

光大阳光生活 18 个月持有期混合型集合资产管理计划
清算报告

集合计划管理人：上海光大证券资产管理有限公司

集合计划托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年五月七日

报告公告日期：二〇二四年五月九日

目录

一、重要提示	3
二、集合计划概况	3
三、财务会计报告	5
四、清算情况	6
五、备查文件	9

一、重要提示

光大阳光生活 18 个月持有期混合型集合资产管理计划由光大阳光新兴产业(阳光 8 号)集合资产管理计划转型变更而来。本集合计划的管理人上海光大证券股份有限公司于 2021 年 4 月 1 日发布《光大阳光新兴产业(阳光 8 号)集合资产管理计划合同变更公告》。根据公告,光大阳光新兴产业(阳光 8 号)集合资产管理计划产品名称变更为“光大阳光生活 18 个月持有期混合型集合资产管理计划”,光大阳光新兴产业(阳光 8 号)集合资产管理计划份额变更为光大阳光生活 18 个月持有期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 2021 年 5 月 6 日起《光大阳光生活 18 个月持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》、《光大阳光生活 18 个月持有期混合型集合资产管理计划托管协议》生效。本集合计划自资产管理合同变更生效之日起存续期不得超过 3 年。本集合计划管理人为上海光大证券资产管理有限公司,托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《光大阳光生活 18 个月持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》的有关规定,光大阳光生活 18 个月持有期混合型集合资产管理计划由于存续期届满,上海光大证券资产管理有限公司依据法律法规的规定及集合计划合同的约定履行财产清算程序并终止资产管理合同,此事项无需召开集合计划份额持有人大会。本集合计划的最后运作日定为 2024 年 5 月 5 日。

本集合计划于 2024 年 5 月 6 日起进入清算期,由本集合计划管理人上海光大证券资产管理有限公司、本集合计划托管人中国工商银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所于 2024 年 5 月 6 日组成本集合计划财产清算小组履行集合计划财产清算程序,并由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对清算报告进行审计,上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、集合计划概况

集合计划名称	光大阳光生活 18 个月持有期混合型集合资产管理计划
集合计划简称	光大阳光生活 18 个月持有混合
集合计划主代码	860008
集合计划运作方式	契约型开放式
集合计划合同生效日	2021 年 5 月 6 日
集合计划管理人	上海光大证券资产管理有限公司
集合计划托管人	中国工商银行股份有限公司

<p>最后运作日 (2024年5月5日) 集合计划份额总额</p>	<p>101,970,229.87份</p>
<p>投资目标</p>	<p>通过深度研究,捕捉宏观环境及政策趋势走向,主要投资于生活主题相关行业的证券,把握经济转型升级过程中的投资机会。在严格控制风险的前提下,追求集合计划资产的长期稳定增值。</p>
<p>投资策略</p>	<p>(一) 资产配置策略 本集合计划通过定性与定量研究相结合的方法,确定投资组合中权益类资产和固定收益类资产的配置比例。</p> <p>(二) 权益类品种的投资策略</p> <p>1、生活主题的范畴 本集合计划界定的生活主题相关公司指在经济结构转型、居民可支配收入增加、人民生活水准和各项需求不断提升的背景下,通过提供产品或服务不断满足且提升民众生活品质的消费行业,前述各项需求既包括衣食住行等物质生活需求,也包括教育、文化、娱乐、旅游等精神生活需求。本集合计划将在生活主题的定义内选择符合时代发展趋势、推动经济转型升级的行业公司,以及向上述行业提供产品和服务的上下游公司进行组合构建。</p> <p>细化到行业分类上,本集合计划投资的行业包括但不限于食品饮料、家用电器、纺织服装、农林牧渔、轻工制造、交通运输、汽车与汽车零配件、医药生物、休闲服务、传媒、计算机、电子、通信、商业贸易、金融、消费品制造、消费者服务等。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 个股选择策略 本集合计划在拟配置的行业内部通过定量与定性相结合的分析方法选筛选个股。</p> <p>(2) 港股通股票投资策略 本集合计划将关注在港股市场上市、具有行业代表性、A股市场稀缺性和核心竞争力的优质公司,关注港股市场在行业结构、估值、AH股折溢价、股息率等方面具有吸引力的投资标的。</p> <p>(三) 固定收益类品种投资策略 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</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	中证主要消费指数收益率×15%+中证可选消费指数收益率×15%+中证医药卫生指数收益率×30%+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%
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>

三、财务会计报告

集合计划最后运作日资产负债表（经审计）

会计主体：光大阳光生活 18 个月持有混合

报告截止日：2024 年 5 月 5 日（集合计划最后运作日）

单位：人民币元

资产	2024 年 5 月 5 日(集合计划最后运作日)
资产：	
银行存款	27,626,476.82
结算备付金	4,055,519.57
存出保证金	47,103.22
交易性金融资产	13,540,512.00
其中：股票投资	13,540,512.00
其他应收款	955.95
应收清算款	9,068,425.19
资产总计	54,338,992.75
负债和所有者权益	
负债：	
应付赎回款	11,052,353.87
应付管理人报酬	48,101.19
应付托管费	12,641.02
应付销售服务费	2,879.76

