

光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置 混合型集合资产管理计划 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：上海光大证券资产管理有限公司

基金托管人：广发银行股份有限公司

送出日期：2024 年 03 月 29 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。

集合计划托管人广发银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2024 年 3 月 28 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。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本集合计划出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 12 月 31 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	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	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	12
3.4 过去三年基金的利润分配情况	12
§ 4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	17
4.10 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	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	24

§ 8 投资组合报告	58
8.1 期末基金资产组合情况	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
8.3 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	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	72
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	73
8.6 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	73
8.7 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	74
8.8 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	74
8.9 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	74
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	74
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	74
8.12 市场中性策略执行情况	74
8.13 投资组合报告附注	74
§ 9 基金份额持有人信息	76
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	76
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	76
9.3 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	77
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	77
§ 10 开放式基金份额变动	77
§ 11 重大事件揭示	78
11.1 基金份额持有人大会决议	78
11.2 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	78
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	78
11.4 基金投资策略的改变	78
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	78
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	78
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	78
11.8 其他重大事件	79
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	80
12.1 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	80
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	80
§ 13 备查文件目录	80
13.1 备查文件目录	80
13.2 存放地点	80
13.3 查阅方式	81

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划		
基金简称	光大阳光对冲 6 个月持有混合		
基金主代码	860010		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2020 年 3 月 25 日		
基金管理人	上海光大证券资产管理有限公司		
基金托管人	广发银行股份有限公司		
报告期末基金份 额总额	224,324,222.60 份		
基金合同存续期	存续期至 2024 年 12 月 31 日，本集合计划自 2024 年 12 月 31 日后，按照中国证监会的有关规定执行		
下属分级基金的基 金简称	光大阳光对冲 6 个月持有 混合 A	光大阳光对冲 6 个月持有 混合 B	光大阳光对冲 6 个月持有 混合 C
下属分级基金的交 易代码	860010	860028	860029
报告期末下属分级 基金的份额总额	2,305,889.56 份	35,917,441.41 份	186,100,891.63 份

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

2.2 基金产品说明

投资目标	通过深入研究，捕捉宏观环境及政策趋势走向，灵活精选投资策略，在合理控制投资风险和保障集合计划资产流动性的基础上，追求集合计划资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本集合计划主要采用对冲套利的投资策略。通过数量化投资模型，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，并使用股指期货进行对冲操作，有效规避市场涨跌的系统性风险，获取选股的超额收益。力争实现集合计划资产长期稳健的绝对收益。另通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、信用风险、证券市场估值水平等因素，综合配置固定收益等各类资产，以实现整体资产的稳健增值。</p> <p>（一）股票投资策略</p> <p>本集合计划主要通过数量化投资模型，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。数量化投资模型的投资逻辑基于学术研究、投资实践中被普遍接受的选股因子构建对于个股的收益进行预测，因子包括价值、质量、成长、事件驱动、市场等大类。通过现代组合管理的数量化模型进行组合构建，优化系统风险及个股特定风险的最优配比。</p> <p>对于因子的选取，我们的方法论是自上而下的投资逻辑，首先保证其在经济学、金融学、行为金融学上的意义，判断其符合当前的经济和市场环境，然后再重点关注因子的稳定性、解释性、统计显著性。力求甄选出基本面绩优、在行业内有竞争优势、当前具有估值</p>

	<p>机会、具备核心成长潜力等方面的优秀上市公司。</p> <p>(二) 金融衍生工具对冲策略</p> <p>本集合计划在通过以上股票投资策略的基础上, 使用股指期货对冲组合的系统性风险, 从而分离出组合的超额收益。根据风险管理的原则, 以套期保值为目的, 在风险可控的前提下, 本着谨慎原则, 参与股指期货对冲。综合考虑股指期货不同合约之间的价差关系、套利机会、流动性等因素, 在各股指期货合约之间进行动态配置和临近到期合约的展期操作, 以提升组合收益和套期保值的效果。随着其他金融衍生工具的发展, 本集合计划会考虑使用法律法规允许范围内的其他对冲工具, 例如融券卖空、期权等。通过优选对冲工具, 提高管理市场风险的能力。</p> <p>(三) 融券投资策略</p> <p>本集合计划在投资机会和融券成本合适的情况下, 采用融券的方式进行配对交易。通过多因子模型, 可以寻找到行业、风格相近的股票之间存在的理论价差, 通过买入低价股、融券卖空高价股获得绝对收益。</p> <p>(四) 其他绝对收益投资策略</p> <p>包括: (1) 普通债券投资策略; (2) 可转债投资策略; (3) 衍生品投资策略; (4) 一级市场申购策略; (5) 现金类资产投资策略。</p> <p>(五) 资产支持证券投资策略</p> <p>本集合计划将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析, 并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型, 评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。</p>
业绩比较基准	中国人民银行公布的同期 1 年期银行定期存款基准利率(税后)+1%。
风险收益特征	本集合计划为混合型集合计划, 其预期风险和预期收益高于债券型基金、债券型集合计划、货币市场基金和货币型集合资产管理计划, 低于股票型基金和股票型集合计划。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海光大证券资产管理有限公司	广发银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	朱轶	顾洪峰
	联系电话	021-32068300	010-65169885
	电子邮箱	zhuyil@ebscn.com	guhongfeng@cgbchina.com.cn
客户服务电话		95525	4008308003
传真		021-32068585	010-65169555
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层	广东省广州市越秀区东风东路 713 号
办公地址		中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层	北京市东城区东长安街甲 2 号广发银行大厦
邮政编码		200127	100005
法定代表人		熊国兵	王凯

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ebscn-am.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	上海光大证券资产管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2023 年			2022 年			2021 年		
	光大阳 光对冲 6 个月 持有混 合 A	光大阳 光对冲 6 个月 持有混 合 B	光大阳 光对冲 6 个月 持有混 合 C	光大阳 光对冲 6 个月 持有混 合 A	光大阳 光对冲 6 个月 持有混 合 B	光大阳 光对冲 6 个月 持有混 合 C	光大阳 光对冲 6 个月 持有混 合 A	光大阳 光对冲 6 个月 持有混 合 B	光大阳 光对冲 6 个月 持有混 合 C
本期已 实现收 益	28,366 .89	618,51 3.78	3,858, 285.45	-34,05 1.32	-311,0 87.50	-3,657 ,553.9 2	66,535 .21	439,70 6.37	16,292 ,014.0 9
本期利 润	56,701 .40	1,053, 417.76	6,168, 499.70	-41,32 2.05	-410,1 43.67	-4,565 ,067.8 5	-29,11 5.70	-469,3 03.60	-5,246 ,947.2 8
加权平 均基金 份额本 期利润	0.0241	0.0288	0.0277	-0.014 8	-0.010 7	-0.013 8	-0.005 6	-0.009 3	-0.004 6
本期加 权平均 净值利 润率	2.29%	2.75%	2.68%	-1.42%	-1.04%	-1.35%	-0.52%	-0.88%	-0.43%
本期基 金份额 净值增 长率	2.27%	2.78%	2.37%	-1.56%	-1.06%	-1.46%	-2.58%	-2.09%	-2.49%
3.1.2	2023 年末			2022 年末			2021 年末		

期末数据和指标									
期末可供分配利润	127,377.27	1,876,832.64	6,846,369.15	83,279.89	883,011.15	3,416,609.95	149,883.52	1,385,437.81	12,265,709.60
期末可供分配基金份额利润	0.0552	0.0523	0.0368	0.0318	0.0238	0.0128	0.0481	0.0348	0.0278
期末基金资产净值	2,433,266.83	37,794,274.05	192,947,260.78	2,698,958.17	38,011,854.69	270,392,440.91	3,262,849.94	41,228,688.70	453,590,235.00
期末基金份额净值	1.0552	1.0523	1.0368	1.0318	1.0238	1.0128	1.0481	1.0348	1.0278
3.1.3 累计期末指标	2023 年末			2022 年末			2021 年末		
基金份额累计净值增长率	3.24%	5.23%	3.68%	0.95%	2.38%	1.28%	2.54%	3.48%	2.78%

注：1、表中的“期末”均指报告期最后一日，即 2023 年 12 月 31 日；“本期”指 2023 年 1 月 1 日-2023 年 12 月 31 日。

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

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

4、期末可供分配利润，采用期末未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

光大阳光对冲 6 个月持有混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.62%	0.17%	0.63%	0.01%	-2.25%	0.16%

过去六个月	-0.93%	0.18%	1.27%	0.01%	-2.20%	0.17%
过去一年	2.27%	0.18%	2.53%	0.01%	-0.26%	0.17%
过去三年	-1.92%	0.24%	7.79%	0.01%	-9.71%	0.23%
自基金合同生效起至今	3.24%	0.24%	9.89%	0.01%	-6.65%	0.23%

光大阳光对冲 6 个月持有混合 B

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.49%	0.17%	0.63%	0.01%	-2.12%	0.16%
过去六个月	-0.67%	0.18%	1.27%	0.01%	-1.94%	0.17%
过去一年	2.78%	0.18%	2.53%	0.01%	0.25%	0.17%
过去三年	-0.44%	0.24%	7.80%	0.01%	-8.24%	0.23%
自基金合同生效起至今	5.23%	0.24%	9.89%	0.01%	-4.66%	0.23%

光大阳光对冲 6 个月持有混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.59%	0.17%	0.63%	0.01%	-2.22%	0.16%
过去六个月	-0.88%	0.18%	1.27%	0.01%	-2.15%	0.17%
过去一年	2.37%	0.18%	2.53%	0.01%	-0.16%	0.17%
过去三年	-1.63%	0.24%	7.80%	0.01%	-9.43%	0.23%
自基金合同生效起至今	3.68%	0.24%	9.89%	0.01%	-6.21%	0.23%

