

光大阳光稳债收益 12 个月持有期债券型集  
合资产管理计划  
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：上海光大证券资产管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

集合计划管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本报告已经三分之二以上董事签字同意，并由董事长签发。

集合计划托管人中国光大银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	39
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	39

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	39
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	39
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	39
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	39
7.11 投资组合报告附注 .....	40
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>41</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	41
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>42</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>42</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	42
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	42
10.4 基金投资策略的改变 .....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	43
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	43
10.8 其他重大事件 .....	44
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>44</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	44
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	44
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>44</b>
12.1 备查文件目录 .....	44
12.2 存放地点 .....	44
12.3 查阅方式 .....	45

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	光大阳光稳债收益 12 个月持有期债券型集合资产管理计划	
基金简称	光大阳光稳债收益 12 个月持有债券	
基金主代码	860012	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 8 月 17 日	
基金管理人	上海光大证券资产管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	452,618,363.85 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	光大阳光稳债收益 12 个月持有债券 A	光大阳光稳债收益 12 个月持有债券 C
下属分级基金的交易代码	860012	860033
报告期末下属分级基金的份额总额	371,960,814.62 份	80,657,549.23 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>1、资产配置策略</p> <p>本集合计划采用专业的投资理念和分析方法，以系统化的研究为基础，通过对各类固定收益类资产的合理配置获取稳定收益。</p> <p>本集合计划主要根据不同类别资产的收益率水平、流动性指标、市场偏好、收益目标等决定不同类别资产的目标配置比率。管理人在充分考虑各类资产的收益率、流动性、规模及风险的基础上，优先选择资产规模大、赎回到账速度快、收益率较高的资产。通过建立资产池，灵活调整投资组合中的投资品种及投资比例，在保证投资组合流动性的基础上，实现投资增值。</p> <p>2、固定收益类投资策略</p> <p>本集合计划将通过分析宏观经济形势、政策预期和资金供给，并结合债券久期策略和收益率曲线结构的变化趋势来构建债券投资组合，把握利率债行情。在此基础上，积极采用信用策略，发掘市场上价值被低估的高收益信用债，获取较好的信用收益，力争达到产品债券组合安全性与收益性的统一。</p> <p>3、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、</p>

	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。 4、国债期货投资策略 本集合计划对国债期货的投资以套期保值为主要目的，结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，获取超额收益。
业绩比较基准	中债综合指数收益率*95%+1 年期定期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本集合计划为债券型集合计划，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于混合型基金、混合型集合计划、股票型基金和股票型集合计划。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海光大证券资产管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	朱轶	石立平
	联系电话	021-32068300	010-63639180
	电子邮箱	zhuyil@ebscn.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		95525	95595
传真		021-32068585	010-63639132
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码		200127	100033
法定代表人		熊国兵	吴利军

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ebscn-am.com
基金中期报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层

### 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
据和指标	光大阳光稳债收益 12 个月持有债券 A	光大阳光稳债收益 12 个月持有债券 C

本期已实现收益	8,490,978.45	1,764,326.83
本期利润	11,178,466.03	2,353,576.07
加权平均基金份额本期利润	0.0287	0.0267
本期加权平均净值利润率	2.54%	2.39%
本期基金份额净值增长率	2.56%	2.41%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利润	49,728,947.54	9,725,977.46
期末可供分配基金份额利润	0.1337	0.1206
期末基金资产净值	424,715,535.32	91,030,590.17
期末基金份额净值	1.1418	1.1286
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	14.27%	12.86%

注：1、表中的“期末”均指报告期最后一日，即 2024 年 6 月 30 日；“本期”指 2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日。

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

光大阳光稳债收益 12 个月持有债券 A

阶段	份额净	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准	①—③	②—④
----	-----	------	-------	--------	-----	-----

	值增长率①	增长率标准差②	准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	0.55%	0.03%	0.63%	0.03%	-0.08%	0.00%
过去三个月	1.20%	0.05%	1.02%	0.07%	0.18%	-0.02%
过去六个月	2.56%	0.05%	2.34%	0.06%	0.22%	-0.01%
过去一年	3.95%	0.04%	3.18%	0.05%	0.77%	-0.01%
过去三年	11.17%	0.04%	6.48%	0.05%	4.69%	-0.01%
自基金合同生效起至今	14.27%	0.04%	7.07%	0.05%	7.20%	-0.01%

光大阳光稳债收益 12 个月持有债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.53%	0.02%	0.63%	0.03%	-0.10%	-0.01%
过去三个月	1.13%	0.05%	1.02%	0.07%	0.11%	-0.02%
过去六个月	2.41%	0.05%	2.34%	0.06%	0.07%	-0.01%
过去一年	3.64%	0.04%	3.18%	0.05%	0.46%	-0.01%
过去三年	10.17%	0.04%	6.48%	0.05%	3.69%	-0.01%
自基金合同生效起至今	12.86%	0.04%	7.04%	0.05%	5.82%	-0.01%

