

光大阳光现金宝货币型集合资产管理计划 2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：上海光大证券资产管理有限公司

基金托管人：中国证券登记结算有限责任公司

报告送出日期：2024 年 10 月 25 日

§1 重要提示

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

集合计划托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本集合计划合同规定，于 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 07 月 01 日起至 2024 年 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	光大阳光现金宝货币
基金主代码	863001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 1 月 10 日
报告期末基金份额总额	19,313,033,839.41 份
投资目标	在控制投资组合风险，保持流动性的前提下，力争为投资人提供稳定的收益。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本集合计划通过对国内市场资金供求、利率水平、通货膨胀率、GDP 增长率、就业率水平以及国际市场利率水平等宏观经济指标的跟踪和分析，形成对宏观层面的判断。同时，结合对央行公开市场操作、债券供给等情况，对短期利率走势进行综合判断。基于对货币市场利率趋势变化的合理预测，决定并动态调整投资组合平均剩余期限和比例分布。</p> <p>2、期限配置策略</p> <p>根据对短期利率走势的判断确定并调整组合的平均期限。在预期短期利率上升时，缩短组合的平均期限，以规避资本损失或获得较高的再投资收益；在预期短期利率下降时，延长组合的平均期限，以获得资本利得或锁定较高的利率水平。</p> <p>3、回购策略</p> <p>在有效控制风险的前提下，本集合计划将密切跟踪不同市场和不同期</p>

	<p>限之间的利率差异，在精确投资收益测算的基础上，积极采取回购杠杆操作，为集合计划资产增加收益。</p> <p>4、个券选择策略 在个券选择层面，首先从安全性角度出发，优先选择央票、短期国债等债券品种以规避信用违约风险。</p> <p>5、交易策略 （1）收益率曲线分析；（2）套利策略；（3）波动性交易策略</p> <p>6、流动性管理策略 根据对市场资金面分析以及对申购、赎回变化的动态预测，通过现金管理、回购的滚动操作和债券品种的期限结构搭配，动态调整并有效分配基金的现金流，在保持本集合计划资产充分流动性的基础上，确保稳定收益。</p>
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。
风险收益特征	本集合计划是一只货币市场型集合计划，其预期风险和预期收益低于债券型基金、债券型集合计划、混合型基金、混合型集合计划、股票型基金、股票型集合计划。
基金管理人	上海光大证券资产管理有限公司
基金托管人	中国证券登记结算有限责任公司

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	43,746,939.02
2. 本期利润	43,746,939.02
3. 期末基金资产净值	19,313,033,839.41

注：1、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，由于本集合计划采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、本集合计划利润分配是按月结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率 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	①-③	②-④
----	--------	---------------	----------------	------------------	-----	-----

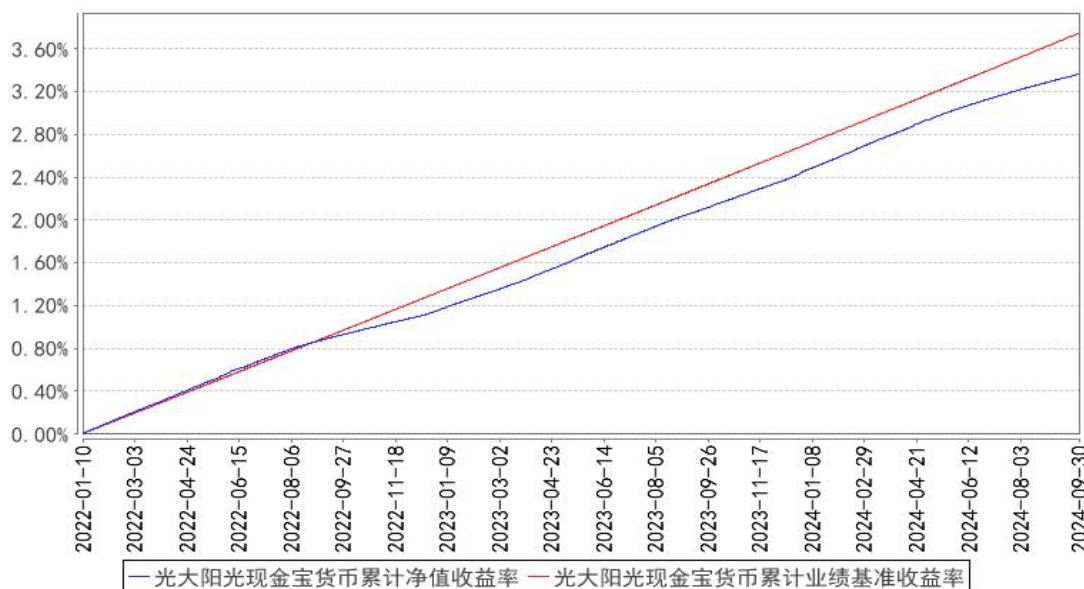
				④		
过去三个月	0.2332%	0.0003%	0.3408%	0.0000%	-0.1076%	0.0003%
过去六个月	0.5377%	0.0007%	0.6791%	0.0000%	-0.1414%	0.0007%
过去一年	1.2094%	0.0007%	1.3629%	0.0000%	-0.1535%	0.0007%
自基金合同生效起至今	3.3678%	0.0007%	3.7486%	0.0000%	-0.3808%	0.0007%