注：1、自基金合同生效起至今指 2020 年 3 月 25 日至 2023 年 12 月 31 日；

2、业绩比较基准为：中国人民银行公布的同期 1 年期银行定期存款基准利率（税后）+1%

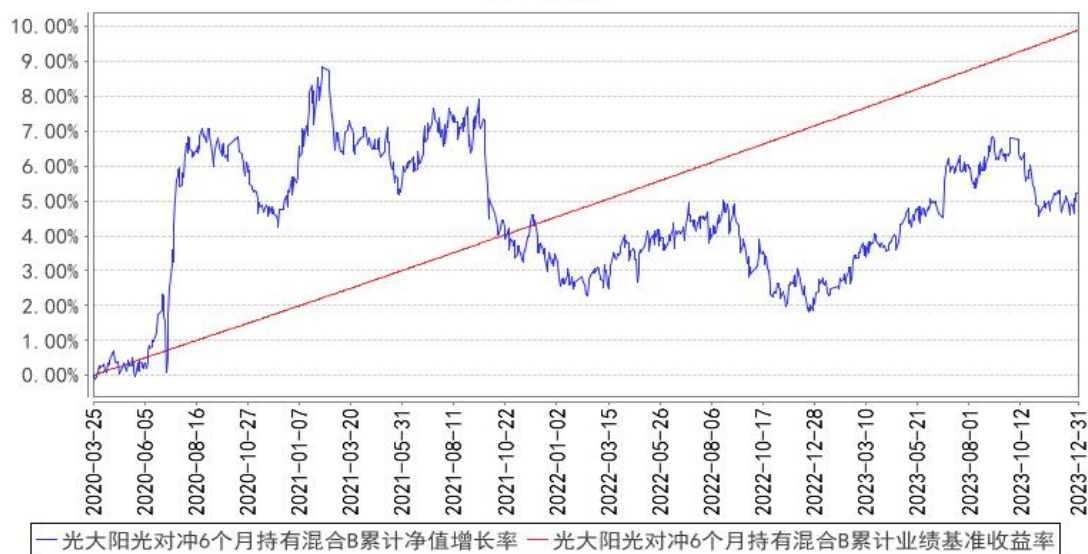
3、B 类、C 类份额设立日均为 2020 年 3 月 25 日。

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

光大阳光对冲6个月持有混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



光大阳光对冲6个月持有混合B累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

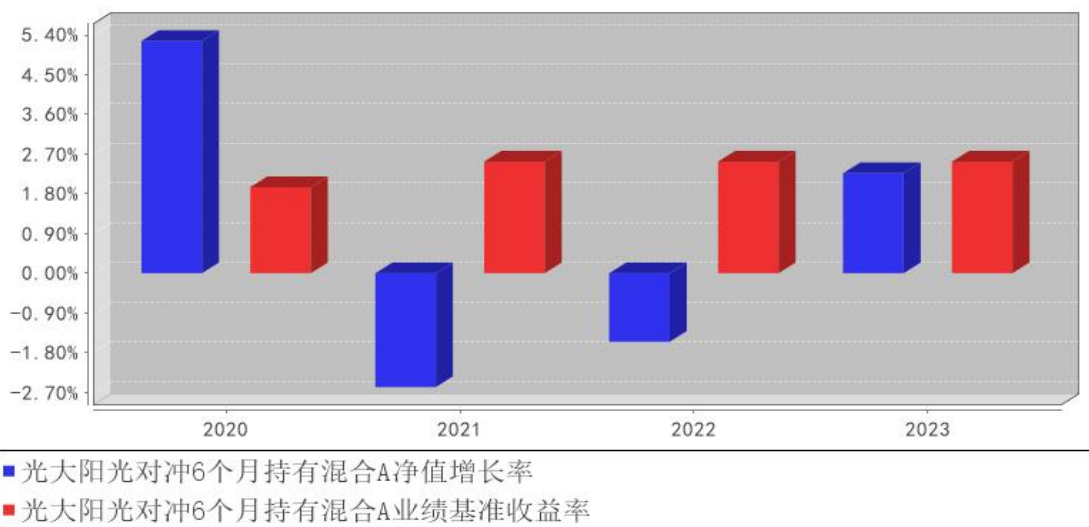


光大阳光对冲6个月持有混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

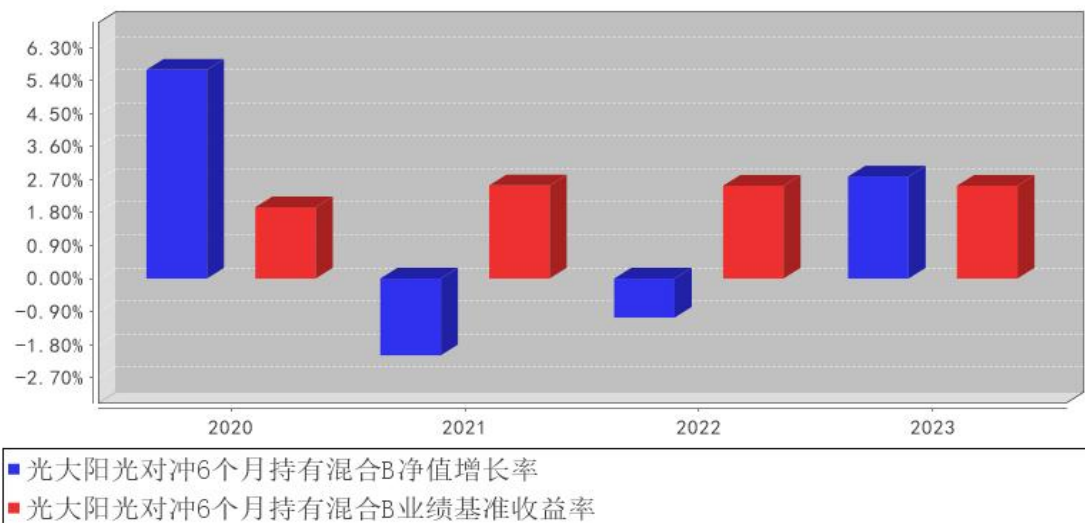


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

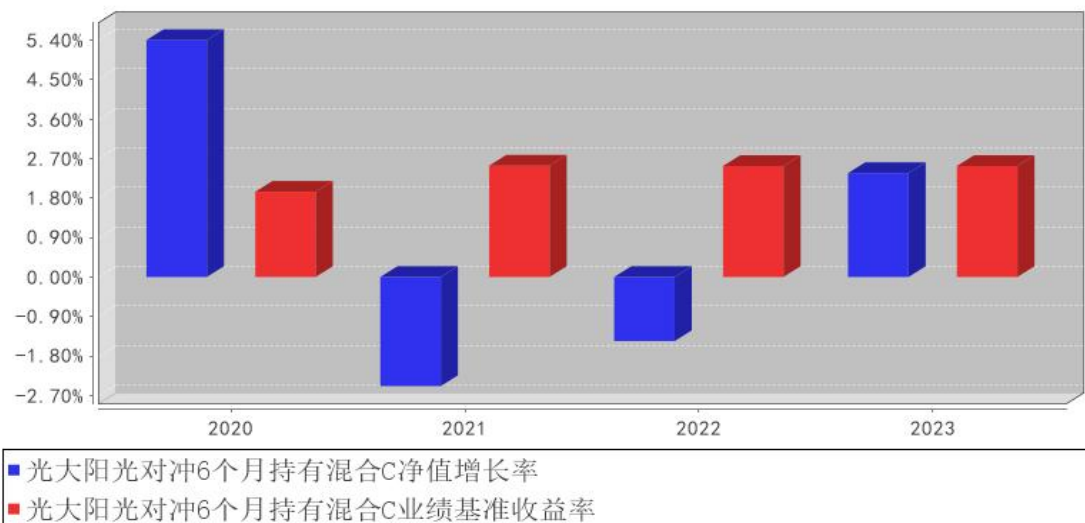
光大阳光对冲6个月持有混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



光大阳光对冲6个月持有混合B基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



光大阳光对冲6个月持有混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本集合计划过去三年未进行利润分配。

§ 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 2023 年 12 月末，本公司共管理 16 只参照开放式证券投资基金管理的集合计划，公司在投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈韵骋	本集合计划投资经理	2023 年 3 月 17 日	-	12 年	陈韵骋先生，博士学位，本硕博均毕业于上海交通大学，曾任海通证券研究所分析师，2015 年加入光证资管，历任研究员、投资经理助理，现任混合资产公募投资部投资经理，担任光大阳光稳健增长混合型集合资产管理计划、光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划、光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券型集合资产管理计划投资经理。
崔宁	本集合计划投资经理助理	2023 年 03 月 27 日	-	6 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、投资经理。
李禄俊	本集合计划投资经理	2020 年 03 月 25 日	2023 年 03 月 17 日	8 年	李禄俊先生，本硕均毕业于北京大学，曾在中金基金管理公司量化投资部任职，2018 年加入光证资管。
陈延庆	本集合计划投资经理	2022 年 07 月 01 日	2023 年 03 月 17 日	8 年	陈延庆先生，研究生毕业于纽约大学应用数学专业，历任中金基金量化研究员，量化专户投资经理，中信建投基金量化研究负责人，量化专户投资经理。2021 年加入光证资管。

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；

3、根据管理人2023年3月17日公告，李禄俊、陈延庆不再担任本集合计划投资经理，增聘陈韵骋为本集合计划投资经理；

4、根据管理人2023年3月27日公告，聘任崔宁为本集合计划的投资经理助理。

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

本集合计划投资经理本报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本集合计划投资经理薪酬激励不存在与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本集合计划管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及集合计划合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作集合计划资产，在严格控制风险的基础上，为集合计划份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本集合计划运作合规，不存在违反集合计划合同和损害集合计划份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《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》，将公司已经管理、未来可能管理的所有公募及私募资产管理产品的投资组合等不同资产组合参与的投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节均纳入公平交易管理，在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动，建立对公平交易的执行、监督及审核流程，严禁在不同投资组合之间进行利益输送。

4.3.2 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》。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本集合计划投资经理本报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有的投资组合参与交易所公开竞价交易中，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%的交易共有 3 次，为量化策略组合因投资策略需要发生的反向交易，公司作为产品管理人对上述交易均履行了相应控制程序。

报告期内未发现本集合计划存在异常交易行为。

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

2023 年 A 股呈现高开低走态势，年初在疫情管控放松的刺激利好下强劲反弹，但此后伴随宏观预期的不断走弱 A 股持续下行，全年沪深 300 指数下跌 11.4%。2023 年 A 股结构性行情非常显著，阶段来看 TMT 和中特估行情主导上半年，小微盘和高分红板块主导下半年。北向资金的流出与机构在业绩压力下不断调整持仓品种，都对大盘成长风格造成了很大的压力，导致出现明显负超额收益，创业板指跌幅接近 20%表现低迷。行业上，TMT 板块和资源板块表现最佳，地产、电新、消费表现最差。

产品管理上，我们兼顾了基本面类型 Alpha 的稳健性与价量类 Alpha 的进攻性，进行均衡配置，比较好的契合了市场的整体趋势，但在应对四季度风格切换上做的还不够好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日，光大阳光对冲策略 6 个月持有混合 A 类份额净值为 1.0552 元，本报告期份额净值增长率为 2.27%；光大阳光对冲策略 6 个月持有混合 B 类份额净值为 1.0523 元，本报告期份额净值增长率为 2.78%；光大阳光对冲策略 6 个月持有混合 C 类份额净值为 1.0368 元，本报告期份额净值增长率为 2.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在当前时点，我们认为从宏观角度，各类主要经济指标喜忧参半。喜的方面有工业企业利润增速大幅上升，12 月财新 PMI 52.6，1 月 PMI 小幅反弹；忧的方面则有消费增速持续下行，地产销售不及预期等。但从 A 股表现来看，市场用脚投票表达了对经济的担忧，特别是地产相关板块。常规而言，由于四季度财报效应消失，资金的博弈会偏向于当年风格反转和买大放小。但是四季度则是当年风格的强化演绎，也显示出市场在失去抓手的同时较为极致的风险偏好。

短期来看，由于去年 1 月基数仍受到疫情较大影响，且今年春节明显错位，高频数据难以准确评估，市场预期处于相对混乱的阶段。海外方面，尽管美国制造业 PMI 走弱，但就业数据保持强劲，失业率好于预期，新增非农大幅超出预期，3 月降息的可能性明显降低，很可能要向后修正到二季度。

从 2024 全年来看，中央政策发力值得期待。12 月中央经济工作会议进一步明确政治局会议“以进促稳”内涵，将稳预期放在新“三稳”首位，财政政策提出合理扩大专项债用作资本金范

围，货币政策再提“总量和结构双重功能”，财政和货币政策今年大概率将同时发力。

产品操作思路，我们会在立足于防守的情况下寻找进攻机会。经过两年多的调整，市场上已存在较多被低估的品种，发掘估值修复的 Alpha 将是策略配置上的核心逻辑。同时随着市场的波动的提升，期货端基差变动幅度和频率都明显增加，期现套利的配置权重也会进一步提升。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，管理人继续完善内部控制、提升风险管理水平，着重开展了以下各项工作：

1、继续完善内部控制体系

公司根据法律法规、监管要求及业务发展需求，不断优化现有的标准化业务流程体系，强调业务流程服务于加强风险防范和提升运营效率，通过信息技术手段持续提升业务操作的系统化程度，并不断优化。