注：1、自基金合同生效起至今指 2020 年 08 月 17 日至 2024 年 6 月 30 日；

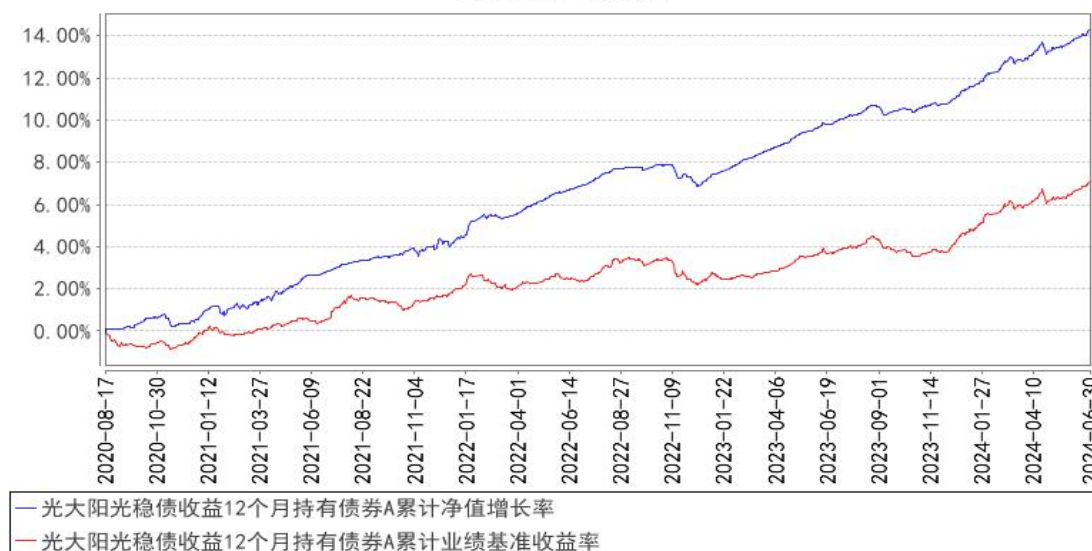
2、业绩比较基准为：中债综合指数收益率×95%+1 年期定期存款利率(税后)×5%

3、C 类份额设立日为 2020 年 08 月 18 日。

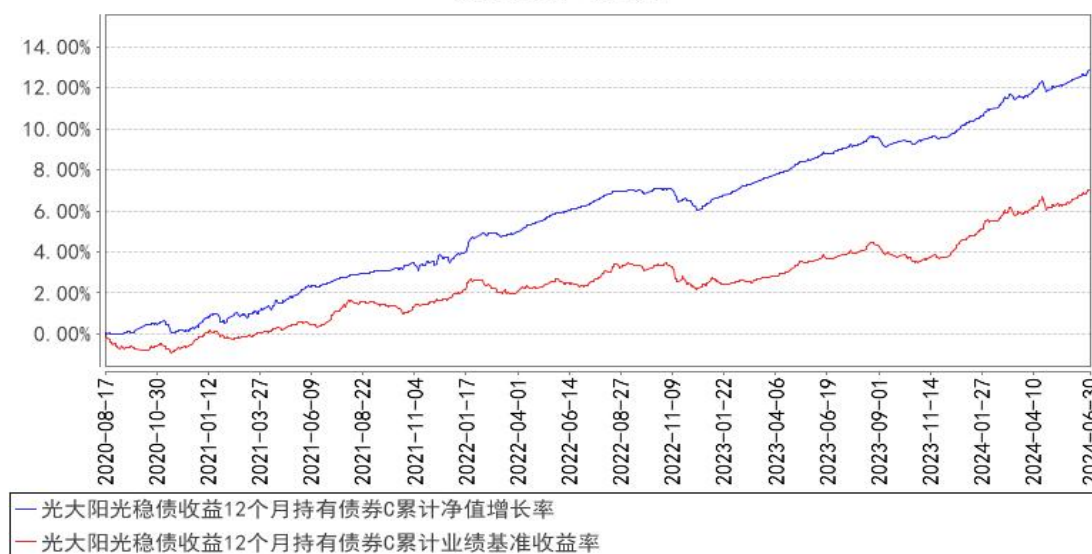


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

光大阳光稳债收益12个月持有债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



光大阳光稳债收益12个月持有债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上海光大证券资产管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）成立于2012年5月9日，前身为原光大证券股份有限公司资产管理总部，承继了光大证券的客户资产管理业务与资格。2002年5月14日，中国证券监督管理委员会核发证监机构字[2002]127号《关于核准光大证券有限责任公司受托投资管理业务资格的批复》，同意光大证券从事客户资产管理业务。2011年11月23

