

# 光大阳光智造混合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：中国光大银行股份有限公司

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 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	光大阳光智造混合
基金主代码	860018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 6 月 30 日
报告期末基金份额总额	368,254,318.24 份
投资目标	通过深入研究，捕捉宏观环境及政策趋势走向，主要投资于智造相关行业的股票，把握制造业产业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。
投资策略	<p>(一) 资产配置策略</p> <p>本集合计划通过定性与定量研究相结合的方法，确定投资组合中权益类资产和固定收益类资产的配置比例。本集合计划通过动态跟踪海内外主要经济体的 GDP、CPI、利率等宏观经济指标，以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等市场指标，确定未来市场变动趋势。本集合计划通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势，对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。根据上述定性和定量指标的分析结果，运用资产配置优化模型，在目标收益条件下，追求风险最小化目标，最终确定大类资产投资权重，实现资产合理配置。</p> <p>(二) 权益类品种的投资策略</p>

### 1、智造主题的范畴

本集合计划界定的智造主题相关公司指追求高质量发展的过程中，受益于信息化和工业化深度融合，能够提高生产运营效率，提升生活质量，具有工程师红利和一定国际竞争力的制造业。这些行业一般具有技术含量高、创新力强、附加值高、竞争力强、低污染等特点。本集合计划将在智造的定义内选择具有核心技术、高附加值产品、创新研发能力和国际竞争力的行业公司，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。细化到行业分类上，本集合计划投资的行业包括但不限于电子、信息服务、信息设备、机械设备、交运设备、国防军工、计算机、医药、医疗器械、公用事业、化工、金属非金属新材料、新能源等。未来由于经济增长方式转变、产业结构升级、人口红利变化等因素，从事或受益于上述投资主题的外延将会逐渐扩大，管理人按照监管部门要求在履行适当程序后，本集合计划视实际情况对上述界定进行调整和修订。

### 2、股票投资策略

#### (1) 股票组合的构建

本集合计划聚焦智造主题，首先通过行业发展前景及竞争格局考察、公司竞争力分析、公司可持续成长潜力评估及投资吸引力评估等四个层面的综合比较初步筛选出投资备选股票。然后，以全球市场为参照，通过对经济发展阶段、行业发展阶段和前景、公司综合竞争能力的逐层分解，形成对公司的相对估值判断。最后，通过调研、财务分析及量化估值等方法，筛选出质地优良、盈利持续增长、估值具备吸引力和市场预期持续改善的公司构建股票投资组合。

#### (2) 港股通股票投资策略

本集合计划将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。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。

#### (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。

#### (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

	<p>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</p> <p>管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本集合计划的投资目标。本集合计划在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。</p> <p>2、国债期货的投资策略</p> <p>本集合计划投资国债期货以套期保值为目的，国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。管理人通过动态管理国债期货合约数量，以获取相应债券组合的超额收益。</p>		
业绩比较基准	<p>中证高端装备制造指数收益率*60%+中债综合指数收益率*20%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%</p>		
风险收益特征	<p>本集合计划为混合型集合计划，其预期风险和预期收益高于债券型基金、债券型集合计划、货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于股票型基金和股票型集合计划。</p> <p>本集合计划除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内集合计划类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本集合计划还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>		
基金管理人	<p>上海光大证券资产管理有限公司</p>		
基金托管人	<p>中国光大银行股份有限公司</p>		
下属分级基金的基金简称	<p>光大阳光智造混合 A</p>	<p>光大阳光智造混合 B</p>	<p>光大阳光智造混合 C</p>
下属分级基金的交易代码	<p>860018</p>	<p>860038</p>	<p>860039</p>
报告期末下属分级基金的份额总额	<p>12,074,216.19 份</p>	<p>323,417,681.13 份</p>	<p>32,762,420.92 份</p>

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）		
	光大阳光智造混合 A	光大阳光智造混合 B	光大阳光智造混合 C
1. 本期已实现收益	-458,024.02	-5,964,817.67	-604,286.80
2. 本期利润	506,906.12	6,048,646.57	613,156.09
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0418	0.0184	0.0185
4. 期末基金资产净值	14,005,487.41	179,541,611.20	17,891,329.70