注：1、自基金合同生效起至今指 2022 年 1 月 10 日至 2024 年 9 月 30 日；

2、业绩比较基准为：同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）

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

光大阳光现金宝货币累计净值收益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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
樊亚筠	本集合计划投资经理	2022年1月10日	-	10年	樊亚筠女士，硕士学历，曾在富国资产管理有限公司投资部及富国基金管理有限公司固定收益部担任投资经理助理、投资经理。2018年加入光证资管，现担任固定收益公募投资部副总经理，担任光大阳光现金宝货币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。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024 年三季度债券收益率整体呈现震荡下行趋势，且波动幅度较大。整体来看，三季度债券市场持续走强的驱动因素主要有流动性宽松、宏观经济数据不及预期以及机构投资者负债成本持续下调等，震荡调整的驱动因素主要有央行对收益率引导、大型银行集中卖出国债、重要会议等。三季度债券市场在趋势下行过程中出现多次大幅震荡调整，主要以 8 月上旬和 9 月下旬两次上行调整较为显著。其中 8 月上旬受大型商业银行集中卖出长端国债影响，10 年国债收益率上行约 13BP。9 月下旬受重要会议释放经济刺激政策影响，10 年国债收益率上行约 22BP。三季度以来，央行持续保持“支持性”货币政策，对于受资金面影响较大的债券市场起到了稳定器的作用。央行在三季度明确了 7 天逆回购操作利率作为主要的政策利率，并于 7 月和 9 月两次降低这一政策利率，合计降幅达 30BP。通过政策利率的调降，三季度带动 MLF 利率下降 50BP，显著降低了商业银行获取稳定长期负债的成本。

报告期内，账户在 9 月末预留足够的资金，账户偏防守，择机止盈部分存单和信用债。四季度我们将回归均衡的资产配置。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。展望后市，对择时更加慎重、继续注重对优质标的挖掘。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本集合计划本报告期份额净值收益率为 0.2332%，同期业绩比较基准收益率为 0.3408%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	15,735,750,613.37	77.04
	其中：债券	15,735,750,613.37	77.04
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	1,127,473,317.86	5.52
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备 付金合计	3,170,182,530.31	15.52
4	其他资产	393,208,075.55	1.92
5	合计	20,426,614,537.09	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。

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	13.64	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	1,091,187,974.89	5.65
	其中：买断式回购融资	-	-

注：上表中报告期内债券回购融资余额占集合计划资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占集合计划资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本报告期内本集合计划债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	103
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	112
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	53

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本集合计划投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	19.90	5.65
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	18.32	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	32.90	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	2.90	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	31.19	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	105.21	5.65

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本集合计划投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	9,512,205,740.62	49.25
6	中期票据	277,413,633.09	1.44
7	同业存单	5,946,131,239.66	30.79
8	其他	-	-
9	合计	15,735,750,613.37	81.48
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112480485	24 徽商银行 CD095	3,000,000	298,876,431.41	1.55
2	012481471	24 五矿集 SCP002	2,000,000	201,520,922.74	1.04
3	012482655	24 中建一局 SCP005(科创票 据)	2,000,000	200,303,788.50	1.04
4	012482640	24 中建三局 SCP010(科创票 据)	2,000,000	200,291,299.74	1.04
5	112314191	23 江苏银行 CD191	2,000,000	199,372,122.32	1.03
6	112418252	24 华夏银行 CD252	2,000,000	199,362,666.49	1.03
7	112403153	24 农业银行 CD153	2,000,000	199,191,557.81	1.03
8	112413089	24 浙商银行 CD089	2,000,000	199,166,010.24	1.03
9	112404027	24 中国银行 CD027	2,000,000	198,286,449.36	1.03
10	112416173	24 上海银行 CD173	2,000,000	198,239,101.95	1.03