日,中国证券监督管理委员会核发证监许可[2011]1886号《关于核准光大证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》,同意光大证券设立资产管理子公司并核准公司章程。2012年2月21日,公司在上海市工商行政管理局登记注册,注册资本2亿元,光大证券持股100%。

截至2024年6月末,本公司共管理15只参照开放式证券投资基金管理的集合计划,公司在投资、风险控制等方面积累了丰富的经验。

#### 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		
车飞	本集合计划投资经理	2021年7月19日	-	12年	车飞先生,毕业于英国雷丁大学。曾就职于联合资信评估有限公司、阳光人寿保险有限公司、中国国际金融股份有限公司、历任信评分析师、信用风险主管、信用负责人。2017年加入光大证券资产管理有限公司,现任公司总经理助理兼固定收益研究部总经理,担任光大阳光稳债收益12个月持有期债券型集合资产管理计划、光大阳光稳债中短债债券型集合资产管理计划投资经理。
崔宁	本集合计划投资经理	2022年10月20日	-	7年	崔宁女士,清华大学学士、硕士。2017年加入上海光大证券资产管理有限公司担任信用研究员,历任光证资管信用研究员、投资助理,现任固定收益公募投资部投资经理,担任光大阳光稳债收益12个月持有期债券型集合资产管理计划、光大阳光稳债中短债债券型集合资产管理计划投资经理。

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

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

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

本集合计划本报告期末投资经理无兼任私募资产管理计划的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年以来债券市场整体呈现牛市格局，一季度信贷压力较去年同期有所减弱，同时地方债、国债和政金债的供给速度偏慢，市场在资产荒的压力下对于债券配置需求保持强劲。两会后政府工作报告对于全年经济增速目标设定在 5%并未超出市场预期，对地产表述温和促使债券利率进一步下行。4 月末央行严厉的喊话叠加一系列地产政策出台，债市大幅回调，市场开始交易政治局会议及地产政策放松带来的刺激效果。但是随着地产政策陆续落地，弱现实交易重新占据上风。在手工补息禁止的影响下，非银资金较为充裕，债市收益率重新下行。转债市场方面，4 月底随着地产政策的出台，转债跟随权益市场得到增量资金配置，但地产政策落地后也随着股市情绪转弱而回落。6 月部分个券的信用风险随着外部评级调整被市场关注引发集体下跌，整体估值有所压缩。

报告期内，本集合计划灵活运用杠杆、票息策略，根据市场情况动态调整组合资产分布。我们秉承稳健的投资原则，严控组合流动性风险、利率风险和信用风险。后续将密切关注基本面、政策面和资金面的边际变化，力争通过精选个券和波段操作为账户增厚收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日，光大阳光稳债收益 12 个月持有债券 A 份额净值为 1.1418 元，本报告期份额净值增长率为 2.56%；光大阳光稳债收益 12 个月持有债券 C 类份额净值为 1.1286 元，本报告期份额净值增长率为 2.41%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为目前的政策框架下，经济可能经历长期的弱修复过程，数据指向中长期债券市场仍然具有配置价值。从前期表态来看，汇率稳定和防风险是现阶段央行关注的核心，考虑到目前央行的操作尚未落地，长端利率波段操作难度有所增加。未来我们将保持配置思路和灵活的仓位管理，同时关注市场的边际变化。具体来说，一方面，关注经济基本面的变化，包括地产、通胀、出口等核心指标；另一方面，虽然市场流动性整体充裕，但资金面仍然是下半年债市博弈的重要变量之一，我们将密切关注债券供给、汇率等因素带来的资金面变化趋势。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本集合计划管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和集合计划合同的约定，对集合计划所持有的投资品种进行估值，本集合计划托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。集合计划份额净值由集合计划管理人完成估值后，经集合计划托管人复核无误后由集合计划管理人对外公布。本集合计划管理人对投资品种进行估值时原则上应保持估值程序和技术的一致性，对旗下管理的不同产品持有的具有相同特征的同一投资品种的估值调整原则、程序及技术应当一致（中国证监会规定的特殊品种除外）。为了保障集合计划能真实、准确地反映投资品种的公允价值，本集合计划管理人授权估值委员会负责建立健全估值决策体系，估值委员会成员的任命和调整由总经理办公会审议决定。运营部是估值委员会的日常办事机构，负责关注相关投资品种的动态，确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种，并提交估值委员会审议。运营部的估值人员均具有专业会计学习经历，具有基金从业人员资格。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本集合计划报告期内未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在光大阳光稳债收益 12 个月持有期债券型集合资产管理计划（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行

了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实守信、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

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

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《光大阳光稳债收益 12 个月持有期债券型集合资产管理计划 2024 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

# § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：光大阳光稳债收益 12 个月持有期债券型集合资产管理计划

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	5,008,823.88	24,080,338.31
结算备付金		10,040,856.13	10,562,006.87
存出保证金		10,266.86	221,600.98
交易性金融资产	6.4.7.2	628,539,007.35	674,733,979.60
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		628,539,007.35	674,733,979.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		200,043.30	0.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		643,798,997.52	709,597,925.79
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		127,021,723.29	135,007,524.65
应付清算款		6,748.94	35,468.06
应付赎回款		580,426.09	933,805.49
应付管理人报酬		210,527.21	246,692.61
应付托管费		42,105.45	49,338.53
应付销售服务费		22,398.10	27,665.71
应付投资顾问费		-	-
应交税费		43,524.59	59,139.97
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	125,418.36	206,568.42
负债合计		128,052,872.03	136,566,203.44
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	452,618,363.85	515,705,512.85
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	63,127,761.64	57,326,209.50
净资产合计		515,746,125.49	573,031,722.35
负债和净资产总计		643,798,997.52	709,597,925.79

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，集合计划份额总额 452,618,363.85 份。光大阳光稳债收益 12 个月持有 A 集合计划份额净值 1.1418 元，集合计划份额 371,960,814.62 份，集合计划资产净值 424,715,535.32 元。光大阳光稳债收益 12 个月持有 C 集合计划份额净值 1.1286 元，集合计划份额 80,657,549.23 份，集合计划资产净值 91,030,590.17 元。

## 6.2 利润表

会计主体：光大阳光稳债收益 12 个月持有期债券型集合资产管理计划

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		17,018,268.01	38,256,264.56
1. 利息收入		100,838.13	487,138.27
其中：存款利息收入	6.4.7.13	92,180.03	178,081.77
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		8,658.10	309,056.50
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		13,640,693.06	24,418,358.49
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	13,760,575.50	24,104,093.57
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	314,264.92
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-119,882.44	-
股利收益	6.4.7.19	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	3,276,736.82	13,350,767.80
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		3,486,225.91	8,065,425.06
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,339,212.46	3,037,951.92
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	267,842.48	607,590.35
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	146,790.04	314,838.85
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,595,069.28	3,919,210.74

其中：卖出回购金融资产支出		1,595,069.28	3,919,210.74
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		39,645.39	89,331.92
8. 其他费用	6.4.7.23	97,666.26	96,501.28
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		13,532,042.10	30,190,839.50
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		13,532,042.10	30,190,839.50
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		13,532,042.10	30,190,839.50

### 6.3 净资产变动表

会计主体：光大阳光稳债收益 12 个月持有期债券型集合资产管理计划

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	515,705,512.85	-	57,326,209.50	573,031,722.35
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	515,705,512.85	-	57,326,209.50	573,031,722.35
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-63,087,149.00	-	5,801,552.14	-57,285,596.86
（一）、综合收益总额	-	-	13,532,042.10	13,532,042.10
（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）	-63,087,149.00	-	-7,730,489.96	-70,817,638.96
其中：1. 基金申购款	13,480,193.65	-	1,727,151.47	15,207,345.12
2. 基金赎回	-76,567,342.65	-	-9,457,641.43	-86,024,984.08



回款				
(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	452,618,363.85	-	63,127,761.64	515,746,125.49
项目	上年度可比期间			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,167,313,034.12	-	81,790,878.97	1,249,103,913.09
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,167,313,034.12	-	81,790,878.97	1,249,103,913.09
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-69,569,559.24	-	24,430,046.92	-45,139,512.32
(一)、综合收益总额	-	-	30,190,839.50	30,190,839.50
(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)	-69,569,559.24	-	-5,760,792.58	-75,330,351.82
其中：1. 基金申购款	24,587,893.54	-	2,020,640.44	26,608,533.98
2. 基金赎回款	-94,157,452.78	-	-7,781,433.02	-101,938,885.80
(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	-	-	-	-

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	1,097,743,474.88	-	106,220,925.89	1,203,964,400.77

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

常松	詹朋	杨薇
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

光大阳光稳债收益 12 个月持有期债券型集合资产管理计划是由光大阳光稳债收益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股份有限公司于 2020 年 8 月 1 日发布《光大阳光稳债收益集合资产管理计划合同变更公告》。根据公告，光大阳光稳债收益集合资产管理计划名称变更为“光大阳光稳债收益 12 个月持有期混合型集合资产管理计划”，光大阳光稳债收益集合资产管理计划份额转换为光大阳光稳债收益 12 个月持有期债券型集合资产管理计划 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 8 月 17 日起《光大阳光稳债收益 12 个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》、《光大阳光稳债收益 12 个月持有期债券型集合资产管理计划托管协议》生效。本集合计划存续期至 2024 年 12 月 31 日，本集合计划自 2024 年 12 月 31 日后，按照中国证监会的有关规定执行。本集合计划管理人为上海光大证券资产管理有限公司，托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《光大阳光稳债收益 12 个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》的有关规定，本集合计划的投资范围为：具有良好流动性的金融工具，包括债券（国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、政府支持机构债、政府支持债、地方政府债、次级债、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含分离型可转换债券）、可交换债券）、资产支持证券、债券回购、协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款、同业存单、国债期货、货币市场工具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。

