 0.17 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 20,293,347.20 | 1.72 |
| J | 金融业 | 2,548,524.00 | 0.22 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 211,018,520.36 | 17.86 |

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 | 600582 | 天地科技 | 1,707,900 | 11,767,431.00 | 1.00 |
| 2 | 603889 | 新澳股份 | 1,417,970 | 10,975,087.80 | 0.93 |
| 3 | 300349 | 金卡智能 | 700,760 | 8,353,059.20 | 0.71 |
| 4 | 601567 | 三星医疗 | 234,000 | 8,190,000.00 | 0.69 |
| 5 | 000157 | 中联重科 | 790,200 | 6,068,736.00 | 0.51 |
| 6 | 002154 | 报喜鸟 | 1,102,600 | 5,998,144.00 | 0.51 |
| 7 | 601311 | 骆驼股份 | 698,800 | 5,604,376.00 | 0.47 |
| 8 | 600887 | 伊利股份 | 202,300 | 5,227,432.00 | 0.44 |
| 9 | 600406 | 国电南瑞 | 189,500 | 4,729,920.00 | 0.40 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 10 | 600660 | 福耀玻璃 | 95,300 | 4,564,870.00 | 0.39 |
| 11 | 601018 | 宁波港 | 1,305,600 | 4,439,040.00 | 0.38 |
| 12 | 002533 | 金杯电工 | 440,100 | 4,378,995.00 | 0.37 |
| 13 | 002014 | 永新股份 | 408,342 | 3,871,082.16 | 0.33 |
| 14 | 600886 | 国投电力 | 197,400 | 3,600,576.00 | 0.30 |
| 15 | 002763 | 汇洁股份 | 460,300 | 3,051,789.00 | 0.26 |
| 16 | 600025 | 华能水电 | 258,800 | 2,789,864.00 | 0.24 |
| 17 | 605599 | 菜百股份 | 210,900 | 2,684,757.00 | 0.23 |
| 18 | 002674 | 兴业科技 | 259,400 | 2,651,068.00 | 0.22 |
| 19 | 002322 | 理工能科 | 165,400 | 2,649,708.00 | 0.22 |
| 20 | 603508 | 思维列控 | 129,800 | 2,433,750.00 | 0.21 |
| 21 | 000538 | 云南白药 | 46,100 | 2,358,015.00 | 0.20 |
| 22 | 601728 | 中国电信 | 375,200 | 2,307,480.00 | 0.20 |
| 23 | 002938 | 鹏鼎控股 | 58,000 | 2,306,080.00 | 0.20 |
| 24 | 000338 | 潍柴动力 | 141,800 | 2,302,832.00 | 0.19 |
| 25 | 601766 | 中国中车 | 304,900 | 2,289,799.00 | 0.19 |
| 26 | 300433 | 蓝思科技 | 124,600 | 2,273,950.00 | 0.19 |
| 27 | 002106 | 莱宝高科 | 207,700 | 2,263,930.00 | 0.19 |
| 28 | 600050 | 中国联通 | 479,400 | 2,253,180.00 | 0.19 |
| 29 | 600795 | 国电电力 | 368,900 | 2,209,711.00 | 0.19 |
| 30 | 600694 | 大商股份 | 130,720 | 2,197,403.20 | 0.19 |
| 31 | 300193 | 佳士科技 | 296,100 | 2,197,062.00 | 0.19 |
| 32 | 002026 | 山东威达 | 264,400 | 2,194,520.00 | 0.19 |
| 33 | 601369 | 陕鼓动力 | 273,100 | 2,190,262.00 | 0.19 |
| 34 | 002998 | 优彩资源 | 384,500 | 2,180,115.00 | 0.18 |
| 35 | 600219 | 南山铝业 | 571,300 | 2,176,653.00 | 0.18 |
| 36 | 002745 | 木林森 | 270,000 | 2,176,200.00 | 0.18 |
| 37 | 603518 | 锦泓集团 | 247,100 | 2,174,480.00 | 0.18 |
| 38 | 002282 | 博深股份 | 339,600 | 2,170,044.00 | 0.18 |
| 39 | 003036 | 泰坦股份 | 269,700 | 2,154,903.00 | 0.18 |
| 40 | 000411 | 英特集团 | 223,720 | 2,154,423.60 | 0.18 |
| 41 | 002601 | 龙佰集团 | 115,900 | 2,152,263.00 | 0.18 |
| 42 | 600000 | 浦发银行 | 261,300 | 2,150,499.00 | 0.18 |
| 43 | 000928 | 中钢国际 | 387,252 | 2,149,248.60 | 0.18 |
| 44 | 000651 | 格力电器 | 54,700 | 2,145,334.00 | 0.18 |
| 45 | 002206 | 海利得 | 561,000 | 2,143,020.00 | 0.18 |
| 46 | 600874 | 创业环保 | 382,500 | 2,138,175.00 | 0.18 |
| 47 | 002048 | 宁波华翔 | 164,900 | 2,133,806.00 | 0.18 |
| 48 | 600511 | 国药股份 | 69,200 | 2,130,668.00 | 0.18 |
| 49 | 300439 | 美康生物 | 232,600 | 2,130,616.00 | 0.18 |
| 50 | 002415 | 海康威视 | 68,900 | 2,129,699.00 | 0.18 |
| 51 | 603515 | 欧普照明 | 122,700 | 2,127,618.00 | 0.18 |
| 52 | 601163 | 三角轮胎 | 139,600 | 2,124,712.00 | 0.18 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 53 | 000951 | 中国重汽 | 148,300 | 2,123,656.00 | 0.18 |
| 54 | 603897 | 长城科技 | 121,000 | 2,123,550.00 | 0.18 |
| 55 | 002236 | 大华股份 | 136,900 | 2,116,474.00 | 0.18 |
| 56 | 600409 | 三友化工 | 421,000 | 2,113,420.00 | 0.18 |
| 57 | 603035 | 常熟汽饰 | 166,100 | 2,106,148.00 | 0.18 |
| 58 | 600966 | 博汇纸业 | 438,000 | 2,093,640.00 | 0.18 |
| 59 | 601717 | 郑煤机 | 141,400 | 2,092,720.00 | 0.18 |
| 60 | 605009 | 豪悦护理 | 52,900 | 2,086,376.00 | 0.18 |
| 61 | 002563 | 森马服饰 | 358,600 | 2,083,466.00 | 0.18 |
| 62 | 603610 | 麒盛科技 | 207,400 | 2,049,112.00 | 0.17 |
| 63 | 600258 | 首旅酒店 | 163,200 | 2,015,520.00 | 0.17 |
| 64 | 603368 | 柳药集团 | 114,800 | 2,009,000.00 | 0.17 |
| 65 | 000030 | 富奥股份 | 401,600 | 1,971,856.00 | 0.17 |
| 66 | 603833 | 欧派家居 | 36,700 | 1,965,652.00 | 0.17 |
| 67 | 600362 | 江西铜业 | 52,300 | 1,238,464.00 | 0.10 |
| 68 | 600642 | 申能股份 | 139,900 | 1,235,317.00 | 0.10 |
| 69 | 002001 | 新和成 | 60,400 | 1,159,680.00 | 0.10 |
| 70 | 600690 | 海尔智家 | 34,500 | 979,110.00 | 0.08 |
| 71 | 600989 | 宝丰能源 | 48,900 | 847,437.00 | 0.07 |
| 72 | 600066 | 宇通客车 | 28,400 | 732,720.00 | 0.06 |
| 73 | 600236 | 桂冠电力 | 85,800 | 658,086.00 | 0.06 |
| 74 | 002028 | 思源电气 | 6,000 | 401,400.00 | 0.03 |
| 75 | 600926 | 杭州银行 | 30,500 | 398,025.00 | 0.03 |
| 76 | 300308 | 中际旭创 | 1,460 | 201,304.80 | 0.02 |