2、持续改进投资监控的方法与手段，保证集合计划投资业务的合法合规性

报告期内，在投资日常合规监控工作方面，公司根据法律法规和产品特点进一步完善了投资监控系统以提升投资监控效率；在实现交易价差分析、银行间交易分析、研究报告检查等专项检查工作定期化、日常化的基础上，公司加强了内幕交易风险的检查和防范，多次开展有关内幕交易的合规培训，进一步强化全体投研人员对内幕交易行为和结果的认识。

3、规范集合计划销售业务，保证集合计划销售业务的合法合规性

报告期内，在集合计划持续营销活动中，公司严格规范销售业务，按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金宣传推介材料管理暂行规定》及相关法规规定审查宣传推介材料，逐步落实反洗钱法律法规各项要求，并督促销售部门做好投资者教育工作，本报告期内没有出现主动违规行为。

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 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，广发银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划（以下称“本集合计划”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、集合计划合同和托管协议的有关规定，不存在任何损害集合计划份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、集合计划合同和托管协议的规定，对本集合计划管理人的投资运作方面进行了必要的监督，对集合计划资产净值的计算、集合计划份额申购赎回价格的计算以及集合计划费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本集合计划管理人存在损害份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 27896 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
--------	------

审计报告收件人	光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划的集合计划管理人上海光大证券资产管理有限公司(以下简称“集合计划管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,集合计划管理人管理层负责评估光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非集合计划管理人管理层计划清算光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>集合计划管理人治理层负责监督光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影</p>

	<p>响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价集合计划管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对集合计划管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与集合计划管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张振波 陈迺迺
会计师事务所的地址	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2024 年 3 月 27 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			

货币资金	7.4.7.1	9,685,107.10	13,222,574.40
结算备付金		4,133,988.03	24,889,194.26
存出保证金		16,854,314.13	23,127,903.63
交易性金融资产	7.4.7.2	203,347,284.40	246,821,815.92
其中：股票投资		154,817,897.28	184,793,787.97
基金投资		-	-
债券投资		48,529,387.12	62,028,027.95
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	6,000,000.00	7,998,513.70
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		229,604.88	128,779.80
应收股利		-	-
应收申购款		-	2,500.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		240,250,298.54	316,191,281.71
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		5,702,424.43	3,357,407.22
应付赎回款		533,973.04	451,911.94
应付管理人报酬		200,660.11	268,610.02
应付托管费		39,925.79	53,492.73
应付销售服务费		66,213.82	93,149.85
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,359.47	2,349.05
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	530,940.22	861,107.13
负债合计		7,075,496.88	5,088,027.94
净资产：			

实收基金	7.4.7.10	224,324,222.60	306,720,352.78
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	8,850,579.06	4,382,900.99
净资产合计		233,174,801.66	311,103,253.77
负债和净资产总计		240,250,298.54	316,191,281.71

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，集合计划份额总额 224,324,222.60 份。其中光大阳光对冲策略 6 个月持有 A 集合计划份额净值 1.0552 元，集合计划份额总额 2,305,889.56 份；光大阳光对冲策略 6 个月持有 B 集合计划份额净值 1.0523 元，集合计划份额总额 35,917,441.41 份；光大阳光对冲策略 6 个月持有 C 集合计划份额净值 1.0368 元，集合计划份额总额 186,100,891.63 份。

7.2 利润表

会计主体：光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		11,705,684.27	1,181,877.51
1. 利息收入		267,344.41	733,427.99
其中：存款利息收入	7.4.7.13	117,718.61	425,852.91
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		149,625.80	307,575.08
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		8,664,887.12	1,462,228.24
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-523,881.85	-34,503,592.30
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-771,598.46	1,773,573.05
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	34,689.00
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	6,710,805.80	29,783,807.59
股利收益	7.4.7.19	3,249,561.63	4,373,750.90
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）	7.4.7.20	2,773,452.74	-1,013,840.83

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	-	62.11
减：二、营业总支出		4,427,065.41	6,198,411.08
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,725,345.70	3,846,664.46
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	542,592.15	766,406.28
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	921,856.97	1,362,852.89
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	183.57
其中：卖出回购金融资产支出		-	183.57
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		48,470.59	26,224.79
8. 其他费用	7.4.7.23	188,800.00	196,079.09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,278,618.86	-5,016,533.57
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,278,618.86	-5,016,533.57
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		7,278,618.86	-5,016,533.57

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	306,720,352.78	-	4,382,900.99	311,103,253.77
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	306,720,352.78	-	4,382,900.99	311,103,253.77
三、本期增减变动额（减少以“-”	-82,396,130.18	-	4,467,678.07	-77,928,452.11

号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	7,278,618.86	7,278,618.86
(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)	-82,396,130.18	-	-2,810,940.79	-85,207,070.97
其中：1.基金申购款	1,709,677.11	-	62,722.72	1,772,399.83
2.基金赎回款	-84,105,807.29	-	-2,873,663.51	-86,979,470.80
(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	224,324,222.60	-	8,850,579.06	233,174,801.66
项目	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022年12月31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	484,280,742.71	-	13,801,030.93	498,081,773.64
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	484,280,742.71	-	13,801,030.93	498,081,773.64
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-177,560,389.93	-	-9,418,129.94	-186,978,519.87
(一)、综合收益总额	-	-	-5,016,533.57	-5,016,533.57
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以	-177,560,389.93	-	-4,401,596.37	-181,961,986.30

“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	2,547,462.67	-	56,804.75	2,604,267.42
2. 基金赎回款	-180,107,852.60	-	-4,458,401.12	-184,566,253.72
(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	306,720,352.78	-	4,382,900.99	311,103,253.77

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划是由光大阳光稳健添利集合资产管理计划转型而来。本集合计划管理人上海光大证券资产管理有限公司于 2020 年 3 月 17 日发布《光大阳光稳健添利集合资产管理计划合同变更公告》。根据公告，光大阳光稳健添利集合资产管理计划名称变更为“光大阳光对冲 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划”，光大阳光稳健添利集合资产管理计划份额转换为光大阳光对冲 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划 A 类份额。合同变更后，本集合计划的托管人，登记机构不变。自 2020 年 3 月 25 日起《光大阳光对冲 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》、《光大阳光对冲 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划托管协议》生效。本集合计划存续期至 2024 年 12 月 31 日，本集合计划自 2024 年 12 月 31 日后，按照中国证监会的有关规定执行。本集合计划管理人为上海光大证券资产管理有限公司，托管人为广发银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《光大阳光对冲 6 个月持有期灵活配置混合型集

合资产管理计划资产管理合同》，本集合计划的投资范围为：具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或同意注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券（含超短期融资券）、公司债、中期票据、可交换债券、可转换债券（含可分离可转换债券））、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、股指期货以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本集合计划可以参与融券业务。如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本集合计划的投资组合比例为：股票资产占集合计划资产的比例为 0%-95%；投资银行存款和同业存单合计占比不超过集合计划资产的 20%；本集合计划权益类多头头寸价值减去权益类空头头寸价值，占集合计划资产净值比例范围 0-10%。其中，权益类多头头寸价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合正风险敞口暴露价值及其他权益类工具多头价值的合计值。权益类空头头寸价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合负风险敞口暴露价值及其他权益类工具空头价值的合计值；每个交易日日终，持有的买入股指期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过集合计划资产净值的 95%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于集合计划资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本集合计划投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。

本集合计划的业绩比较基准为：中国人民银行公布的同期 1 年期银行定期存款基准利率（税后）+1%。

本财务报表由本集合计划的集合计划管理人上海光大证券资产管理有限公司于 2024 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 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 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划 2023 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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本集合计划的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本集合计划成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本集合计划管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本集合计划现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本集合计划持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本集合计划管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本集合计划持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本集合计划将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本集合计划将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本集合计划目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本集合计划持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本集合计划将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债,相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,确认为应计利息,包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债,相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

本集合计划对于以摊余成本计量的金融资产,以预期信用损失为基础确认损失准备。

本集合计划考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息,以发生违约的风险为权重,计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额,确认预期信用损失。

于每个资产负债表日,本集合计划对处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的,处于第一阶段,本集合计划按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备;金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的,处于第二阶段,本集合计划按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备;金融工具自初始确认后已经发生信用减值的,处于第三阶段,本集合计划按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具,本集合计划假设其信用风险自初始确认

后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本集合计划对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本集合计划将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本集合计划将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本集合计划既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，集合计划管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本集合计划持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本集合计划 1) 具有抵销

已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行集合计划份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于集合计划申购确认日及集合计划赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括集合计划转换所引起的转入集合计划的实收基金增加和转出集合计划的实收基金减少。

本集合计划发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予集合计划份额持有人在集合计划清算时按比例份额获得该集合计划净资产的权利，这里所指集合计划净资产是扣除所有优先于该集合计划份额对集合计划资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将集合计划的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以集合计划份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本集合计划份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对集合计划资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中（该类别次于其他所有工具类别），所有工具具有相同的特征（例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同）；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该集合计划份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该集合计划存续期内集合计划的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括本集合计划的任何影响）。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本集合计划没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于集合计划的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括该集合计划或合同的任何影响）；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本集合计划将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于集合计划申购确认日或集合计划赎回确认日认列，并于期末全额转入未

分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由集合计划管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由集合计划管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按集合计划合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本集合计划同一级别的每一集合计划份额享有同等分配权。本集合计划收益以现金形式分配,但集合计划份额持有人可选择现金红利或将现金红利按收益分配基准日的集合计划份额净值自动转为集合计划份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括集合计划经营活动产生的未实现损益以及集合计划份额交易产生的未实现平准金等,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配集合计划收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目,于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币,所产

生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本集合计划以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本集合计划内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本集合计划的集合计划管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本集合计划能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本集合计划目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本集合计划的估值原则和中国证监会允许的行业估值实务操作，本集合计划确定以下以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本集合计划参考中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本集合计划持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本集合计划持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

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

(2) 对集合计划从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对集合计划取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向集合计划支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对集合计划从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，

暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对集合计划持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。集合计划通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本集合计划的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	9,685,107.10	13,222,574.40
等于：本金	9,683,341.05	13,220,310.59
加：应计利息	1,766.05	2,263.81
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	9,685,107.10	13,222,574.40

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		154,973,508.95	-	154,817,897.28	-155,611.67
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	37,794,014.28	164,825.00	38,399,059.25	440,219.97
	银行间市场	10,022,110.00	124,327.87	10,130,327.87	-16,110.00
	合计	47,816,124.28	289,152.87	48,529,387.12	424,109.97
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		202,789,633.23	289,152.87	203,347,284.40	268,498.30
项目		上年度末 2022年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		189,240,053.50	-	184,793,787.97	-4,446,265.53
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	31,490,966.40	72,927.77	31,254,444.39	-309,449.78
	银行间市场	30,187,728.22	635,583.56	30,773,583.56	-49,728.22
	合计	61,678,694.62	708,511.33	62,028,027.95	-359,178.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		250,918,748.12	708,511.33	246,821,815.92	-4,805,443.53

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍	-	-	-	-

生工具				
权益衍生工具	-140,350,020.19	-	-	-
其中：股指期货投资	-140,350,020.19	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-140,350,020.19	-	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-171,028,849.28	-	-	-
其中：股指期货投资	-171,028,849.28	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-171,028,849.28	-	-	-

注：

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2403	IC2403	-28.00	-30,321,760.00	137,856.55
IF2401	IF2401	-7.00	-7,223,580.00	-206,340.00
IF2402	IF2402	-1.00	-1,033,740.00	-28,440.00
IF2403	IF2403	-45.00	-46,653,300.00	999,360.00
IM2401	IM2401	-4.00	-4,710,400.00	-110,240.00
IM2402	IM2402	-1.00	-1,172,960.00	360.00
IM2403	IM2403	-41.00	-47,942,120.00	499,603.64
合计				1,292,160.19
减：可抵销期货暂收款				1,292,160.19
净额				-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，