本集合计划不直接投资于股票，但可持有因可转换债券和可交换债券转股所形成的股票等权益资产。因上述原因持有的股票，本集合计划将在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。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：本集合计划债券资产的投资比例不低于集合计划资产的 80%，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本集合计划持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。国债期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本集合计划的业绩比较基准为：中债综合指数收益率\*95%+1 年期定期存款利率(税后)\*5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本集合计划合同和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划 2024 半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本集合计划本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本集合计划本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对集合计划管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对集合计划从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，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。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	5,008,823.88
等于：本金	5,006,266.40
加：应计利息	2,557.48
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	5,008,823.88

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	126,043,842.41	1,671,023.59	128,822,770.79	1,107,904.79
	银行间市场	487,928,682.09	6,937,636.56	499,716,236.56	4,849,917.91
	合计	613,972,524.50	8,608,660.15	628,539,007.35	5,957,822.70
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	613,972,524.50	8,608,660.15	628,539,007.35	5,957,822.70	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本集合计划本报告期末无衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本集合计划本报告期末无期货合约。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本集合计划本报告期末无黄金衍生品。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本集合计划本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本集合计划本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明**

无。

**6.4.7.5 债权投资**

**6.4.7.5.1 债权投资情况**

本集合计划本报告期无债权投资。

**6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

本集合计划本报告期无债权投资。

**6.4.7.6 其他债权投资**

**6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

本集合计划本报告期无其他债权投资。

**6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

本集合计划本报告期无其他债权投资。

**6.4.7.7 其他权益工具投资**

**6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

本集合计划本报告期末无其他权益工具投资。

**6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

本集合计划本报告期末无其他权益工具投资。

**6.4.7.8 其他资产**

本集合计划本报告期末无其他资产。

**6.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	46,352.10
其中：交易所市场	199.62
银行间市场	46,152.48
应付利息	-
预提费用	79,066.26
合计	125,418.36

**6.4.7.10 实收基金**

金额单位：人民币元

光大阳光稳债收益 12 个月持有债券 A

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	418,969,469.07	418,969,469.07
本期申购	10,604,876.25	10,604,876.25
本期赎回（以“-”号填列）	-57,613,530.70	-57,613,530.70
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	371,960,814.62	371,960,814.62

光大阳光稳债收益 12 个月持有债券 C

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	96,736,043.78	96,736,043.78
本期申购	2,875,317.40	2,875,317.40
本期赎回（以“-”号填列）	-18,953,811.95	-18,953,811.95
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	80,657,549.23	80,657,549.23

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本集合计划本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

光大阳光稳债收益 12 个月持有债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	46,938,047.26	518,768.47	47,456,815.73
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	46,938,047.26	518,768.47	47,456,815.73
本期利润	8,490,978.45	2,687,487.58	11,178,466.03
本期基金份额交易产生的变动数	-5,700,078.17	-180,482.89	-5,880,561.06
其中：基金申购款	1,338,179.12	59,210.64	1,397,389.76
基金赎回款	-7,038,257.29	-239,693.53	-7,277,950.82
本期已分配利润	-	-	-

本期末	49,728,947.54	3,025,773.16	52,754,720.70
光大阳光稳债收益 12 个月持有债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,753,129.10	116,264.67	9,869,393.77
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	9,753,129.10	116,264.67	9,869,393.77
本期利润	1,764,326.83	589,249.24	2,353,576.07
本期基金份额交易产生的变动数	-1,791,478.47	-58,450.43	-1,849,928.90
其中：基金申购款	312,523.89	17,237.82	329,761.71
基金赎回款	-2,104,002.36	-75,688.25	-2,179,690.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,725,977.46	647,063.48	10,373,040.94

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	69,105.31
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	22,964.09
其他	110.63
合计	92,180.03

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

本集合计划本报告期无股票投资收益。

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

本集合计划本报告期无买卖股票差价收入。

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本集合计划本报告期无股票出借差价收入。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	12,362,445.22
债券投资收益——买卖债券（债转股及债	1,398,130.28



券到期兑付) 差价收入	
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	13,760,575.50

#### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,061,722,825.94
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,045,375,759.23
减：应计利息总额	14,915,132.10
减：交易费用	33,804.33
买卖债券差价收入	1,398,130.28

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

#### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期无债券赎回差价收入。

#### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期无债券申购差价收入。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本集合计划本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本集合计划本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期无资产支持证券赎回差价收入。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期无资产支持证券申购差价收入。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本集合计划本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本集合计划本报告期无买卖贵金属差价收入。

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本集合计划本报告期无贵金属赎回差价收入。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本集合计划本报告期无贵金属申购差价收入。

**6.4.7.18 衍生工具收益**

**6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本集合计划本报告期无买卖权证差价收入。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	-119,882.44