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

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1 | 002415 | 海康威视 | 12,035,133.00 | 0.82 |
| 2 | 002611 | 东方精工 | 9,572,396.14 | 0.65 |
| 3 | 600887 | 伊利股份 | 9,545,626.00 | 0.65 |
| 4 | 600104 | 上汽集团 | 8,833,384.00 | 0.60 |
| 5 | 601311 | 骆驼股份 | 7,809,027.00 | 0.53 |
| 6 | 300898 | 熊猫乳品 | 7,411,382.00 | 0.50 |
| 7 | 000951 | 中国重汽 | 7,380,157.00 | 0.50 |
| 8 | 605288 | 凯迪股份 | 7,370,357.00 | 0.50 |
| 9 | 301127 | 天源环保 | 7,355,022.91 | 0.50 |
| 10 | 301133 | 金钟股份 | 7,344,636.35 | 0.50 |
| 11 | 002730 | 电光科技 | 7,059,415.00 | 0.48 |
| 12 | 002998 | 优彩资源 | 6,670,228.00 | 0.45 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 13 | 000157 | 中联重科 | 6,527,109.00 | 0.44 |
| 14 | 002763 | 汇洁股份 | 5,229,349.00 | 0.35 |
| 15 | 000338 | 潍柴动力 | 5,016,302.00 | 0.34 |
| 16 | 603317 | 天味食品 | 4,991,306.79 | 0.34 |
| 17 | 688069 | 德林海 | 4,933,674.99 | 0.33 |
| 18 | 600741 | 华域汽车 | 4,834,184.40 | 0.33 |
| 19 | 002791 | 坚朗五金 | 4,823,082.00 | 0.33 |
| 20 | 600703 | 三安光电 | 4,641,207.22 | 0.31 |