结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本集合计划本报告期末及上年度末无黄金衍生品。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	6,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	6,000,000.00	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	7,998,513.70	-
银行间市场	-	-
合计	7,998,513.70	-

7.4.7.4.2 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及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

本集合计划本报告期末及上年度末未持有债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本集合计划本报告期末及上年度末未计提债权投资减值准备。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

本集合计划本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本集合计划本报告期末及上年度末未计提其他债权投资减值准备。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本集合计划本报告期末及上年度末未持有其他权益工具投资。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本集合计划本报告期末及上年度末未持有其他权益工具投资。

7.4.7.8 其他资产

本集合计划本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	379,940.22	721,107.13
其中：交易所市场	379,238.84	721,107.13
银行间市场	701.38	-
应付利息	-	-
预提费用	151,000.00	140,000.00
合计	530,940.22	861,107.13

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

光大阳光对冲 6 个月持有混合 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,615,678.28	2,615,678.28
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-309,788.72	-309,788.72
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,305,889.56	2,305,889.56

光大阳光对冲 6 个月持有混合 B

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	37,128,843.54	37,128,843.54
本期申购	260,643.98	260,643.98

本期赎回（以“-”号填列）	-1,472,046.11	-1,472,046.11
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	35,917,441.41	35,917,441.41

光大阳光对冲 6 个月持有混合 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	266,975,830.96	266,975,830.96
本期申购	1,449,033.13	1,449,033.13
本期赎回（以“-”号填列）	-82,323,972.46	-82,323,972.46
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	186,100,891.63	186,100,891.63

7.4.7.11 其他综合收益

本集合计划本报告期无其他综合收益。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

光大阳光对冲 6 个月持有混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	549,048.83	-465,768.94	83,279.89
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	549,048.83	-465,768.94	83,279.89
本期利润	28,366.89	28,334.51	56,701.40
本期基金份额交易产生的变动数	-13,100.21	496.19	-12,604.02
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-13,100.21	496.19	-12,604.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	564,315.51	-436,938.24	127,377.27

光大阳光对冲 6 个月持有混合 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,909,703.60	-1,026,692.45	883,011.15
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-

本期期初	1,909,703.60	-1,026,692.45	883,011.15
本期利润	618,513.78	434,903.98	1,053,417.76
本期基金份额交易产生的变动数	-64,190.34	4,594.07	-59,596.27
其中：基金申购款	16,908.13	-752.02	16,156.11
基金赎回款	-81,098.47	5,346.09	-75,752.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,464,027.04	-587,194.40	1,876,832.64

光大阳光对冲 6 个月持有混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,559,919.10	-7,143,309.15	3,416,609.95
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	10,559,919.10	-7,143,309.15	3,416,609.95
本期利润	3,858,285.45	2,310,214.25	6,168,499.70
本期基金份额交易产生的变动数	-4,541,014.09	1,802,273.59	-2,738,740.50
其中：基金申购款	81,226.65	-34,660.04	46,566.61
基金赎回款	-4,622,240.74	1,836,933.63	-2,785,307.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,877,190.46	-3,030,821.31	6,846,369.15

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	78,274.70	198,716.49
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	37,403.52	222,154.83
其他	2,040.39	4,981.59
合计	117,718.61	425,852.91

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	-523,881.85	-34,503,592.30
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	-523,881.85	-34,503,592.30

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
卖出股票成交总额	2,098,518,708.54	2,373,245,004.96
减：卖出股票成本 总额	2,095,614,426.06	2,402,918,838.58
减：交易费用	3,428,164.33	4,829,758.68
买卖股票差价收 入	-523,881.85	-34,503,592.30

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本集合计划本报告期及上年度可比期间无股票出借差价收入。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
债券投资收益——利息 收入	1,007,988.92	2,912,580.61
债券投资收益——买卖 债券（债转股及债券到 期兑付）差价收入	-1,779,587.38	-1,139,007.56
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	-771,598.46	1,773,573.05

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	645,929,539.32	419,477,898.62
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	644,394,940.21	415,131,646.67
减：应计利息总额	3,266,204.41	5,471,111.25
减：交易费用	47,982.08	14,148.26
买卖债券差价收入	-1,779,587.38	-1,139,007.56

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期及上年度可比期间无债券赎回差价收入。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期及上年度可比期间无债券申购差价收入。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
资产支持证券投资收益——利息收入	-	34,689.00
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-	-
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-	34,689.00

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	-	4,962,770.23

减：卖出资产支持证券成本总额	-	4,927,500.00
减：应计利息总额	-	35,270.23
减：交易费用	-	-
资产支持证券投资收益	-	-

注：上述交易费用（如有）包含资产支持证券买卖产生的交易费用。

7.4.7.16.3 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及上年度可比期间无资产支持证券赎回差价收入。

7.4.7.16.4 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及上年度可比期间无资产支持证券申购差价收入。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本集合计划本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本集合计划本报告期及上年度可比期间无贵金属买卖差价收入。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期及上年度可比期间无贵金属赎回差价收入。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期及上年度可比期间无贵金属申购差价收入。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本集合计划本报告期及上年度可比期间无买卖权证差价收入。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
股指期货投资收益	6,710,805.80	29,783,807.59

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
股票投资产生的股利收益	3,249,561.63	4,373,750.90

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	3,249,561.63	4,373,750.90

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	5,073,941.83	-5,954,546.00
股票投资	4,290,653.86	-3,643,131.65
债券投资	783,287.97	-2,311,414.35
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-2,300,489.09	4,940,705.17
权证投资	-	-
期货投资	-2,300,489.09	4,940,705.17
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	2,773,452.74	-1,013,840.83

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
其他收入	-	62.11
合计	-	62.11

7.4.7.22 信用减值损失

本集合计划本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	31,000.00	20,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00

证券出借违约金	-	-
银行费用	600.00	200.00
账户维护费	37,200.00	37,200.00
其他	-	18,679.09
合计	188,800.00	196,079.09

7.4.7.24 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本集合计划并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
上海光大证券资产管理有限公司（“光证资管”）	集合计划管理人、集合计划销售机构
广发银行股份有限公司	集合计划托管人、集合计划代销机构
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	集合计划销售机构、集合计划管理人的股东
光大期货有限公司（“光大期货”）	集合计划管理人的股东控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	4,157,666,344.45	100.00	4,743,686,157.01	100.00

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31 日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	1,178,368,612.23	100.00	395,021,870.99	100.00

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
光大证券	1,407,240,000.00	100.00	3,631,500,000.00	100.00

7.4.10.1.4 权证交易

本集合计划本报告期及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31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	1,399,452.58	100.00	379,238.84	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	2,028,229.42	100.00	721,107.13	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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,725,345.70	3,846,664.46
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,298,972.50	1,859,374.23

应支付基金管理人的净管理费	1,426,373.20	1,987,290.23
---------------	--------------	--------------

注：不同类别份额的管理费分别计算，从相应类别份额的资产净值中扣除。

A 类份额的固定年管理费率为 1.5%

B 类、C 类份额的年管理费率为 1.0%

本集合计划的管理费计算方法如下：

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

G 为各类份额每日应计提的集合计划管理费

E 为各类份额前一日集合计划资产净值

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	542,592.15	766,406.28

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

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

T 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 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			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C	合计
光大证券	-	-	1,222.74	1,222.74
光证资管	-	-	3.65	3.65
合计	-	-	1,226.39	1,226.39
获得销售服务费的	上年度可比期间			

各关联方名称	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C	合计
光大证券	-	-	3,073.41	3,073.41
光证资管	-	-	3.65	3.65
合计	-	-	3,077.06	3,077.06

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

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

H 为 C 类份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类份额前一日集合计划资产净值

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

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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不存在集合计划管理人运用自有资金投资本集合计划的情况。

7.4.10.5.2 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

本报告期及上年度可比期间不存在除集合计划管理人之外的其他关联方投资本集合计划的情况。

7.4.10.6 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 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发银行股份有限公司	9,685,107.10	78,274.70	13,222,574.40	198,716.49

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。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本集合计划支付给光大期货的股指期货交易手续费参考市场价格经本集合的管理人与对方协商确定，以包括中国金融期货交易所收取的上交手续费的全额列示。于本报告期，本集合计划支付的交易手续费为40,203.38元(上年度：76,943.84元)。本集合计划用于期货交易结算的资金分别存放于光大期货的结算账户和保证金账户中，结算备付金按银行同业利率计息，由光大期货进行结息处理，存出保证金不计息。于本期末，本集合的结算备付金余额为1,411,036.63元(上年度末：19,079,555.61元)，存出保证金余额为16,686,943.2元(上年度末：23,019,897.60元)。

7.4.11 利润分配情况

本集合计划本报告期未进行利润分配。

7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001306	夏厦精密	2023年11月9日	6个月	新股流通受限	53.63	75.36	33	1,769.79	2,486.88	-
300904	威力传动	2023年8月2日	6个月	新股流通受限	35.41	61.53	180	6,373.80	11,075.40	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股流通受限	25.82	31.80	225	5,809.50	7,155.00	-

301348	蓝箭电子	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	18.08	44.57	335	6,056.80	14,930.95	-
301499	维科精密	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	19.50	28.93	243	4,738.50	7,029.99	-
301510	固高科技	2023年8月4日	6个月	新股流通受限	12.00	35.01	252	3,024.00	8,822.52	-
301555	惠柏新材	2023年10月24日	6个月	新股流通受限	22.88	32.44	132	3,020.16	4,282.08	-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月	新股流通受限	1.70	4.06	1,575	2,677.50	6,394.50	-
603107	上海汽配	2023年10月25日	6个月	新股流通受限	14.23	18.19	147	2,091.81	2,673.93	-
603119	浙江荣泰	2023年7月21日	6个月	新股流通受限	15.32	23.87	124	1,899.68	2,959.88	-
603276	恒兴新材	2023年9月18日	6个月	新股流通受限	25.73	24.88	94	2,418.62	2,338.72	-
688450	光格科技	2023年7月17日	6个月	新股流通受限	53.09	36.42	105	5,574.45	3,824.10	-
688648	中邮科技	2023年11月6日	6个月	新股流通受限	15.18	21.43	192	2,914.56	4,114.56	-
688651	盛邦安全	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	39.90	46.05	116	4,628.40	5,341.80	-
688702	盛科通信	2023年9月6日	6个月	新股流通受限	42.66	48.18	157	6,697.62	7,564.26	-
688716	中研股份	2023年9月13日	6个月	新股流通受限	29.66	36.39	178	5,279.48	6,477.42	-

注：1、集合计划可使用以集合计划名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申

购。其中集合计划参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；集合计划参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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

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

4、集合计划通过询价转让受让的科创板股份，在受让后6个月内不得转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本集合计划本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	4,020,931.51	-
合计	4,020,931.51	-

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级中包含国债。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

7.4.13.2.4 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	4,907,633.18	25,011,330.25
AAA以下	29,470,494.56	26,886,374.41
未评级	10,130,327.87	10,130,323.29
合计	44,508,455.61	62,028,027.95