其他负债	92,297.79
负债合计	11,208,273.63
所有者权益：	
实收基金	101,970,229.87
未分配利润	-58,839,510.75
所有者权益合计	43,130,719.12
负债和所有者权益总计	54,338,992.75

注：报告截止日 2024 年 5 月 5 日(集合计划最后运作日)，集合计划份额总额 101,970,229.87 份，其中光大阳光生活 18 个月持有 A 集合计划份额净值(暂估业绩报酬前) 0.6078 元，集合计划份额总额 24,032,513.44 份，集合计划资产净值(暂估业绩报酬前) 14,605,941.64 元，暂估业绩报酬金额 0.00 元，集合计划资产净值(暂估业绩报酬后) 14,605,941.64 元；光大阳光生活 18 个月持有 B 集合计划份额净值(暂估业绩报酬前) 0.3669 元，集合计划份额总额 61,471,030.17 份，集合计划资产净值(暂估业绩报酬前) 22,553,687.25 元，暂估业绩报酬金额 73,897.65 元，集合计划资产净值(暂估业绩报酬后) 22,479,789.60 元；光大阳光生活 18 个月持有 C 集合计划份额净值(暂估业绩报酬前) 0.3626 元，集合计划份额总额 16,466,686.26 份，集合计划资产净值(暂估业绩报酬前) 5,971,090.23 元，暂估业绩报酬金额 458.71 元，集合计划资产净值(暂估业绩报酬后) 5,970,631.52 元。

该暂估业绩报酬余额是各资产管理计划持有人于期末时点的暂估业绩报酬的合计，各资产管理计划委托人实际应承担的业绩报酬金额根据其持有期间的实际收益情况计算确认，可能与上述暂估业绩报酬金额存在差异。

四、清算情况

清算期为 2024 年 5 月 6 日当日，集合计划财产清算小组对本集合计划的资产、负债进行清算，具体清算情况如下：

1、清算费用

按照《光大阳光生活 18 个月持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》第二十部分“合同的变更、终止与集合计划财产的清算”的规定，清算费用是指集合计划财产清算小组在进行集合计划清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由集合计划财产清算小组优先从集合计划财产中支付。

2、资产处置情况

(1) 本集合计划最后运作日的银行存款余额为人民币 27,626,476.82 元(含银行存款

应收利息人民币 5,210.91 元)，该部分款项由托管人负责保管；

(2) 本集合计划最后运作日的结算备付金余额为人民币 4,055,519.57 元（含结算备付金应收利息人民币 1,447.66 元），款项由中国证券登记结算有限责任公司上海、深圳分公司收取并保管。除深股通清算备付金人民币 3,948,026.96 元将于 2024 年 5 月 8 日回款至托管户外，其他款项待实际划付清算款时，由管理人上海光大证券资产管理有限公司以自有资金先行垫付，供清盘分配使用，待回款后再返还给管理人；

(3) 本集合计划最后运作日的存出保证金余额为人民币 47,103.22 元（含存出保证金应收利息人民币 25.34 元），该款项由中国证券登记结算有限责任公司上海、深圳分公司收取并保管。待实际划付清算款时，由管理人上海光大证券资产管理有限公司以自有资金先行垫付，供清盘分配使用，待回款后再返还给管理人；

(4) 本集合计划最后运作日持有的交易性金融资产全部为股票投资，股票市值为人民币 13,540,512.00 元，该金额为各只股票的最后运作日估值金额之和。股票投资于 2024 年 5 月 6 日，全部变现。

本集合计划最后运作日（2024 年 5 月 5 日）持有的全部股票明细如下：

股票代码	股票名称	数量	市值
600258 SH	首旅酒店	61,900.00	949,546.00
600276 SH	恒瑞医药	17,400.00	803,184.00
600519 SH	贵州茅台	400.00	682,000.00
600754 SH	锦江酒店	27,000.00	780,570.00
600887 SH	伊利股份	28,100.00	803,941.00
603043 SH	广州酒家	44,300.00	810,690.00
603233 SH	大参林	41,900.00	912,582.00
603368 SH	柳药集团	40,300.00	918,437.00
603517 SH	绝味食品	40,100.00	814,431.00
603883 SH	老百姓	25,900.00	866,873.00
000030 SZ	富奥股份	157,000.00	898,040.00
000538 SZ	云南白药	15,300.00	875,925.00
000858 SZ	五粮液	7,600.00	1,143,268.00
000951 SZ	中国重汽	50,100.00	819,135.00
002938 SZ	鹏鼎控股	32,800.00	791,792.00
300760 SZ	迈瑞医疗	2,200.00	670,098.00