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 | 002611 | 东方精工 | 17,007,174.00 | 1.15 |
| 2 | 002415 | 海康威视 | 10,205,725.00 | 0.69 |
| 3 | 601012 | 隆基绿能 | 9,338,913.84 | 0.63 |
| 4 | 002460 | 赣锋锂业 | 9,245,951.12 | 0.63 |
| 5 | 600887 | 伊利股份 | 8,774,144.00 | 0.59 |
| 6 | 600104 | 上汽集团 | 8,704,267.00 | 0.59 |
| 7 | 002241 | 歌尔股份 | 8,486,780.00 | 0.58 |
| 8 | 000425 | 徐工机械 | 7,273,358.00 | 0.49 |
| 9 | 300898 | 熊猫乳品 | 6,954,726.00 | 0.47 |
| 10 | 002730 | 电光科技 | 6,929,363.00 | 0.47 |
| 11 | 603960 | 克来机电 | 6,805,465.00 | 0.46 |
| 12 | 301133 | 金钟股份 | 6,750,607.00 | 0.46 |
| 13 | 002938 | 鹏鼎控股 | 6,684,783.00 | 0.45 |
| 14 | 301127 | 天源环保 | 6,633,736.48 | 0.45 |
| 15 | 605288 | 凯迪股份 | 6,468,380.40 | 0.44 |
| 16 | 000538 | 云南白药 | 6,460,393.00 | 0.44 |
| 17 | 002130 | 沃尔核材 | 5,641,994.83 | 0.38 |
| 18 | 603317 | 天味食品 | 5,273,878.72 | 0.36 |
| 19 | 002763 | 汇洁股份 | 5,258,102.00 | 0.36 |
| 20 | 000786 | 北新建材 | 5,256,487.00 | 0.36 |

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 | 631,904,117.72 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 695,248,465.08 |

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 | 98,057,709.90 | 8.30 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 378,953,208.64 | 32.07 |
| | 其中：政策性金融债 | 72,512,893.30 | 6.14 |
| 4 | 企业债券 | 308,971,657.05 | 26.15 |
| 5 | 企业短期融资券 | 71,407,192.34 | 6.04 |
| 6 | 中期票据 | 217,439,711.48 | 18.40 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 36,219,528.03 | 3.07 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 1,111,049,007.44 | 94.03 |

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 | 2128038 | 21 农业银行永续债 01 | 600,000 | 63,656,301.64 | 5.39 |
| 2 | 230024 | 23 附息国债 24 | 600,000 | 61,110,622.95 | 5.17 |
| 3 | 2028014 | 20 中国银行永续债 01 | 400,000 | 40,688,810.96 | 3.44 |
| 4 | 115020 | 23 中证 G4 | 400,000 | 40,622,279.45 | 3.44 |
| 5 | 240301 | 24 进出 01 | 400,000 | 40,435,912.57 | 3.42 |

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本集合本报告期末未进行国债期货投资。

7.10.2 本期国债期货投资评价

根据本集合计划合同的约定，本集合计划投资范围不包括国债期货。

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

本报告编制日前一年内：

1) 本集合计划持有的“20 中国银行永续债 01”债券发行主体因违反反洗钱法，于 2023 年 12 月 1 日被中国人民银行没收违法所得 37.34 万元，并罚款 3664.2 万元；因信息报送异常不及时整改，于 2024 年 1 月 5 日被国家金融监督管理总局罚款 430 万元；因未依法履行职责，于 2024 年 4 月 3 日被国家外汇管理局北京市分局处罚，罚款 40 万元，没收违法所得 0.22 万元；

2) 本集合计划持有的“21 农业银行永续债 01”发债主体因内部制度不完善，违规经营，于 2023 年 8 月 18 日被国家金融监督管理总局没收违法所得 60.09 万元，罚款 1760.09 万元；因未依法履行职责，于 2023 年 11 月 17 日被国家外汇管理局没收违法所得 141.85 万，警告罚款 553 万元；因违规经营，于 2023 年 12 月 1 日被国家金融监督管理总局罚款 570.97 万元；

3) 本集合计划持有的“23 中证 G4”发行主体因未依法履行职责，于 2024 年 4 月 30 日被中国证监会没收违法所得 191.07 万元，罚款 2325 万元；