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2、未评级中包含政策性金融债。

7.4.13.2.5 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及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 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及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 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7.4.12“期末(2023年12月31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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	9,685,107.10	-	-	-	9,685,107.10
结算备付金	4,133,988.03	-	-	-	4,133,988.03
存出保证金	16,854,314.13	-	-	-	16,854,314.13
交易性金融资产	18,594,850.04	28,548,587.81	1,385,949.27	154,817,897.28	203,347,284.40
买入返售金融资产	6,000,000.00	-	-	-	6,000,000.00
应收清算款	-	-	-	229,604.88	229,604.88
资产总计	55,268,259.30	28,548,587.81	1,385,949.27	155,047,502.16	240,250,298.54
负债					
应付赎回款	-	-	-	533,973.04	533,973.04
应付管理人报酬	-	-	-	200,660.11	200,660.11
应付托管费	-	-	-	39,925.79	39,925.79
应付清算款	-	-	-	5,702,424.43	5,702,424.43
应付销售服务费	-	-	-	66,213.82	66,213.82
应交税费	-	-	-	1,359.47	1,359.47
其他负债	-	-	-	530,940.22	530,940.22
负债总计	-	-	-	7,075,496.88	7,075,496.88
利率敏感度缺口	55,268,259.30	28,548,587.81	1,385,949.27	147,972,005.28	233,174,801.66
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	13,222,574.40	-	-	-	13,222,574.40
结算备付金	24,889,194.26	-	-	-	24,889,194.26
存出保证金	23,127,903.63	-	-	-	23,127,903.63
交易性金融资产	30,773,583.56	29,497,421.72	1,757,022.67	184,793,787.97	246,821,815.92
买入返售金融资产	7,998,513.70	-	-	-	7,998,513.70
应收申购款	-	-	-	2,500.00	2,500.00

应收清算款	-	-	-	128,779.80	128,779.80
资产总计	100,011,769.55	29,497,421.72	1,757,022.67	184,925,067.77	316,191,281.71
负债					
应付赎回款	-	-	-	451,911.94	451,911.94
应付管理人报酬	-	-	-	268,610.02	268,610.02
应付托管费	-	-	-	53,492.73	53,492.73
应付清算款	-	-	-	3,357,407.22	3,357,407.22
应付销售服务费	-	-	-	93,149.85	93,149.85
应交税费	-	-	-	2,349.05	2,349.05
其他负债	-	-	-	861,107.13	861,107.13
负债总计	-	-	-	5,088,027.94	5,088,027.94
利率敏感度缺口	100,011,769.55	29,497,421.72	1,757,022.67	179,837,039.83	311,103,253.77

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。

7.4.13.4.1.2 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（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	市场利率上升 25 个基点	-17,634.34	-22,732.23
市场利率下降 25 个基点	17,634.34	22,732.23	

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 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	154,817,897.28	66.40	184,793,787.97	59.40
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	154,817,897.28	66.40	184,793,787.97	59.40

7.4.13.4.3.2 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（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%		6,312,545.71
沪深 300 指数下降 5%		-6,312,545.71	-8,414,467.00

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	188,298,334.70	215,616,320.03
第二层次	14,951,477.71	31,016,281.36
第三层次	97,471.99	189,214.53
合计	203,347,284.40	246,821,815.92

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	189,214.53	189,214.53
当期购买	-	213,921.24	213,921.24
当期出售/结算	-	0.00	0.00
转入第三层次	-	0.00	0.00
转出第三层次	-	435,594.07	435,594.07
当期利得或损失总额	-	129,930.29	129,930.29
其中：计入损益的利得或损失	-	129,930.29	129,930.29
计入其他综合收益的利得或损失	-	0.00	0.00

期末余额	-	97,471.99	97,471.99
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	32,497.32	32,497.32
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	992,831.02	992,831.02
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	765,248.56	765,248.56
转出第三层次	-	1,501,091.71	1,501,091.71
当期利得或损失总额	-	-67,773.34	-67,773.34
其中：计入损益的利得或损失	-	-67,773.34	-67,773.34
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	189,214.53	189,214.53
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	18,873.52	18,873.52

注：于本期末，本集合计划持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于本期，本集合计划从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	97,471.99	平均价格亚式期权模型	流动性折扣	0.0103-0.275	折扣率越高，公允价值越低
项目	上年度末公	采用的估值	不可观察输入值		

	允价值	技术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	189,214.53	平均价格亚式期权模型	流动性折扣	0.0017-0.2700	折扣率越高，公允价值越低

7.4.14.3 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(上期末：同)。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	154,817,897.28	64.44
	其中：股票	154,817,897.28	64.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	48,529,387.12	20.20
	其中：债券	48,529,387.12	20.20
	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	6,000,000.00	2.50
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	13,819,095.13	5.75
8	其他各项资产	17,083,919.01	7.11
9	合计	240,250,298.54	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。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	539,970.00	0.23
B	采矿业	7,751,760.34	3.32
C	制造业	103,844,678.85	44.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,233,986.00	2.67
E	建筑业	3,618,218.00	1.55
F	批发和零售业	4,471,510.73	1.92
G	交通运输、仓储和邮政业	2,781,365.80	1.19
H	住宿和餐饮业	294,368.00	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,510,402.46	3.22
J	金融业	12,457,175.98	5.34
K	房地产业	1,846,692.00	0.79
L	租赁和商务服务业	1,525,520.00	0.65
M	科学研究和技术服务业	306,634.00	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	153,725.00	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	769,517.12	0.33
R	文化、体育和娱乐业	712,373.00	0.31
S	综合	-	-
	合计	154,817,897.28	66.40

8.2.2 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。

8.3 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	601688	华泰证券	98,000	1,367,100.00	0.59
2	601225	陕西煤业	63,600	1,328,604.00	0.57
3	601288	农业银行	353,300	1,286,012.00	0.55
4	600519	贵州茅台	719	1,240,994.00	0.53
5	601998	中信银行	229,800	1,215,642.00	0.52
6	601857	中国石油	147,800	1,043,468.00	0.45
7	600153	建发股份	104,300	1,004,409.00	0.43
8	600019	宝钢股份	168,000	996,240.00	0.43
9	601618	中国中冶	320,100	979,506.00	0.42
10	000338	潍柴动力	71,100	970,515.00	0.42
11	603501	韦尔股份	8,800	939,048.00	0.40
12	600737	中粮糖业	112,100	923,704.00	0.40
13	002032	苏泊尔	16,300	864,063.00	0.37

14	000921	海信家电	42,000	856,800.00	0.37
15	603920	世运电路	46,400	848,192.00	0.36
16	600887	伊利股份	30,000	802,500.00	0.34
17	603833	欧派家居	11,500	800,515.00	0.34
18	300558	贝达药业	15,500	799,025.00	0.34
19	600346	恒力石化	60,600	798,102.00	0.34
20	300274	阳光电源	8,900	779,551.00	0.33
21	300015	爱尔眼科	48,500	767,270.00	0.33
22	601939	建设银行	116,000	755,160.00	0.32
23	601168	西部矿业	52,600	750,602.00	0.32
24	002027	分众传媒	118,600	749,552.00	0.32
25	600188	兖矿能源	37,200	736,932.00	0.32
26	002158	汉钟精机	33,100	736,806.00	0.32
27	300014	亿纬锂能	17,200	725,840.00	0.31
28	002648	卫星化学	48,900	721,275.00	0.31
29	601021	春秋航空	14,100	707,820.00	0.30
30	688036	传音控股	5,100	705,840.00	0.30
31	300782	卓胜微	5,000	705,000.00	0.30
32	002367	康力电梯	93,600	703,872.00	0.30
33	000650	仁和药业	105,900	702,117.00	0.30
34	603699	纽威股份	50,300	697,158.00	0.30
35	601500	通用股份	166,600	689,724.00	0.30
36	600036	招商银行	24,709	687,404.38	0.29
37	002083	孚日股份	133,700	673,848.00	0.29
38	002381	双箭股份	88,500	670,830.00	0.29
39	000651	格力电器	20,400	656,268.00	0.28
40	688223	晶科能源	73,700	652,982.00	0.28
41	688169	石头科技	2,300	650,785.00	0.28
42	300750	宁德时代	3,889	634,918.14	0.27
43	000858	五粮液	4,500	631,395.00	0.27
44	601318	中国平安	15,626	629,727.80	0.27
45	000895	双汇发展	23,300	622,343.00	0.27
46	003012	东鹏控股	72,150	595,237.50	0.26
47	601865	福莱特	22,100	590,070.00	0.25
48	600066	宇通客车	44,000	583,000.00	0.25
49	600623	华谊集团	86,500	557,060.00	0.24
50	002493	荣盛石化	52,900	547,515.00	0.23
51	000528	柳工	80,200	540,548.00	0.23
52	300253	卫宁健康	74,200	533,498.00	0.23
53	002007	华兰生物	24,000	531,120.00	0.23
54	002273	水晶光电	38,600	522,644.00	0.22
55	601163	三角轮胎	36,000	518,760.00	0.22
56	603156	养元饮品	24,400	518,744.00	0.22

57	000539	粤电力A	105,800	517,362.00	0.22
58	002498	汉缆股份	128,700	514,800.00	0.22
59	603228	景旺电子	22,800	514,368.00	0.22
60	002697	红旗连锁	102,900	512,442.00	0.22
61	600223	福瑞达	53,000	510,390.00	0.22
62	000100	TCL科技	117,060	503,358.00	0.22
63	600845	宝信软件	10,100	492,880.00	0.21
64	000737	北方铜业	84,900	492,420.00	0.21
65	000973	佛塑科技	100,100	489,489.00	0.21
66	603886	元祖股份	26,800	488,564.00	0.21
67	002833	弘亚数控	27,400	486,076.00	0.21
68	300894	火星人	29,900	485,576.00	0.21
69	300888	稳健医疗	12,980	483,505.00	0.21
70	600901	江苏金租	98,320	475,868.80	0.20
71	600201	生物股份	43,483	468,311.91	0.20
72	600710	苏美达	64,800	459,432.00	0.20
73	002938	鹏鼎控股	20,300	453,096.00	0.19
74	603899	晨光股份	11,800	443,090.00	0.19
75	600023	浙能电力	96,000	442,560.00	0.19
76	603063	禾望电气	17,700	442,500.00	0.19
77	300498	温氏股份	21,900	439,314.00	0.19
78	600989	宝丰能源	29,700	438,669.00	0.19
79	600875	东方电气	29,900	437,138.00	0.19
80	600900	长江电力	18,700	436,458.00	0.19
81	601808	中海油服	29,800	435,676.00	0.19
82	300628	亿联网络	14,720	434,976.00	0.19
83	600795	国电电力	104,300	433,888.00	0.19
84	300687	赛意信息	19,900	433,422.00	0.19
85	688127	蓝特光学	18,600	433,194.00	0.19
86	600426	华鲁恒升	15,700	433,163.00	0.19
87	002916	深南电路	6,100	433,039.00	0.19
88	601088	中国神华	13,800	432,630.00	0.19
89	000059	华锦股份	78,200	429,318.00	0.18
90	600578	京能电力	145,000	429,200.00	0.18
91	603368	柳药集团	22,600	427,592.00	0.18
92	000990	诚志股份	51,800	425,278.00	0.18
93	688100	威胜信息	14,700	425,124.00	0.18
94	600966	博汇纸业	68,400	424,764.00	0.18
95	002960	青鸟消防	30,600	423,504.00	0.18
96	000729	燕京啤酒	48,900	422,007.00	0.18
97	603055	台华新材	35,000	421,400.00	0.18
98	002206	海利得	83,900	421,178.00	0.18
99	000791	甘肃能源	75,400	419,978.00	0.18