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0457%
报告期内偏离度的最低值	-0.0253%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0195%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本集合计划本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本集合计划本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本集合计划按实际利率法计算金融资产的账面价值，并采用影子定价和偏离度控制，以确保

集合计划资产净值能够公允地反映集合计划投资组合价值。

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

本报告编制日前一年内：

1) 本集合计划持有的“24 农业银行 CD153”发行主体因违规经营，于 2023 年 8 月 18 日被国家金融监督管理总局没收违法所得，并罚款 1760.09 万元；因未依法履行职责，于 2023 年 11 月 17 日被国家外汇管理局没收违法所得 141.85 万元，罚款 553 万元；因违规经营，于 2023 年 12 月 1 日被国家金融监督管理总局没收违法所得，罚没 570.97 万元。

2) 本集合计划持有的“24 徽商银行 CD095”债券发行主体因违反审慎经营相关规则，于 2023 年 11 月 27 日被国家金融监督管理总局安徽监管局罚款 395 万元，因违反外汇管理规定，于 2023 年 11 月 15 日被中国外汇管理局安徽省分局罚款 47.5 万元。

3) 本集合计划持有的“24 浙商银行 CD089”发行主体因违反审慎经营原则，于 2024 年 2 月 2 日被国家金融监督管理总局浙江监管局罚款 55 万元；

4) 本集合计划持有的“24 中国银行 CD027”发行主体因违反反洗钱法，于 2023 年 11 月 29 日被中国人民银行没收违法所得 37.34 万元，罚款 3664.2 万元；因信息报送异常不及时，于 2023 年 12 月 28 日被国家金融监督管理总局罚款 430 万元。因未依法履行职责，于 2024 年 4 月 3 日被国家外汇管理局北京市分局罚款 40 万元，没收违法所得 0.22 万元。

5) 本集合计划持有的“24 上海银行 CD173”债券发行主体因违反审慎经营规则等，于 2023 年 11 月 15 日被国家金融监管总局上海监管局处以 1380 万元罚款；因违反外规管理条例，于 2023 年 11 月 27 日被国家外汇管理局上海分局处罚款 70 万元，没收违法所得 257.3 万元；因违反审慎经营规则等，于 2023 年 12 月 28 日被国家金融监管总局上海监管局处以 15 万元罚款；因境外机构重大投资事项未经行政许可，于 2024 年 5 月 30 日被国家金融监管总局上海监管局处以 80 万元罚款；

该类情形对上述发行主体没有重大影响，该证券的投资决策程序符合相关法律法规以及产品的要求。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	56,233.92
2	应收证券清算款	393,151,841.63
3	应收利息	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-

6	其他	-
7	合计	393,208,075.55

5.9.4 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，投资组合报告中摊余成本占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	18,236,196,471.20
报告期期间基金总申购份额	103,446,826,358.99
报告期期间基金总赎回份额	102,369,988,990.78
报告期期末基金份额总额	19,313,033,839.41

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内管理人未运用固有资金投资本集合计划。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

- 1) 2024 年 7 月 1 日，关于上海光大证券资产管理有限公司旗下产品估值调整的公告；
- 2) 2024 年 7 月 12 日，关于上海光大证券资产管理有限公司旗下产品估值调整的公告；
- 3) 2024 年 7 月 25 日，光大阳光现金宝货币型集合资产管理计划收益支付公告；
- 4) 2024 年 8 月 2 日，关于上海光大证券资产管理有限公司旗下产品估值调整的公告；
- 5) 2024 年 8 月 27 日，光大阳光现金宝货币型集合资产管理计划收益支付公告；
- 6) 2024 年 9 月 11 日，关于上海光大证券资产管理有限公司旗下产品估值调整的公告。
- 7) 2024 年 9 月 25 日，光大阳光现金宝货币型集合资产管理计划收益支付公告。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予《光大阳光现金宝货币型集合资产管理计划资产管理合同》变更批复的文件；

- 2、《光大阳光现金宝货币型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《光大阳光现金宝货币型集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《光大阳光现金宝货币型集合资产管理计划招募说明书》；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、集合计划管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

备查文件存放于集合计划管理人的办公场所：

- 1、中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层

9.3 查阅方式

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

上海光大证券资产管理有限公司
2024 年 10 月 25 日