**6.4.7.19 股利收益**

本集合计划本报告期无股利收益。

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	3,271,736.82
股票投资	-
债券投资	3,271,736.82
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	5,000.00
权证投资	-
期货投资	5,000.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	3,276,736.82

**6.4.7.21 其他收入**

本集合计划本报告期无其他收入。

**6.4.7.22 信用减值损失**

本集合计划本报告期无信用减值损失。

### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	19,393.92
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
合计	97,666.26

### 6.4.7.24 分部报告

无。

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本集合计划未发生需要披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本集合计划无须作披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

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

本集合本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

本集合计划本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
光大证券	197,348,238.30	100.00	410,849,442.41	100.00

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
光大证券	2,825,700,000.00	100.00	10,799,000,000.00	100.00

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本集合计划本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
光大证券	388.90	100.00	199.62	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
光大证券	6,107.26	100.00	2,312.25	100.00

注：1、上述佣金按市场佣金率计算。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本集合计划提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,339,212.46	3,037,951.92
其中：应支付销售机构的客户维护费	658,830.55	1,407,853.96
应支付基金管理人的净管理费	680,381.91	1,630,097.96

注：本集合计划管理费按前一日集合计划资产净值的 0.5% 年费率计提，计算方法如下：

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

G 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日集合计划资产净值

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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	267,842.48	607,590.35

注：本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的 0.10% 年费率计提，计算方法如下：

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

T 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日集合计划资产净值

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

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	光大阳光稳债收益 12 个月持有债券 A	光大阳光稳债收益 12 个月持有债券 C	合计
光大银行	-	118,871.25	118,871.25
光大证券	-	3,304.30	3,304.30
光证资管	-	999.44	999.44
合计	-	123,174.99	123,174.99

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	光大阳光稳债收益 12 个月持有债券 A	光大阳光稳债收益 12 个月持有债券 C	合计
光大银行	-	271,757.88	271,757.88
光大证券	-	4,102.13	4,102.13
光证资管	-	964.28	964.28
合计	-	276,824.29	276,824.29

注：本集合计划 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的销售服务费年费率为 0.3%，销售服务费按前一日 C 类份额的集合计划资产净值的 0.3% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类份额前一日的集合计划资产净值

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本集合计划本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本集合计划本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本集合计划本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间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。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期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。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	5,008,823.88	69,105.31	24,398,844.02	89,135.52

注：本集合计划的银行存款由集合计划托管人保管，按银行约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本集合计划本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本集合计划本报告期无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本集合计划本报告期未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本集合计划本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本集合计划本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本集合计划从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 87,021,723.29 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
1928029	19 中国银行二级 02	2024 年 7 月 1 日	113.63	100,000	11,362,566.12
2228006	22 中国银行二级 01	2024 年 7 月 1 日	104.25	100,000	10,424,950.82
230022	23 付息国债 22	2024 年 7 月 1 日	104.21	32,000	3,334,767.21
230024	23 付息国债	2024 年 7 月 1 日	101.85	400,000	40,740,415.30

	债 24	日			
2400002	24 特别国 债 02	2024 年 7 月 1 日	102.27	300,000	30,681,105.98
合计				932,000	96,543,805.43

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本集合计划从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 40,000,000.00 元，于 2024 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本集合计划在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本集合计划本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划在日常经营活动中面临的与金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。管理人制定内部风险管理制度来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

公司建立四个层级的风险管理体系，即董事会、经理层及各专业委员会、各风险管理职能部门、各业务部门。公司董事会是风险管理的最高决策机构，承担全面风险管理的最终责任。公司经理层就公司风险管理工作的有效性向董事会负责，对全面风险管理承担主要责任。公司经理层在董事会的领导下，全面负责公司风险管理的日常工作。公司经理层下设专业委员会就不同类别风险管理对经理层负责，委员会根据公司各委员会议事规则确定的职责范围，行使公司风险管理职能。各风险管理职能部门按照公司授权对公司不同风险进行识别、监测、评估和报告，并制定公司不同类型风险管理办法，明确具体工作流程，并为业务决策提供对口风险管理建议，协助、指导和检查各部门的对口风险管理工作。公司各业务部门按照公司授权管理体系在被授予的权限范围内开展业务，严禁越权从事经营活动，并通过制度、流程、系统等方式，进行有效管理和控制。

本集合计划的管理人主要通过定性分析和定量分析的方法评估各种金融工具风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本集合计划的投资目标，结合集合计划资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。



### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者集合计划所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。

本集合计划的银行存款存放在本集合计划的托管行中国光大银行股份有限公司，与该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均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	71,666,177.05	132,536,014.74
合计	71,666,177.05	132,536,014.74

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、短期融资券。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末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。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	265,200,177.04	249,204,774.99
AAA 以下	80,052,029.98	81,189,939.37
未评级	211,620,623.28	211,803,250.50
合计	556,872,830.30	542,197,964.86