100	603043	广州酒家	21,500	419,895.00	0.18
101	603989	艾华集团	19,500	419,640.00	0.18
102	600285	羚锐制药	24,500	419,195.00	0.18
103	600284	浦东建设	66,400	418,320.00	0.18
104	002991	甘源食品	5,800	414,468.00	0.18
105	002557	洽洽食品	11,800	410,876.00	0.18
106	002088	鲁阳节能	28,800	410,400.00	0.18
107	603208	江山欧派	13,800	409,722.00	0.18
108	603093	南华期货	34,000	408,000.00	0.17
109	000612	焦作万方	70,400	404,800.00	0.17
110	688278	特宝生物	7,700	403,095.00	0.17
111	000690	宝新能源	90,800	402,244.00	0.17
112	601100	恒立液压	7,200	393,696.00	0.17
113	002984	森麒麟	13,600	392,360.00	0.17
114	600746	江苏索普	53,200	389,424.00	0.17
115	300433	蓝思科技	29,500	389,400.00	0.17
116	601137	博威合金	24,900	386,697.00	0.17
117	600406	国电南瑞	17,300	386,136.00	0.17
118	300408	三环集团	13,100	385,795.00	0.17
119	300124	汇川技术	6,100	385,154.00	0.17
120	603979	金诚信	10,200	385,152.00	0.17
121	002841	视源股份	8,400	384,384.00	0.16
122	000983	山西焦煤	38,900	384,332.00	0.16
123	001289	龙源电力	19,400	384,314.00	0.16
124	300979	华利集团	7,300	384,272.00	0.16
125	003816	中国广核	123,500	384,085.00	0.16
126	600803	新奥股份	22,800	383,496.00	0.16
127	000708	中信特钢	27,300	383,292.00	0.16
128	600183	生益科技	20,900	382,679.00	0.16
129	603195	公牛集团	4,000	382,600.00	0.16
130	600588	用友网络	21,500	382,485.00	0.16
131	000333	美的集团	7,000	382,410.00	0.16
132	601689	拓普集团	5,200	382,200.00	0.16
133	300957	贝泰妮	5,600	381,752.00	0.16
134	601899	紫金矿业	30,629	381,637.34	0.16
135	601908	京运通	83,400	381,138.00	0.16
136	600741	华域汽车	23,400	380,952.00	0.16
137	600030	中信证券	18,700	380,919.00	0.16
138	601601	中国太保	16,000	380,480.00	0.16
139	603369	今世缘	7,800	380,250.00	0.16
140	000408	藏格矿业	15,000	380,100.00	0.16
141	002736	国信证券	44,500	380,030.00	0.16
142	601607	上海医药	22,701	379,787.73	0.16

143	601336	新华保险	12,200	379,786.00	0.16
144	600918	中泰证券	55,300	379,358.00	0.16
145	601169	北京银行	83,700	379,161.00	0.16
146	601398	工商银行	79,300	379,054.00	0.16
147	600585	海螺水泥	16,800	379,008.00	0.16
148	601328	交通银行	66,000	378,840.00	0.16
149	600061	国投资本	56,200	378,788.00	0.16
150	688033	天宜上佳	22,400	378,560.00	0.16
151	688303	大全能源	12,800	378,496.00	0.16
152	600016	民生银行	101,100	378,114.00	0.16
153	000792	盐湖股份	23,700	378,015.00	0.16
154	600438	通威股份	15,100	377,953.00	0.16
155	601898	中煤能源	39,000	377,910.00	0.16
156	601009	南京银行	51,200	377,856.00	0.16
157	600015	华夏银行	67,200	377,664.00	0.16
158	601916	浙商银行	149,800	377,496.00	0.16
159	603260	合盛硅业	7,400	377,400.00	0.16
160	603328	依顿电子	46,200	376,530.00	0.16
161	002001	新和成	22,200	376,512.00	0.16
162	600309	万华化学	4,900	376,418.00	0.16
163	600048	保利发展	38,000	376,200.00	0.16
164	600606	绿地控股	163,400	375,820.00	0.16
165	000157	中联重科	57,500	375,475.00	0.16
166	000069	华侨城A	120,300	374,133.00	0.16
167	600600	青岛啤酒	5,000	373,750.00	0.16
168	605007	五洲特纸	25,400	373,634.00	0.16
169	600233	圆通速递	30,400	373,616.00	0.16
170	600018	上港集团	76,100	372,890.00	0.16
171	300308	中际旭创	3,300	372,603.00	0.16
172	000877	天山股份	55,700	372,076.00	0.16
173	002558	巨人网络	33,200	369,848.00	0.16
174	603338	浙江鼎力	7,200	368,424.00	0.16
175	300122	智飞生物	6,000	366,660.00	0.16
176	600312	平高电气	28,800	365,472.00	0.16
177	603225	新凤鸣	25,700	364,940.00	0.16
178	603113	金能科技	45,100	363,957.00	0.16
179	000426	兴业银锡	39,900	362,292.00	0.16
180	002873	新天药业	29,000	361,340.00	0.15
181	002262	恩华药业	13,300	360,696.00	0.15
182	603232	格尔软件	26,300	360,047.00	0.15
183	002782	可立克	25,600	359,680.00	0.15
184	603676	卫信康	34,400	358,792.00	0.15
185	002731	萃华珠宝	32,300	357,238.00	0.15

186	688226	威腾电气	19,000	357,200.00	0.15
187	002437	誉衡药业	142,300	357,173.00	0.15
188	001207	联科科技	20,800	354,640.00	0.15
189	002443	金洲管道	51,700	354,145.00	0.15
190	300453	三鑫医疗	46,400	354,032.00	0.15
191	688310	迈得医疗	11,800	352,820.00	0.15
192	002130	沃尔核材	46,500	351,075.00	0.15
193	603505	金石资源	12,900	350,235.00	0.15
194	002085	万丰奥威	70,200	346,788.00	0.15
195	300638	广和通	18,200	346,346.00	0.15
196	600206	有研新材	27,700	343,203.00	0.15
197	601567	三星医疗	16,600	340,300.00	0.15
198	002003	伟星股份	31,200	338,520.00	0.15
199	603317	天味食品	25,200	334,908.00	0.14
200	002390	信邦制药	75,200	333,888.00	0.14
201	603100	川仪股份	12,000	332,640.00	0.14
202	000966	长源电力	74,200	328,706.00	0.14
203	603187	海容冷链	21,500	325,940.00	0.14
204	002283	天润工业	55,700	325,845.00	0.14
205	000567	海德股份	30,600	325,278.00	0.14
206	000061	农产品	49,900	322,853.00	0.14
207	603279	景津装备	14,600	322,806.00	0.14
208	002891	中宠股份	12,200	321,470.00	0.14
209	300532	今天国际	19,500	320,190.00	0.14
210	603283	赛腾股份	4,400	319,264.00	0.14
211	603010	万盛股份	29,500	318,305.00	0.14
212	000589	贵州轮胎	52,000	318,240.00	0.14
213	603929	亚翔集成	13,300	318,136.00	0.14
214	300377	赢时胜	40,700	315,832.00	0.14
215	600810	神马股份	42,400	315,456.00	0.14
216	003006	百亚股份	20,800	315,328.00	0.14
217	000600	建投能源	62,800	314,628.00	0.13
218	000538	云南白药	6,400	314,560.00	0.13
219	002677	浙江美大	31,100	314,421.00	0.13
220	601886	江河集团	47,100	313,686.00	0.13
221	002043	兔宝宝	35,400	313,644.00	0.13
222	000597	东北制药	58,600	313,510.00	0.13
223	002393	力生制药	12,000	313,200.00	0.13
224	300682	朗新集团	19,100	313,049.00	0.13
225	000019	深粮控股	41,500	312,910.00	0.13
226	002838	道恩股份	24,400	312,564.00	0.13
227	688128	中国电研	15,200	311,904.00	0.13
228	603583	捷昌驱动	15,500	310,465.00	0.13

229	605338	巴比食品	14,400	309,312.00	0.13
230	002946	新乳业	26,900	308,812.00	0.13
231	600696	岩石股份	17,100	307,629.00	0.13
232	601965	中国汽研	13,900	306,634.00	0.13
233	603530	神马电力	14,700	304,878.00	0.13
234	603997	继峰股份	22,400	301,728.00	0.13
235	600761	安徽合力	16,400	298,644.00	0.13
236	603298	杭叉集团	12,000	298,560.00	0.13
237	000951	中国重汽	22,200	296,592.00	0.13
238	603197	保隆科技	5,200	293,280.00	0.13
239	601186	中国铁建	38,100	289,941.00	0.12
240	002563	森马服饰	50,100	289,077.00	0.12
241	603799	华友钴业	8,750	288,137.50	0.12
242	002171	楚江新材	38,500	287,980.00	0.12
243	002416	爱施德	30,900	287,061.00	0.12
244	300450	先导智能	11,200	286,720.00	0.12
245	600586	金晶科技	42,500	283,900.00	0.12
246	600420	国药现代	28,900	282,931.00	0.12
247	300319	麦捷科技	29,300	282,452.00	0.12
248	300348	长亮科技	27,100	279,401.00	0.12
249	603008	喜临门	16,400	278,964.00	0.12
250	600211	西藏药业	5,700	278,160.00	0.12
251	300001	特锐德	13,800	277,380.00	0.12
252	000887	中鼎股份	22,400	277,088.00	0.12
253	002859	洁美科技	11,100	276,945.00	0.12
254	300409	道氏技术	24,800	276,272.00	0.12
255	002061	浙江交科	75,500	275,575.00	0.12
256	605589	圣泉集团	12,300	275,274.00	0.12
257	688617	惠泰医疗	700	271,950.00	0.12
258	002402	和而泰	19,000	271,510.00	0.12
259	688559	海目星	7,600	271,320.00	0.12
260	601609	金田股份	39,900	270,123.00	0.12
261	600787	中储股份	52,600	268,260.00	0.12
262	000062	深圳华强	23,600	265,972.00	0.11
263	000997	新大陆	13,500	264,735.00	0.11
264	002204	大连重工	57,900	264,603.00	0.11
265	600575	淮河能源	109,700	264,377.00	0.11
266	300850	新强联	8,300	264,189.00	0.11
267	603105	芯能科技	22,800	264,024.00	0.11
268	001213	中铁特货	62,700	263,340.00	0.11
269	688088	虹软科技	6,400	262,656.00	0.11
270	600276	恒瑞医药	5,800	262,334.00	0.11
271	300476	胜宏科技	14,200	261,990.00	0.11

272	600929	雪天盐业	40,600	261,870.00	0.11
273	300036	超图软件	12,500	261,250.00	0.11
274	002302	西部建设	40,300	261,144.00	0.11
275	603983	丸美股份	10,300	260,281.00	0.11
276	300767	震安科技	14,900	258,962.00	0.11
277	600038	中直股份	6,700	258,151.00	0.11
278	300068	南都电源	19,900	257,506.00	0.11
279	300679	电连技术	6,200	257,300.00	0.11
280	000030	富奥股份	47,900	255,786.00	0.11
281	300118	东方日升	14,200	250,630.00	0.11
282	300303	聚飞光电	41,400	245,502.00	0.11
283	000543	皖能电力	38,600	241,636.00	0.10
284	600258	首旅酒店	15,400	240,548.00	0.10
285	600161	天坛生物	7,700	238,238.00	0.10
286	002649	博彦科技	19,300	236,811.00	0.10
287	600057	厦门象屿	35,100	235,521.00	0.10
288	002106	莱宝高科	22,100	235,144.00	0.10
289	000568	泸州老窖	1,302	233,604.84	0.10
290	603730	岱美股份	16,100	233,289.00	0.10
291	600797	浙大网新	35,400	232,224.00	0.10
292	601126	四方股份	16,400	232,224.00	0.10
293	002439	启明星辰	8,600	232,200.00	0.10
294	300394	天孚通信	2,500	228,800.00	0.10
295	601918	新集能源	42,500	223,975.00	0.10
296	000028	国药一致	7,700	223,223.00	0.10
297	002918	蒙娜丽莎	16,300	220,702.00	0.09
298	300406	九强生物	11,500	219,650.00	0.09
299	603171	税友股份	6,200	219,356.00	0.09
300	000928	中钢国际	37,600	219,208.00	0.09
301	002626	金达威	13,400	218,822.00	0.09
302	002645	华宏科技	19,300	218,090.00	0.09
303	601888	中国中免	2,600	217,594.00	0.09
304	601801	皖新传媒	31,200	216,840.00	0.09
305	002078	太阳纸业	17,800	216,626.00	0.09
306	688018	乐鑫科技	2,100	216,195.00	0.09
307	600643	爱建集团	41,900	213,690.00	0.09
308	300860	锋尚文化	3,900	213,057.00	0.09
309	300768	迪普科技	14,400	212,832.00	0.09
310	688508	芯朋微	4,300	211,603.00	0.09
311	603229	奥翔药业	16,000	211,360.00	0.09
312	600691	阳煤化工	65,600	210,576.00	0.09
313	603416	信捷电气	5,600	210,336.00	0.09
314	300900	广联航空	8,500	209,780.00	0.09

