

光大阳光启明星创新驱动主题混合型集合  
资产管理计划  
2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：上海光大证券资产管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 25 日

## § 1 重要提示

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

集合计划托管人中国光大银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 07 月 01 日起至 2023 年 09 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	光大阳光启明星创新驱动混合
基金主代码	860016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 8 月 18 日
报告期末基金份额总额	360,687,409.02 份
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。本集合计划通过动态跟踪海内外主要经济体的 GDP、CPI、利率等宏观经济指标，以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等市场指标，确定未来市场变动趋势。本集合计划通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势，对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。根据上述定性和定量指标的分析结果，运用资产配置优化模型，在目标收益条件下，追求风险最小化目标，最终确定大类资产投资权重，实现资产合理配置。</p> <p>（二）权益类品种的投资策略</p> <p>本集合计划重点投资于创新驱动主题相关行业。创新驱动发展战略是中国未来提高经济增长质量、经济增长动力调整的重要推动力，随着全社会对创新活动的大力投</p>

	<p>入、国家相关政策的持续扶持，具有优秀研发实力和 创新精神的中国企业开始具备国际竞争力，企业的经营效率也不断提高，具有较好的长期投资价值。</p> <p>（三）固定收益类品种投资策略 在债券投资方面，本集合计划可投资于国债、金融债、企业债和可转换债券等债券品种。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 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 1、股指期货投资策略 管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本集合计划的投资目标。本集合计划在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。 2、国债期货的投资策略 本集合计划投资国债期货以套期保值为目的，国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。管理人通过动态管理国债期货合约数量，以获取相应债券组合的超额收益。</p>		
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率×60%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%+中债综合指数收益率×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>本集合计划除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。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，本集合计划还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>		
基金管理人	上海光大证券资产管理有限公司		
基金托管人	中国光大银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	光大阳光启明星创新驱动混合 A	光大阳光启明星创新驱动混合 B	光大阳光启明星创新驱动混合 C
下属分级基金的交易代码	860016	860052	860053
报告期末下属分级基金的份额总额	26,308,830.60 份	194,982,790.60 份	139,395,787.82 份

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

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）		
	光大阳光启明星创新驱动混合 A	光大阳光启明星创新驱动混合 B	光大阳光启明星创新驱动混合 C
1. 本期已实现收益	-753,426.48	-3,127,023.82	-2,420,197.58
2. 本期利润	-6,415,666.91	-24,764,390.95	-17,628,536.44
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.2423	-0.1256	-0.1247
4. 期末基金资产净值	36,287,375.02	137,778,074.28	96,440,746.01
5. 期末基金份额净值	1.3793	0.7066	0.6918

注：1、上述集合计划业绩指标不包括持有人认购或交易集合计划的各项费用（例如，集合计划的申购赎回费、集合计划转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指集合计划本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

光大阳光启明星创新驱动混合 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-14.92%	1.16%	-8.24%	0.85%	-6.68%	0.31%
过去六个月	-21.16%	1.22%	-13.58%	0.85%	-7.58%	0.37%
过去一年	-7.44%	1.22%	-11.21%	0.93%	3.77%	0.29%
过去三年	-16.19%	1.41%	-23.52%	1.12%	7.33%	0.29%
自基金合同生效起至今	-18.34%	1.41%	-26.43%	1.11%	8.09%	0.30%

光大阳光启明星创新驱动混合 B

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-15.07%	1.16%	-8.24%	0.85%	-6.83%	0.31%
过去六个月	-21.44%	1.22%	-13.58%	0.85%	-7.86%	0.37%
过去一年	-8.09%	1.22%	-11.21%	0.93%	3.12%	0.29%
过去三年	-17.86%	1.41%	-23.52%	1.12%	5.66%	0.29%
自基金合同生效起至今	-20.33%	1.41%	-26.77%	1.11%	6.44%	0.30%

光大阳光启明星创新驱动混合 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-15.25%	1.16%	-8.24%	0.85%	-7.01%	0.31%
过去六个月	-21.75%	1.23%	-13.58%	0.85%	-8.17%	0.38%
过去一年	-8.83%	1.22%	-11.21%	0.93%	2.38%	0.29%
过去三年	-19.80%	1.41%	-23.52%	1.12%	3.72%	0.29%
自基金合同生效起至今	-21.73%	1.41%	-26.77%	1.11%	5.04%	0.30%