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、政策性金融债、中期票据、公司债。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末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。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指集合计划管理人未能以合理价格及时变现集合计划资产以支付投资者赎回款项的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于计划份额持有人可随时要求赎回其持有的计划份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

##### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

##### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划的管理人在运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本集合计划资产的流动性风险进行管理，集合计划管理人建立了健全的流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，对组合持仓集中度、流动性受限资产比例、现金类资产比例等流动性指标进行持续的监测和分析，通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，对交易对手进行必要的尽职调查和准入，加强逆回购的流动性风险和交易对手风险的管理，并健全了逆回购交易质押品管理制度。

本集合计划所持有的的证券大部分具有良好的流动性，本集合计划本报告期末未持有流通受限的证券，本报告期内本集合计划未出现因投资品种变现困难或投资集中而无法以合理价格及时变现集合计划资产以支付赎回款的情况。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指集合计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本集合计划的管理人定期对本集合计划面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组

合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,008,823.88	-	-	-	5,008,823.88
结算备付金	10,040,856.13	-	-	-	10,040,856.13
存出保证金	10,266.86	-	-	-	10,266.86
交易性金融资产	327,983,030.67	146,994,446.85	153,561,529.83	-	628,539,007.35
应收申购款	-	-	-	200,043.30	200,043.30
资产总计	343,042,977.54	146,994,446.85	153,561,529.83	200,043.30	643,798,997.52
负债					
应付赎回款	-	-	-	580,426.09	580,426.09
应付管理人报酬	-	-	-	210,527.21	210,527.21
应付托管费	-	-	-	42,105.45	42,105.45
应付清算款	-	-	-	6,748.94	6,748.94
卖出回购金融资产款	127,021,723.29	-	-	-	127,021,723.29
应付销售服务费	-	-	-	22,398.10	22,398.10
应交税费	-	-	-	43,524.59	43,524.59
其他负债	-	-	-	125,418.36	125,418.36
负债总计	127,021,723.29	-	-	1,031,148.74	128,052,872.03
利率敏感度缺口	216,021,254.25	146,994,446.85	153,561,529.83	-831,105.44	515,746,125.49
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	24,080,338.31	-	-	-	24,080,338.31
结算备付金	10,562,006.87	-	-	-	10,562,006.87
存出保证金	221,600.98	-	-	-	221,600.98
交易性金融资产	326,752,607.22	254,766,585.50	93,214,786.88	-	674,733,979.60
应收申购款	-	-	-	0.03	0.03
资产总计	361,616,553.38	254,766,585.50	93,214,786.88	0.03	709,597,925.79
负债					
应付赎回款	-	-	-	933,805.49	933,805.49
应付管理人报酬	-	-	-	246,692.61	246,692.61
应付托管费	-	-	-	49,338.53	49,338.53
应付清算款	-	-	-	35,468.06	35,468.06
卖出回购金融资产款	135,007,524.65	-	-	-	135,007,524.65
应付销售服务费	-	-	-	27,665.71	27,665.71
应交税费	-	-	-	59,139.97	59,139.97
其他负债	-	-	-	206,568.42	206,568.42
负债总计	135,007,524.65	-	-	1,558,678.79	136,566,203.44
利率敏感度缺口	226,609,028.73	254,766,585.50	93,214,786.88	-1,558,678.76	573,031,722.35

注：表中所示为本集合计划资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	4,561,542.91	2,894,680.42
市场利率上升 25 个基点	-4,561,542.91	-2,894,680.42	

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本集合计划的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

无。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是集合计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素发生变动时产生的价格波动风险。本集合计划主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本集合计划严格按照合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，管理人每日对本集合计划所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对集合计划进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

无。

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本集合计划本报告期末及上年度末均不存在其他价格风险的敏感性分析。

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本集合计划本报告期无采用风险价值法管理的风险。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	10,685,141.46	15,987,801.23
第二层次	617,853,865.89	658,746,178.37
第三层次	-	-
合计	628,539,007.35	674,733,979.60

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本集合计划不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本集合计划未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

###### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本集合计划无需要说明的其他重要事项。

### § 7 投资组合报告

#### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	628,539,007.35	97.63
	其中：债券	628,539,007.35	97.63
	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	15,049,680.01	2.34
8	其他各项资产	210,310.16	0.03
9	合计	643,798,997.52	100.00

#### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有境内股票。

##### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有港股通股票。

#### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本集合计划本报告期末未持有股票。

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本集合计划本报告期末未进行股票投资。

##### 7.4.2 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

本集合计划本报告期末未进行股票投资。

##### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本集合计划本报告期末未进行股票投资。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	93,111,783.57	18.05
2	央行票据	-	-
3	金融债券	122,231,519.81	23.70
	其中：政策性金融债	30,820,990.57	5.98
4	企业债券	185,804,365.51	36.03
5	企业短期融资券	30,925,761.75	6.00
6	中期票据	185,780,435.25	36.02
7	可转债（可交换债）	10,685,141.46	2.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	628,539,007.35	121.87