315	600976	健民集团	3,200	208,800.00	0.09
316	002913	奥士康	6,800	208,420.00	0.09
317	002481	双塔食品	46,700	205,947.00	0.09
318	002641	公元股份	40,900	205,727.00	0.09
319	603520	司太立	14,600	205,568.00	0.09
320	603429	集友股份	24,600	204,672.00	0.09
321	603995	甬金股份	10,600	203,838.00	0.09
322	002978	安宁股份	6,400	202,624.00	0.09
323	601058	赛轮轮胎	17,000	199,750.00	0.09
324	600025	华能水电	23,100	199,353.00	0.09
325	601233	桐昆股份	13,000	196,690.00	0.08
326	002695	煌上煌	18,700	195,789.00	0.08
327	600535	天士力	11,300	192,326.00	0.08
328	603333	尚纬股份	33,100	189,001.00	0.08
329	601699	潞安环能	8,600	188,426.00	0.08
330	300017	网宿科技	23,800	186,830.00	0.08
331	600481	双良节能	22,000	186,120.00	0.08
332	002138	顺络电子	6,800	183,668.00	0.08
333	300219	鸿利智汇	21,200	178,504.00	0.08
334	601996	丰林集团	62,200	177,270.00	0.08
335	002600	领益智造	26,000	175,760.00	0.08
336	300043	星辉娱乐	46,800	173,628.00	0.07
337	301026	浩通科技	5,700	173,565.00	0.07
338	300440	运达科技	23,200	172,840.00	0.07
339	600132	重庆啤酒	2,600	172,770.00	0.07
340	603303	得邦照明	13,400	172,190.00	0.07
341	300994	久祺股份	11,700	171,990.00	0.07
342	002774	快意电梯	20,700	171,810.00	0.07
343	600727	鲁北化工	26,100	171,738.00	0.07
344	000533	顺钠股份	36,600	171,654.00	0.07
345	300681	英搏尔	8,900	171,503.00	0.07
346	300412	迦南科技	30,100	171,269.00	0.07
347	300286	安科瑞	6,600	171,138.00	0.07
348	301138	华研精机	5,900	171,100.00	0.07
349	688398	赛特新材	5,400	170,640.00	0.07
350	603681	永冠新材	11,300	170,630.00	0.07
351	300882	万胜智能	7,000	170,520.00	0.07
352	600644	乐山电力	24,500	170,520.00	0.07
353	300272	开能健康	27,500	170,500.00	0.07
354	300092	科新机电	12,800	170,496.00	0.07
355	002225	濮耐股份	45,100	170,478.00	0.07
356	002452	长高电新	24,000	170,400.00	0.07
357	300441	鲍斯股份	24,700	170,183.00	0.07

358	002565	顺灏股份	50,200	170,178.00	0.07
359	300577	开润股份	11,600	170,172.00	0.07
360	003002	壶化股份	11,200	170,128.00	0.07
361	603112	华翔股份	14,000	170,100.00	0.07
362	688089	嘉必优	9,500	170,050.00	0.07
363	002980	华盛昌	6,200	169,880.00	0.07
364	002969	嘉美包装	41,200	169,744.00	0.07
365	600469	风神股份	27,500	169,675.00	0.07
366	002662	京威股份	48,300	169,533.00	0.07
367	301149	隆华新材	13,700	169,469.00	0.07
368	300452	山河药辅	11,900	169,456.00	0.07
369	002392	北京利尔	44,800	169,344.00	0.07
370	300491	通合科技	7,600	169,328.00	0.07
371	605162	新中港	18,400	169,096.00	0.07
372	688329	艾隆科技	6,800	169,048.00	0.07
373	002094	青岛金王	44,600	169,034.00	0.07
374	300111	向日葵	55,600	169,024.00	0.07
375	300922	天秦装备	9,900	168,993.00	0.07
376	000920	沃顿科技	17,000	168,810.00	0.07
377	300905	宝丽迪	8,700	168,606.00	0.07
378	603515	欧普照明	9,700	168,586.00	0.07
379	000850	华茂股份	44,200	168,402.00	0.07
380	300866	安克创新	1,900	168,340.00	0.07
381	000949	新乡化纤	52,000	167,960.00	0.07
382	000838	财信发展	45,700	167,719.00	0.07
383	600512	腾达建设	67,500	167,400.00	0.07
384	601958	金钼股份	17,700	167,265.00	0.07
385	603848	好太太	10,800	167,184.00	0.07
386	002798	帝欧家居	25,500	167,025.00	0.07
387	603885	吉祥航空	13,900	166,800.00	0.07
388	002016	世荣兆业	26,500	166,685.00	0.07
389	600529	山东药玻	6,500	166,400.00	0.07
390	603992	松霖科技	9,100	165,074.00	0.07
391	603556	海兴电力	5,400	156,762.00	0.07
392	300109	新开源	8,500	153,340.00	0.07
393	600502	安徽建工	32,700	152,055.00	0.07
394	002895	川恒股份	8,000	152,000.00	0.07
395	001338	永顺泰	12,500	150,750.00	0.06
396	000915	华特达因	5,200	150,592.00	0.06
397	002245	蔚蓝锂芯	17,200	146,544.00	0.06
398	600760	中航沈飞	3,300	139,194.00	0.06
399	601991	大唐发电	57,400	138,908.00	0.06
400	000883	湖北能源	32,100	135,783.00	0.06

401	002274	华昌化工	17,400	131,370.00	0.06
402	000959	首钢股份	36,200	125,252.00	0.05
403	001914	招商积余	10,400	124,384.00	0.05
404	600850	电科数字	5,100	110,925.00	0.05
405	600595	中孚实业	31,600	109,968.00	0.05
406	002028	思源电气	2,100	109,284.00	0.05
407	000301	东方盛虹	11,300	108,480.00	0.05
408	600507	方大特钢	23,400	107,874.00	0.05
409	600409	三友化工	19,600	107,604.00	0.05
410	600011	华能国际	13,900	107,030.00	0.05
411	603466	风语筑	7,400	106,412.00	0.05
412	301015	百洋医药	2,900	103,994.00	0.04
413	603658	安图生物	1,800	102,618.00	0.04
414	300761	立华股份	4,800	100,656.00	0.04
415	301301	川宁生物	11,800	99,120.00	0.04
416	603013	亚普股份	5,700	98,496.00	0.04
417	600621	华鑫股份	7,000	98,490.00	0.04
418	002987	京北方	5,300	98,474.00	0.04
419	601966	玲珑轮胎	5,100	98,073.00	0.04
420	002048	宁波华翔	7,500	97,575.00	0.04
421	600372	中航机载	7,400	97,532.00	0.04
422	301207	华兰疫苗	3,500	97,300.00	0.04
423	002791	坚朗五金	2,400	97,176.00	0.04
424	003031	中瓷电子	1,100	97,053.00	0.04
425	300770	新媒股份	2,500	96,700.00	0.04
426	600612	老凤祥	1,400	96,600.00	0.04
427	300776	帝尔激光	1,600	96,416.00	0.04
428	603057	紫燕食品	4,400	94,952.00	0.04
429	300037	新宙邦	2,000	94,600.00	0.04
430	002866	传艺科技	4,300	91,246.00	0.04
431	000932	华菱钢铁	17,500	90,125.00	0.04
432	603568	伟明环保	5,600	89,600.00	0.04
433	300144	宋城演艺	9,000	88,830.00	0.04
434	002739	万达电影	6,700	87,234.00	0.04
435	600993	马应龙	3,600	87,048.00	0.04
436	300285	国瓷材料	3,700	85,544.00	0.04
437	600060	海信视像	4,000	83,600.00	0.04
438	002152	广电运通	6,600	80,916.00	0.03
439	600398	海澜之家	10,300	76,426.00	0.03
440	002568	百润股份	3,100	76,291.00	0.03
441	002170	芭田股份	13,600	75,480.00	0.03
442	300009	安科生物	7,300	74,606.00	0.03
443	600282	南钢股份	19,800	73,260.00	0.03

444	600580	卧龙电驱	6,200	72,726.00	0.03
445	601231	环旭电子	4,800	72,528.00	0.03
446	601636	旗滨集团	10,600	72,504.00	0.03
447	000598	兴蓉环境	12,600	71,694.00	0.03
448	603737	三棵树	1,500	71,415.00	0.03
449	601000	唐山港	20,400	71,400.00	0.03
450	600707	彩虹股份	10,500	70,875.00	0.03
451	600582	天地科技	12,800	69,632.00	0.03
452	000825	太钢不锈	18,400	68,632.00	0.03
453	600517	国网英大	14,100	67,257.00	0.03
454	600500	中化国际	15,200	67,184.00	0.03
455	603650	彤程新材	2,000	66,600.00	0.03
456	600827	百联股份	7,000	66,430.00	0.03
457	000967	盈峰环境	13,500	64,125.00	0.03
458	603866	桃李面包	8,300	63,578.00	0.03
459	600377	宁沪高速	6,100	62,525.00	0.03
460	002608	江苏国信	9,500	62,415.00	0.03
461	603056	德邦股份	4,300	62,221.00	0.03
462	601139	深圳燃气	8,800	60,632.00	0.03
463	688368	晶丰明源	560	60,446.40	0.03
464	002733	雄韬股份	4,000	60,160.00	0.03
465	600217	中再资环	13,700	60,006.00	0.03
466	001872	招商港口	3,700	59,052.00	0.03
467	000963	华东医药	1,400	58,044.00	0.02
468	002832	比音勒芬	1,800	57,060.00	0.02
469	002351	漫步者	3,200	56,544.00	0.02
470	002745	木林森	6,500	56,290.00	0.02
471	300596	利安隆	1,900	56,164.00	0.02
472	002768	国恩股份	2,600	55,692.00	0.02
473	605009	豪悦护理	1,449	55,308.33	0.02
474	603871	嘉友国际	3,480	55,192.80	0.02
475	002534	西子洁能	4,400	54,956.00	0.02
476	603733	仙鹤股份	3,400	54,876.00	0.02
477	600169	太原重工	23,200	54,752.00	0.02
478	002643	万润股份	3,300	54,747.00	0.02
479	000682	东方电子	6,800	54,740.00	0.02
480	600876	凯盛新能	3,900	54,717.00	0.02
481	601600	中国铝业	9,700	54,708.00	0.02
482	603098	森特股份	4,000	54,440.00	0.02
483	300855	图南股份	1,800	54,360.00	0.02
484	600861	北京人力	2,900	54,346.00	0.02
485	601718	际华集团	19,100	54,244.00	0.02
486	600510	黑牡丹	9,600	54,240.00	0.02