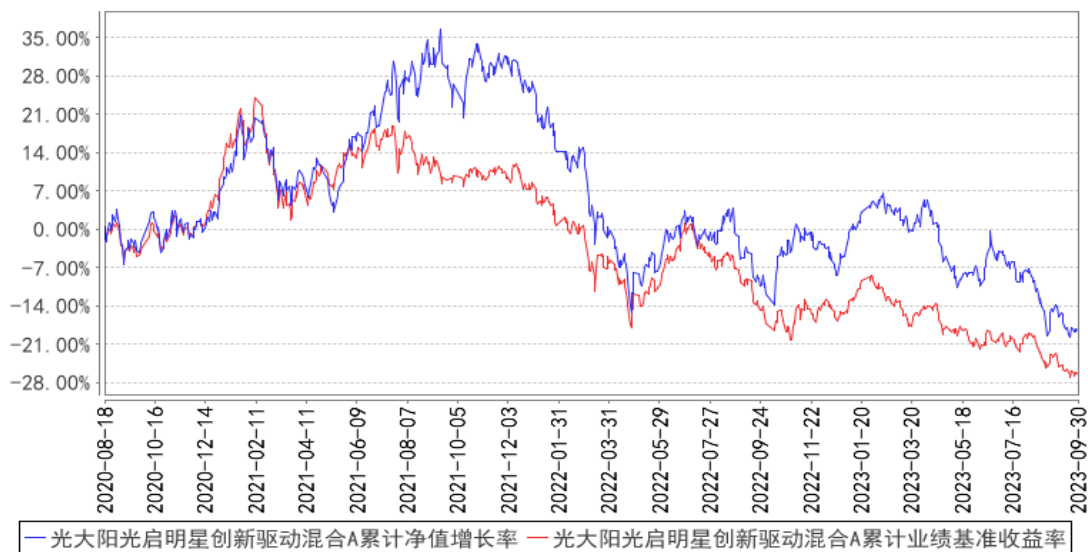
注：1、自基金合同生效起至今指 2020 年 08 月 18 日至 2023 年 9 月 30 日；

2、业绩比较基准为：中国战略新兴产业成份指数收益率×60%+中债综合指数收益率×20%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%

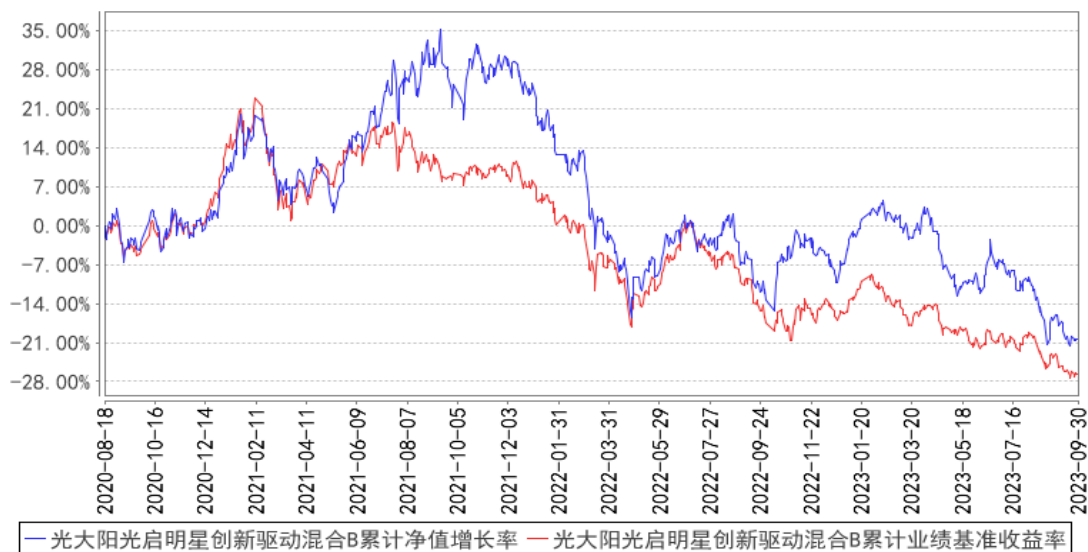
3、B 类份额、C 类份额设立日均为 2020 年 8 月 18 日，B 类份额自 2020 年 08 月 19 日开始有实际份额，C 类份额自 2020 年 08 月 27 日开始有实际份额。