4) 本集合计划持有的“23 建行永续债 02”因违规经营，于 2023 年 12 月 1 日被国家金融监督管理总局罚款 2041.88 万元，因违规经营，于 2024 年 1 月 5 日，被国家金融监督管理总局罚款 170 万元；

5) 本集合计划持有的“20 邮储银行永续债”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。

7.11.2 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有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 | 151,612.48 |
| 2 | 应收清算款 | 4,856.00 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 45,729.84 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |

| | | |
|---|----|------------|
| 9 | 合计 | 202,198.32 |
|---|----|------------|

7.11.4 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 | 127070 | 大中转债 | 3,221,685.63 | 0.27 |
| 2 | 113549 | 白电转债 | 3,152,643.00 | 0.27 |
| 3 | 113058 | 友发转债 | 3,128,793.49 | 0.26 |
| 4 | 113664 | 大元转债 | 3,047,935.84 | 0.26 |
| 5 | 111000 | 起帆转债 | 3,007,687.51 | 0.25 |
| 6 | 113663 | 新化转债 | 2,856,888.32 | 0.24 |
| 7 | 113064 | 东材转债 | 1,976,849.33 | 0.17 |
| 8 | 113602 | 景 20 转债 | 1,729,168.07 | 0.15 |
| 9 | 123184 | 天阳转债 | 1,553,757.90 | 0.13 |
| 10 | 123172 | 漱玉转债 | 1,508,821.41 | 0.13 |
| 11 | 113627 | 太平转债 | 1,459,205.85 | 0.12 |
| 12 | 123150 | 九强转债 | 1,453,330.29 | 0.12 |
| 13 | 128090 | 汽模转 2 | 1,445,998.52 | 0.12 |
| 14 | 123050 | 聚飞转债 | 1,406,747.35 | 0.12 |
| 15 | 118003 | 华兴转债 | 1,390,105.07 | 0.12 |
| 16 | 110090 | 爱迪转债 | 1,345,632.58 | 0.11 |
| 17 | 127088 | 赫达转债 | 1,287,082.94 | 0.11 |
| 18 | 113530 | 大丰转债 | 1,247,194.93 | 0.11 |

7.11.5 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。

7.11.6 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 (%) |
| 光大阳光添利债券 | 52,608 | 8,610.05 | 339,795.35 | 0.08 | 452,617,771.35 | 99.92 |

| | | | | | | |
|------------|--------|----------|------------|------|----------------|--------|
| A | | | | | | |
| 光大阳光添利债券 C | 8,775 | 2,636.50 | - | - | 23,135,331.26 | 100.00 |
| 合计 | 61,383 | 7,756.10 | 339,795.35 | 0.07 | 475,753,102.61 | 99.93 |

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 | 光大阳光添利债券 A | 253,813.95 | 0.0560 |
| | 光大阳光添利债券 C | 180,755.75 | 0.7813 |
| | 合计 | 434,569.70 | 0.0913 |

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金 | 光大阳光添利债券 A | 0~10 |
| | 光大阳光添利债券 C | 10~50 |
| | 合计 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 光大阳光添利债券 A | 0 |
| | 光大阳光添利债券 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 光大阳光添利债券 A | 光大阳光添利债券 C |
|---------------------------------|----------------|---------------|
| 基金合同生效日（2019 年 11 月 26 日）基金份额总额 | 104,353,867.66 | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | 565,299,461.52 | 31,048,003.72 |

| | | |
|---------------|----------------|---------------|
| 本报告期基金总申购份额 | 2,711,195.36 | 608,320.15 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 115,053,090.18 | 8,520,992.61 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 452,957,566.70 | 23,135,331.26 |

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末改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员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 | 股票交易 | 应支付该券商的佣金 | 备注 |
|------|-----|------|-----------|----|
|------|-----|------|-----------|----|

| | 元数量 | 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 | 1,327,152,582.80 | 100.00 | 326,386.69 | 100.00 | - |

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

2、交易单元的选择标准和程序

(1) 选择标准

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

(2) 选择程序

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

3、本报告期内无新增券商交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|----------------|------------------|-------------------|--------------------|------|------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) |
| 光大证券 | 170,502,904.27 | 100.00 | 16,825,000,000.00 | 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 | 光大阳光添利债券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 |
| 2 | 光大阳光添利债券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 |
| 3 | 光大阳光添利债券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，本集合计划未发生单一投资者持有集合计划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添利债券型集合资产管理计划合同变更的函；
- 2、《光大阳光添利债券型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《光大阳光添利债券型集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《光大阳光添利债券型集合资产管理计划招募说明书》；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、集合计划管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

备查文件存放于集合计划管理人的办公场所：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