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	230024	23 付息国债 24	400,000	40,740,415.30	7.90
2	2400002	24 特别国债 02	300,000	30,681,105.98	5.95
3	102101315	21 渝惠通 MTN001	200,000	20,879,068.85	4.05
4	240182	23 汉投 10	200,000	20,867,229.59	4.05
5	042380418	23 安东控股 CP001	200,000	20,712,404.37	4.02

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本集合计划本报告期末无资产支持证券投资。

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

本集合计划本报告期末无贵金属投资。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本集合计划本报告期末无权证投资。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.10.1 本期国债期货投资政策

本集合计划对国债期货的投资以套期保值为主要目的，结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，获取超额收益。

### 7.10.2 本期国债期货投资评价

本集合计划参与国债期货的投资，符合法律法规规定和集合计划产品合同的投资限制，并遵

守相关的业务规则，且对集合计划的总体风险相对可控。

## 7.11 投资组合报告附注

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

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

### 7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本集合计划本期末未持有股票。

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	10,266.86
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	200,043.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	210,310.16

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113021	中信转债	2,585,193.93	0.50
2	113516	苏农转债	2,575,725.18	0.50
3	113024	核建转债	1,904,782.86	0.37
4	110062	烽火转债	1,558,082.33	0.30
5	110087	天业转债	1,396,291.18	0.27
6	113044	大秦转债	665,065.98	0.13

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划本报告期末未持有股票。

### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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



## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
光大阳光稳债收益 12 个月持有债券 A	5,510	67,506.50	2,772,627.81	0.75	369,188,186.81	99.25
光大阳光稳债收益 12 个月持有债券 C	2,207	36,546.24	-	-	80,657,549.23	100.00
合计	7,717	58,652.11	2,772,627.81	0.61	449,845,736.04	99.39

注：分级集合机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级集合，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级集合份额的合计数（即期末集合份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	光大阳光稳债收益 12 个月持有债券 A	92,048.72	0.0247
	光大阳光稳债收益 12 个月持有债券 C	94,195.96	0.1168
	合计	186,244.68	0.0411

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

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	光大阳光稳债收益 12 个月持有债券 A	0~10
	光大阳光稳债收益 12 个月持有债券 C	0~10
	合计	0~10

本基金基金经理持有 本开放式基金	光大阳光稳债收益 12 个月 持有债券 A	0
	光大阳光稳债收益 12 个月 持有债券 C	0~10
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	光大阳光稳债收益 12 个月持有债券 A	光大阳光稳债收益 12 个月持有债券 C
基金合同生效日 (2020 年 8 月 17 日) 基金份额总额	8,856,745,821.89	-
本报告期期初基金份 额总额	418,969,469.07	96,736,043.78
本报告期基金总申购 份额	10,604,876.25	2,875,317.40
减：本报告期基金总 赎回份额	57,613,530.70	18,953,811.95
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	371,960,814.62	80,657,549.23

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本集合计划未召开集合计划份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 2024 年 6 月 25 日，本集合计划管理人增聘张丁为公司副总经理。
- 本报告期内，本集合计划基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及集合计划管理人、集合计划财产、集合计划托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本集合计划投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本集合计划报告期末改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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	-	-	388.90	100.00	-

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

#### 2、交易单元的选择标准和程序

##### (1) 选择标准

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

##### (2) 选择程序

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

#### 3、本报告期内无新增券商交易单元。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
光大证券	197,348,238.30	100.00	2,825,700,000.00	100.00	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	光大阳光稳债收益 12 个月持有期债券型集合资产管理计划恢复申购、转换转入、定期定额投资公告	中国证监会规定的媒介	2024 年 01 月 16 日
2	光大阳光稳债收益 12 个月持有期债券型集合资产管理计划 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定的媒介	2024 年 01 月 22 日
3	光大阳光稳债收益 12 个月持有期债券型集合资产管理计划 2023 年年度报告	中国证监会规定的媒介	2024 年 03 月 29 日
4	光大阳光稳债收益 12 个月持有期债券型集合资产管理计划 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定的媒介	2024 年 04 月 22 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本集合计划本报告期内无单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予《光大阳光稳债收益 12 个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》变更批复的文件；

2、《光大阳光稳债收益 12 个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》；

3、《光大阳光稳债收益 12 个月持有期债券型集合资产管理计划托管协议》；

4、《光大阳光稳债收益 12 个月持有期债券型集合资产管理计划招募说明书》；

5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；

6、集合计划管理人业务资格批件、营业执照；

7、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于集合计划管理人的办公场所：

1、中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层

### 12.3 查阅方式

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

上海光大证券资产管理有限公司

2024 年 8 月 30 日