(5) 本集合计划最后运作日的其他应收款余额为人民币 955.95 元，为应收申购款利息，款项已于 2024 年 5 月 6 日回款至托管户。

(6) 本集合计划最后运作日的应收证券清算款为人民币 9,068,425.19 元，款项将于 2024 年 5 月 7 日回款至托管户。

3、负债清偿情况

(1) 本集合计划最后运作日应付赎回款为人民币 11,052,353.87 元, 该款项将于 2024 年 5 月 7 日支付。

(1) 本集合计划最后运作日应付管理人报酬为人民币 48,101.19 元, 该款项将于实际支付时扣除。

(2) 本集合计划最后运作日应付托管费为人民币 12,641.02 元, 该款项将于实际支付时扣除。

(3) 本集合计划最后运作日应付销售服务费为人民币 2,879.76 元, 该款项将于实际支付时扣除。

(4) 本集合计划最后运作日其他负债为人民币 92,297.79 元, 包括应付交易费用、预提审计费和预提信息披露费等。本集合计划最后运作日应付交易费用为人民币 49,756.71 元, 该款项将于实际支付时扣除。本集合计划最后运作日预提审计费为人民币 25,328.22 元, 该款项在清盘期间有调整, 最终确定审计费为人民币 22,500.00 元 (其中 2023 年年审审计费 15,000.00 元, 产品清盘审计费 7,500 元。), 该款项将于实际支付时扣除; 本集合计划最后运作日预提信息披露费为人民币 17,212.86 元, 该款项将于实际支付时扣除。

4、清算期间的剩余资产分配情况

单位: 人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2024 年 5 月 5 日集合计划净资产	43,130,719.12
加: 清算期间 (2024 年 5 月 6 日) 收入	260,770.72
股票变现收入	260,205.62
利息收入-银行存款利息收入 (注 1)	306.40
利息收入-结算备付金利息收入 (注 2)	258.11
利息收入-存出保证金利息收入 (注 3)	0.59
减: 清算期间 (2024 年 5 月 6 日) 赎回款和费用	4,598,358.90
应付赎回款 (注 5)	4,591,187.12
律师费 (注 6)	10,000.00
审计费 (注 7)	-2,828.22
二、2024 年 5 月 6 日集合计划净资产	38,793,130.94

注：（1）利息收入暂以当前适用的利率预估计提 2024 年 5 月 6 号（假定清算款划付日期为 2024 年 5 月 7 日）的银行存款利息，若清算款实际划付日期变更，该金额也将相应调整。

（2）利息收入暂以当前适用的利率预估计提 2024 年 5 月 6 号（假定清算款划付日期为 2024 年 5 月 7 日）的结算备付金利息，若清算款实际划付日期变更，该金额也将相应调整。

（3）利息收入暂以当前适用的利率预估计提 2024 年 5 月 6 号（假定清算款划付日期为 2024 年 5 月 7 日）的存出保证金利息，若清算款实际划付日期变更，该金额也将相应调整。

（4）本集合计划最后运作日为 2024 年 5 月 5 日，2024 年 5 月 6 日当天为清算期，以上清算期资产状况包含 2024 年 5 月 6 日当天的利息收入。

（5）应付赎回款为持有人于 4 月 30 日提出的赎回申请产生的应付赎回款，该笔款项将于 2024 年 5 月 8 日支付。

（6）律师费为本集合清盘出具法律意见书的律师费，该款项将于实际支付时扣除。

（7）审计费为本集合计划最后运作日预提 2024 年年度审计费与清盘期间确定的清盘审计费之间，进行的差额调整。

资产处置及负债清偿后，于 2024 年 5 月 6 日本集合计划剩余财产为人民币 38,793,130.94 元，根据本集合计划的《资产管理合同》约定，依据本集合计划财产清算的分配方案，按本集合计划份额持有人持有的集合计划份额比例进行分配。

2024 年 5 月 6 日至清算款实际划出日前一日的银行存款、结算备付金、存出保证金等产生的利息属份额持有人所有。为保护集合计划份额持有人利益，加快清盘速度，管理人上海光大证券资产管理有限公司将以自有资金先行垫付该笔款项（该金额可能与实际结息金额存在略微差异），供清盘分配使用。待结息日回款后再返还管理人。

5、财产清算报告的告知安排

本清算报告已经托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向本集合计划份额持有人公告。

五、备查文件

1、备查文件目录

（1）《光大阳光生活 18 个月持有期混合型集合资产管理计划 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 5 月 5 日（集合计划最后运作日）止期间的财务报表及审计报告》

(2) 关于《光大阳光生活 18 个月持有期混合型集合资产管理计划》的法律意见

2、存放地点

管理人的办公场所。

3、查阅方式

持有人可在营业时间内至管理人的办公场所免费查阅。

集合计划管理人：上海光大证券资产管理有限公司

集合计划托管人：中国工商银行股份有限公司

2024 年 5 月 7 日