487	002701	奥瑞金	13,100	54,234.00	0.02
488	002746	仙坛股份	7,700	54,208.00	0.02
489	002249	大洋电机	10,900	54,173.00	0.02
490	600667	太极实业	7,700	54,131.00	0.02
491	603170	宝立食品	3,200	54,112.00	0.02
492	300119	瑞普生物	3,300	54,087.00	0.02
493	300919	中伟股份	1,100	54,043.00	0.02
494	002091	江苏国泰	6,900	54,027.00	0.02
495	605222	起帆电缆	2,800	53,984.00	0.02
496	601333	广深铁路	20,800	53,872.00	0.02
497	600754	锦江酒店	1,800	53,820.00	0.02
498	300999	金龙鱼	1,600	53,408.00	0.02
499	002242	九阳股份	4,200	53,382.00	0.02
500	300755	华致酒行	2,900	53,041.00	0.02
501	300470	中密控股	1,400	52,920.00	0.02
502	600675	中华企业	16,500	51,975.00	0.02
503	002920	德赛西威	400	51,804.00	0.02
504	000960	锡业股份	3,600	51,552.00	0.02
505	300502	新易盛	820	40,442.40	0.02
506	300737	科顺股份	6,000	36,840.00	0.02
507	001979	招商蛇口	2,200	20,966.00	0.01
508	688348	昱能科技	140	17,133.20	0.01
509	301348	蓝箭电子	335	14,930.95	0.01
510	688390	固德威	100	13,058.00	0.01
511	300904	威力传动	180	11,075.40	0.00
512	301510	固高科技	252	8,822.52	0.00
513	688702	盛科通信	157	7,564.26	0.00
514	688185	康希诺	100	7,452.00	0.00
515	301202	朗威股份	225	7,155.00	0.00
516	301499	维科精密	243	7,029.99	0.00
517	688153	唯捷创芯	100	6,550.00	0.00
518	688716	中研股份	178	6,477.42	0.00
519	601096	宏盛华源	1,575	6,394.50	0.00
520	688099	晶晨股份	100	6,263.00	0.00
521	002179	中航光电	160	6,240.00	0.00
522	002422	科伦药业	200	5,810.00	0.00
523	688651	盛邦安全	116	5,341.80	0.00
524	688002	睿创微纳	100	4,422.00	0.00
525	301555	惠柏新材	132	4,282.08	0.00
526	688648	中邮科技	192	4,114.56	0.00
527	688386	泛亚微透	100	4,080.00	0.00
528	688005	容百科技	100	3,980.00	0.00
529	688450	光格科技	105	3,824.10	0.00

530	603119	浙江荣泰	124	2,959.88	0.00
531	688690	纳微科技	100	2,742.00	0.00
532	603107	上海汽配	147	2,673.93	0.00
533	688381	帝奥微	100	2,532.00	0.00
534	001306	夏厦精密	33	2,486.88	0.00
535	603276	恒兴新材	94	2,338.72	0.00
536	301063	海锅股份	100	2,280.00	0.00
537	301293	三博脑科	36	2,247.12	0.00
538	301358	湖南裕能	38	1,290.10	0.00

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

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	002179	中航光电	8,716,173.24	2.80
2	601319	中国人保	8,420,189.00	2.71
3	600398	海澜之家	7,942,577.00	2.55
4	002929	润建股份	7,904,627.45	2.54
5	601857	中国石油	7,632,316.00	2.45
6	601998	中信银行	7,423,592.20	2.39
7	601298	青岛港	7,178,949.00	2.31
8	601601	中国太保	6,642,382.00	2.14
9	688036	传音控股	6,538,494.40	2.10
10	601088	中国神华	6,532,738.00	2.10
11	600566	济川药业	6,433,921.00	2.07
12	601328	交通银行	6,355,929.00	2.04
13	300130	新国都	6,186,956.94	1.99
14	601717	郑煤机	5,925,590.00	1.90
15	300532	今天国际	5,782,495.06	1.86
16	600546	山煤国际	5,656,320.00	1.82
17	300783	三只松鼠	5,617,265.00	1.81
18	601318	中国平安	5,555,693.00	1.79
19	600761	安徽合力	5,358,160.67	1.72
20	601168	西部矿业	5,093,660.00	1.64

8.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002179	中航光电	8,879,212.10	2.85
2	601319	中国人保	8,719,977.00	2.80
3	600398	海澜之家	8,464,133.60	2.72

4	002929	润建股份	7,944,243.00	2.55
5	601328	交通银行	7,874,997.78	2.53
6	601998	中信银行	7,565,586.00	2.43
7	601088	中国神华	7,407,392.00	2.38
8	601298	青岛港	7,167,609.00	2.30
9	601857	中国石油	7,013,848.00	2.25
10	601601	中国太保	6,878,794.00	2.21
11	300130	新国都	6,874,210.81	2.21
12	600566	济川药业	6,515,045.00	2.09
13	600546	山煤国际	6,352,067.00	2.04
14	601318	中国平安	6,182,963.00	1.99
15	688036	传音控股	6,116,316.05	1.97
16	601717	郑煤机	5,941,044.00	1.91
17	300783	三只松鼠	5,624,847.00	1.81
18	300532	今天国际	5,429,412.00	1.75
19	601166	兴业银行	5,341,786.41	1.72
20	600761	安徽合力	5,315,985.20	1.71

8.4.3 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	2,061,347,881.51
卖出股票收入（成交）总额	2,098,518,708.54

8.5 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	4,020,931.51	1.72
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,130,327.87	4.34
	其中：政策性金融债	10,130,327.87	4.34
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	34,378,127.74	14.74
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	48,529,387.12	20.81

8.6 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	092218003	22农发清发03	100,000	10,130,327.87	4.34
2	019709	23国债16	40,000	4,020,931.51	1.72
3	128130	景兴转债	23,810	2,789,826.83	1.20

4	113530	大丰转债	16,800	2,184,407.34	0.94
5	113532	海环转债	17,680	2,106,235.84	0.90

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本集合计划使用股指期货对冲组合的系统性风险，从而分离出组合的超额收益。根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货对冲。综合考虑股指期货不同合约之间的价差关系、套利机会、流动性等因素，在各股指期货合约之间进行动态配置和临近到期合约的展期操作，以提升组合收益和套期保值的效果。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本集合计划合同，本集合计划投资范围不包括国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

根据本集合计划合同，本集合计划投资范围不包括国债期货。

8.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 154,817,897.28 元，占基金资产净值的比例为 66.40%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-139,057,860.00 元，占基金资产净值的比例为-59.64%，空头合约市值占股票资产的比例为-89.82%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 12,909,072.40 元，公允价值变动损益为 1,990,164.77 元。

8.13 投资组合报告附注

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

本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。

8.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本集合计划投资的前十名股票未有超出集合计划合同规定的备选股票库。

8.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	16,854,314.13
2	应收清算款	229,604.88
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,083,919.01

8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	128130	景兴转债	2,789,826.83	1.20
2	113530	大丰转债	2,184,407.34	0.94
3	113532	海环转债	2,106,235.84	0.90
4	113651	松霖转债	2,069,920.70	0.89
5	110045	海澜转债	2,040,759.69	0.88
6	118025	奕瑞转债	1,473,741.60	0.63
7	113627	太平转债	1,399,719.09	0.60
8	118003	华兴转债	1,393,921.37	0.60
9	110092	三房转债	1,385,949.27	0.59
10	113584	家悦转债	1,372,558.67	0.59
11	123101	拓斯转债	1,363,659.88	0.58
12	127014	北方转债	1,362,840.69	0.58
13	113061	拓普转债	1,354,028.34	0.58
14	127005	长证转债	1,353,328.04	0.58
15	110083	苏租转债	1,351,296.17	0.58
16	110088	淮22转债	1,348,590.76	0.58
17	113633	科沃转债	1,132,763.70	0.49
18	128048	张行转债	1,049,502.93	0.45
19	132026	G三峡EB2	800,218.33	0.34
20	127054	双箭转债	722,024.98	0.31
21	113549	白电转债	718,230.92	0.31
22	123035	利德转债	716,778.58	0.31
23	111002	特纸转债	715,677.10	0.31
24	113545	金能转债	708,641.91	0.30
25	113563	柳药转债	708,497.92	0.30
26	128133	奇正转债	700,807.21	0.30
27	127025	冀东转债	54,199.88	0.02

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	15	153,725.97	-	-	2,305,889.56	100.00
光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	200	179,587.21	28,146,931.88	78.37	7,770,509.53	21.63
光大阳光对冲 6 个月持有混合 C	24,623	7,558.01	-	-	186,100,891.63	100.00
合计	24,838	9,031.49	28,146,931.88	12.55	196,177,290.72	87.45

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）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	46,501.00	2.0166
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	76,895.98	0.2141
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C	1,005.80	0.0005
	合计	124,402.78	0.0555

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）。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	0
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	0~10
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	0
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	0
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C	0
	合计	0

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

本集合计划投资经理本报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C
基金合同生效日（2020 年 3 月 25 日）基金份额总额	38,874,579.27	-	-
本报告期期初基金份额总额	2,615,678.28	37,128,843.54	266,975,830.96
本报告期基金总申购份额	-	260,643.98	1,449,033.13
减：本报告期基金总赎回份额	309,788.72	1,472,046.11	82,323,972.46
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	2,305,889.56	35,917,441.41	186,100,891.63

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

本报告期内本集合计划管理人无重大人事变动。

2023 年 7 月 26 日，本基金托管人广发银行股份有限公司蒋柯先生因工作需要不再担任资产托管部总经理，任命田卫来先生为资产托管部副总经理，临时负责部门工作。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内集合计划审计机构由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）改聘为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。本基金本年度支付给审计机构普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 31,000.00 元人民币，该会计师事务所自 2023 年为本集合计划提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
光大证券	2	4,157,666,34	100.00	1,399,452.58	100.00	-

		4.45			
--	--	------	--	--	--

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。

11.7.2 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	1,178,368,612.23	100.00	1,407,240,000.00	100.00	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划 2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定的媒介	2023 年 01 月 20 日
2	关于光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划延长产品存续期限并修改资产管理合同、招募说明书的公告	中国证监会规定的媒介	2023 年 03 月 09 日
3	光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划基金经理变更公告	中国证监会规定的媒介	2023 年 03 月 17 日
4	上海光大证券资产管理有限公司管理聘任投资经理助理的公告	中国证监会规定的媒介	2023 年 03 月 27 日
5	光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划 2022 年年度报告	中国证监会规定的媒介	2023 年 03 月 31 日
6	光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划 2023	中国证监会规定的媒介	2023 年 04 月 23 日

	年第 1 季度报告		
7	关于上海光大证券资产管理有限公司旗下部分产品估值调整的公告	中国证监会规定的媒介	2023 年 06 月 19 日
8	光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划 2023 年中期报告	中国证监会规定的媒介	2023 年 08 月 31 日
9	光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划 2023 年第 3 季度报告	中国证监会规定的媒介	2023 年 10 月 25 日
10	关于光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划延长产品存续期限并修改资产管理合同、招募说明书的公告	中国证监会规定的媒介	2023 年 12 月 22 日
11	关于光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划暂停申购、转换转入、定期定额投资公告	中国证监会规定的媒介	2023 年 12 月 22 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中国证监会关于同意光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划合同变更的函；

2、《光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》；

3、《光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划托管协议》；

4、《光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书》；

5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；

6、集合计划管理人业务资格批件、营业执照；

7、中国证监会要求的其他文件。

13.2 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。

13.3 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3月29日