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

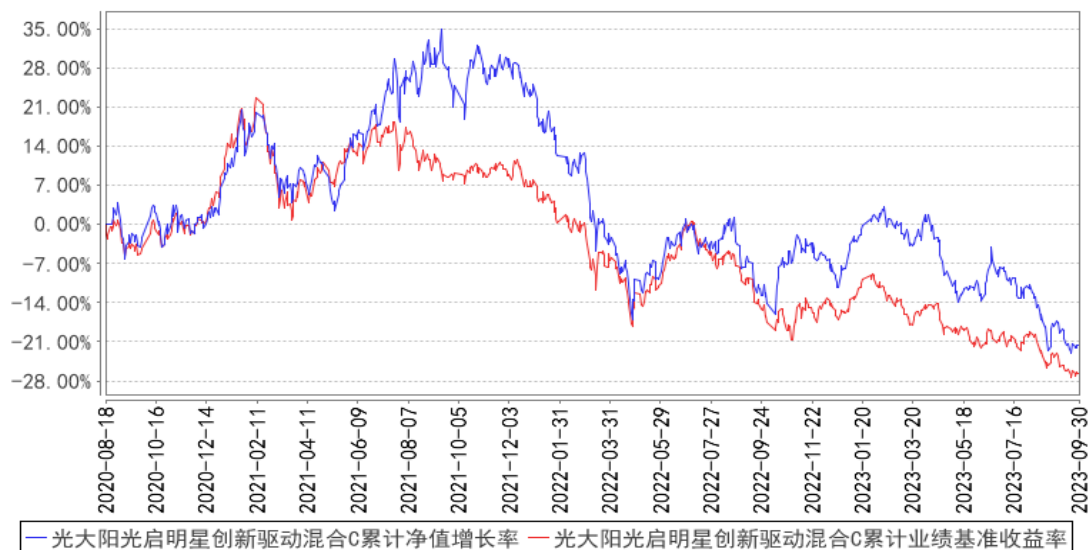
光大阳光启明星创新驱动混合**A**累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



光大阳光启明星创新驱动混合**B**累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



光大阳光启明星创新驱动混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### 3.3 其他指标

无。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孟巍	权益投资总监兼研究部总经理、本集合计划投资经理、光大阳光混合型集合资产管理计划投资经理	2020年8月18日	-	9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研究部总经理。

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

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

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本集合计划本报告期末投资经理无兼任私募资产管理计划的情况。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度 A 股市场延续二季度跌幅，进入 8 月市场加速下跌，历经 2022 年以来长达一年半多时间熊市的煎熬，最近的几周水银泻地般的下跌让 A 股市场参与者近乎绝望，我们产品的净值也随市场产生的较大回撤，没能获得超出市场的表现，我作为投资经理深表歉意。我们理解市场如此悲观的原因：随着二季度经济复苏的弱现实逐步显露，居民和企业部门基于对未来不确定性削减开支和捂紧钱袋子，这进一步导致社会总需求的下降，而市场期待的强有力的政策迟迟低于预期，无法有效打破当前负向正反馈循环，市场的信心不断丧失，危机四伏的房地产、消费的持续疲弱、地缘政治风险下不断走弱的海外需求，投资者看到的是一幅几近全面崩塌的经济图景。从行业中观角度，消费企业及其经销商们年初乐观看待疫后消费修复，经历一季度一波渠道补库存后，不断走弱的动销使得他们一路下修全年的预期，股票市场也和实体经济的经营一起经历了过山车般的起伏；部分房地产链条的公司逐步受到行业寒冬滞后影响，财务报表疲态尽显，而地产在年初小阳春之后再次低迷不起，部分房企的风险持续发酵，行业前景依然不明朗；制造业公司无论是新能源等新兴方向还是传统产业也乏善可陈，我们很难找到像过去几年新能源行业般体量巨大的增量经济，而进口替代等慢逻辑在面对短期需求景气度低迷的时候也难有阿尔法表现。总结来说，经济的下行压力远超我们年初的预期，我们的仓位表达有较多顺周期类资产，布局了过多顺行业景气的计算机等公司，我们对今年经济过于乐观了，这是在大势研判上犯的错误。面向未来，



我们努力不被过去犯的错误影响未来的决策，冷静分析当前市场位置、持仓公司的估值背后所隐含的市场对宏观、行业的假设，去分析市场现在是否太悲观了？这些公司的内含价值是否远不如股票价格跌幅那样大幅减损？我们的答案是肯定的。我们有几点观察思考：

1、当前市场充斥着对宏大叙事的讨论，无论是日本式的资产负债表衰退、还是关于“消费降级”、“国进民退”等问题的再次讨论，都是市场在低点时对中国长期发展潜力、中国资产底层投资逻辑信心的动摇，这在每一轮熊市的低点都是类似的。比如我们是否会和日本一样失去几十年，这是十分复杂的问题，脱离起步位置、经济体结构特点等等前提条件难以得出简单的结论，如分析股票一样，我们容易把短期问题长期化（下行时信心不足，把正常的经济/商业周期理解成长期的衰退，这样导致的双击双杀的例子比比皆是），日本那样的资产价格大幅下跌带来的被动债务衰退有其特殊性，我们的资产位置远不可同日而语。再比如聊到市场对消费板块前景的担忧，一句“消费降级”似乎可以宣判消费板块的死刑，这与两三年前消费板块如日中天时万能的“消费升级”逻辑一样充满陷阱，我们认为中国消费行业机会依然很多，原因是中国消费市场是巨大的、同时是分层的、不平衡的，高能级地区的消费前景或许可以类比日本，但三四线城市就迥然不同，我们的消费品公司市值还不大，优秀的公司只需要抓住一类群体、满足一个层级消费者的需求，就有机会成长为大几百亿甚至上千亿市值的公司，中国不存在整体的、绝对意义上的消费降级，这和全社会大踏步共同前进和后退的日本是不同的。展开这几个例子是想说明，市场极端情况时，宏大叙事是容易引起共鸣的，无论顶部还是底部，本质上是市场情绪的宣泄，但往往经不起推敲或者短期难以证真伪，牛市时我们同样经历过所谓“奥运牛”、“互联网+”等宏大叙事，在不断上涨的K线面前也觉得上涨逻辑如此坚实、“这次真的不一样了”，反之亦然，当前悲观很大一部分是自我加强的结果，实体挣钱不易，股票市场下跌，下跌过程中坏消息又不断传来，到处悲观的言论，市场自我实现起了很大作用。诚然，我们目前的经济确实是遇到了困难，目前也确实没有足够清晰的路径走出困局，仍需要时间，但当前市场的位置、近两年熊市调整的时间也充分体现了当前这样的认知，而这个主观认知的扭转就伴随着系统性机会，但可惜的是，从过往市场运行周期来看，没有明确的右侧信号，往往等经济的信心修复时，市场已经完成了一大波涨幅，所谓的明确信号大多是后视镜视角，牛市都是在将信将疑中酝酿而生的，我们需要在底部持仓，底部精选后面涨幅更大的个股，这是我们当前对市场整体的看法。

2、我们在个股上的观察上感受到更为极端的市场。正是对未来的不确定，市场对股票短期的业绩表现更为苛刻、对估值的容忍度更低，而过去五年来不断提起的价值投资方法似乎被市场逐步抛弃，巴菲特的价值因子几近失效，对企业的护城河、竞争壁垒和盈利可持续性的讨论逐渐减少，替代的是如AI等星辰大海行业的主题投资、低估值小盘等风格的量化投资等，市场表现得短

视且脆弱，对景气度不佳的板块避之不及，弱势行业中个股阿尔法的获得十分不易。市场敏感于短期业绩波动、海外映射、主题投资等交易范式，鲜有对长期价值安全边际的充分定价（在担忧宏观和行业长期运行背景是否稳定的环境下，这样的交易有其合理性），这样市场给了我们价值投资者千载难逢布局的机会。举个例子，房地产链条是市场抛弃的板块，但即使未来中长期房屋销售面积是过去峰值的一半，我们依然可以很确定描述一些房地产链条里壁垒极高的优秀公司的长期发展路径和修正后的盈利表现，即使是很悲观的假设下其内含价值也是严重低估的，且不说现在的开工数据已经较过去腰斩，未来回归向上的概率不小，整体贝塔边际向下空间已经有限，这样的机会散落在很多当前遇到困难行业中，只是短期似乎没有催化剂，很难听到好消息。今年 3 月份以来，我们的主动选股策略就十分艰难，在我们的框架中，企业长期盈利的可持续成长是我们对企业内含价值理解中最重要的部分，我们的框架在过去 6 个月的时间遭受到了前所未有的考验。如果说 21 年初“核心资产”的泡沫破裂、市场钟摆开始回摆，经历两年半的时间，当前市场呈现出的风格特点，可能标志着我们又逐步接近了另一边市场钟摆的顶点，但市场尾部波动的风险依然很大，个别股票出现流动性问题，黎明前的黑暗最是难熬，这个时候去逆势逆向布局一些下跌的资产是不易的，但我们的投资框架和对个股的价值判断要求我们要坚持，不能漂移。

综上对市场和个股层面的思考，我们近期做了一些艰难的决定，我们的组合的整体仓位和个股集中度来到了过去三年的最高水平，仓位表达维持了积极进攻，依然下注在中国宏观经济能够触底企稳回升这一宏观假设，持仓计算机、通信设备和电子元器件等制造业，TMT 中对 AI 等概念类资产保持谨慎。熊市逆风中我们加仓、逆向布局是逆人性的，但我们是深思熟虑的，提高的集中度使得我们可能要面对一些持仓尾部波动的风险，在市场极端情况下会出现不低的波动，但我们认为现在到了要坚定布局的时刻，是可以承担波动风险布局更大收益的时刻，当前市场对一些利好因素的反应淡漠、成交量持续萎靡，同时政策等基本面有利因素不断累积，我们对四季度乃至明年市场的表现是乐观的。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 9 月 30 日，光大阳光启明星创新驱动混合 A 份额净值为 1.3793 元，本报告期份额净值增长率为-14.92%；光大阳光启明星创新驱动混合 B 类份额净值为 0.7066 元，本报告期份额净值增长率为-15.07%；光大阳光启明星创新驱动混合 C 类份额净值为 0.6918 元，本报告期份额净值增长率为-15.25%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本集合计划未出现连续二十个工作日集合计划份额持有人数量不满二百人或集合

计划资产净值低于五千万元的情形。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	250,059,297.12	92.21
	其中：股票	250,059,297.12	92.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	21,041,407.72	7.76
8	其他资产	95,266.42	0.04
9	合计	271,195,971.26	100.00

注：本集合计划本报告期末未持有港股通投资股票。

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	176,810,689.15	65.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,537.53	0.00
F	批发和零售业	7,529.60	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	3,416,259.00	1.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	69,801,613.40	25.80
J	金融业	-	-
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	16,668.44	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	250,059,297.12	92.44

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有港股通投资股票。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002410	广联达	1,046,020	24,435,027.20	9.03
2	000063	中兴通讯	736,600	24,072,088.00	8.90
3	300451	创业慧康	2,554,800	17,219,352.00	6.37
4	002937	兴瑞科技	700,600	14,922,780.00	5.52
5	600570	恒生电子	403,284	13,086,565.80	4.84
6	300408	三环集团	411,300	12,750,300.00	4.71
7	301328	维峰电子	218,186	10,632,203.78	3.93
8	300454	深信服	104,300	9,732,233.00	3.60
9	688698	伟创电气	247,020	8,507,368.80	3.14
10	301031	中熔电气	74,700	8,467,245.00	3.13

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。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本集合计划本报告期末未持有债券。

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

本集合计划本报告期末未持有债券。

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

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

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

本集合计划本报告期末未持有贵金属。

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

本集合计划本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末未持有股指期货。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本集合计划的投资目标。本集合计划在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本集合计划投资国债期货以套期保值为目的，国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。管理人通过动态管理国债期货合约数量，以获取相应债券组合的超额收益。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本集合计划本报告期末未持有国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

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

本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。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本集合计划投资的前十名股票未超出集合计划合同规定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	75,268.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	19,998.28
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	95,266.42

#### 5.11.4 报告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。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	光大阳光启明星 创新驱动混合 A	光大阳光启明星 创新驱动混合 B	光大阳光启明星 创新驱动混合 C
报告期期初基金份额总额	26,686,122.90	199,196,686.43	143,062,300.05
报告期期间基金总申购份额	-	245,569.32	2,595,373.27
减：报告期期间基金总赎回份额	377,292.30	4,459,465.15	6,261,885.50
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
报告期期末基金份额总额	26,308,830.60	194,982,790.60	139,395,787.82

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	光大阳光启明星创新 驱动混合 A	光大阳光启明星创新 驱动混合 B	光大阳光启明星创新 驱动混合 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	31,981,876.33	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	31,981,876.33	-
报告期期末持有的本基金份额	-	8.87	-

占基金总份额比例 (%)			
--------------	--	--	--

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内集合计划管理人未新增固有资金投资本集合计划。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本集合计划报告期内未出现单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过 20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1) 2023 年 7 月 20 日, 关于光大阳光启明星创新驱动主题混合型集合资产管理计划延长存续期限并修改资产管理合同、招募说明书的公告。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予《光大阳光启明星创新驱动主题混合型集合资产管理计划资产管理合同》变更批复的文件；

2、《光大阳光启明星创新驱动主题混合型集合资产管理计划资产管理合同》；

3、《光大阳光启明星创新驱动主题混合型集合资产管理计划托管协议》；

4、《光大阳光启明星创新驱动主题混合型集合资产管理计划招募说明书》；

5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；

6、集合计划管理人业务资格批件、营业执照；

7、中国证监会要求的其他文件

### 9.2 存放地点

备查文件存放于集合计划管理人的办公场所：

1、中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层

### 9.3 查阅方式

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

上海光大证券资产管理有限公司

2023 年 10 月 25 日