5. 期末基金份额净值	1.1600	0.5551	0.5461
-------------	--------	--------	--------

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

光大阳光智造混合 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.81%	2.12%	13.02%	1.41%	-9.21%	0.71%
过去六个月	2.62%	1.69%	14.47%	1.17%	-11.85%	0.52%
过去一年	-6.83%	1.73%	9.44%	1.12%	-16.27%	0.61%
过去三年	-51.21%	1.59%	-15.37%	1.08%	-35.84%	0.51%
自基金合同生效起至今	-43.34%	1.59%	7.45%	1.11%	-50.79%	0.48%

光大阳光智造混合 B

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.80%	2.12%	13.02%	1.41%	-9.22%	0.71%
过去六个月	2.61%	1.69%	14.47%	1.17%	-11.86%	0.52%
过去一年	-6.85%	1.73%	9.44%	1.12%	-16.29%	0.61%
过去三年	-51.21%	1.59%	-15.37%	1.08%	-35.84%	0.51%
自基金合同生效起至今	-43.78%	1.59%	5.86%	1.11%	-49.64%	0.48%

光大阳光智造混合 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

		准差②	收益率③	收益率标准差 ④		
过去三个月	3.70%	2.12%	13.02%	1.41%	-9.32%	0.71%
过去六个月	2.42%	1.69%	14.47%	1.17%	-12.05%	0.52%
过去一年	-7.20%	1.73%	9.44%	1.12%	-16.64%	0.61%
过去三年	-51.79%	1.59%	-15.37%	1.08%	-36.42%	0.51%
自基金合同 生效起至今	-44.74%	1.59%	5.86%	1.11%	-50.60%	0.48%

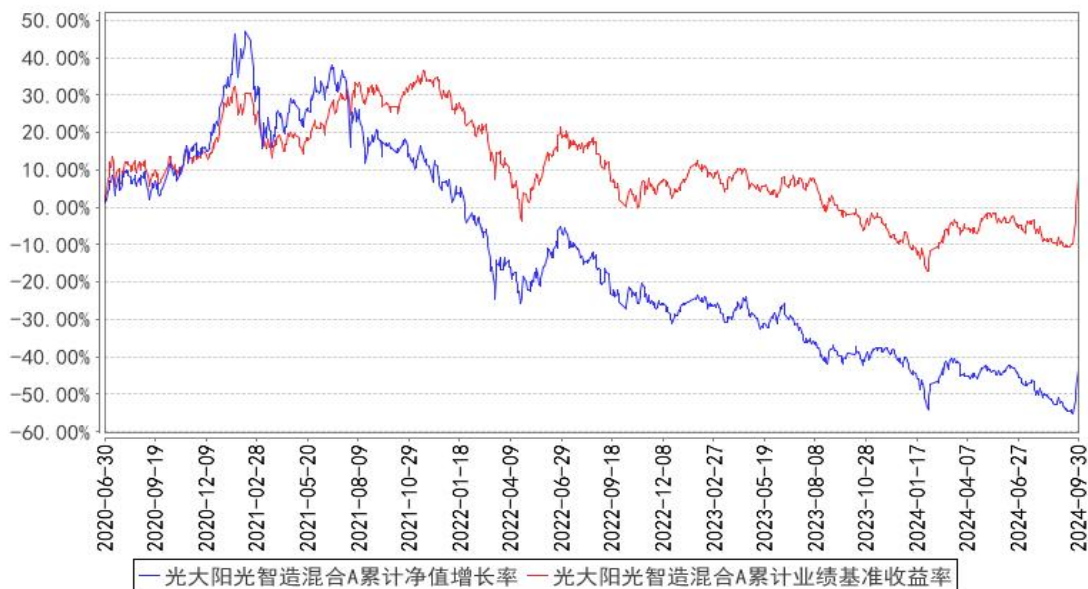
注：1、自基金合同生效起至今指 2020 年 6 月 30 日至 2024 年 9 月 30 日；

2、业绩比较基准为：中证高端装备制造指数收益率×60%+中债综合指数收益率×20%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%

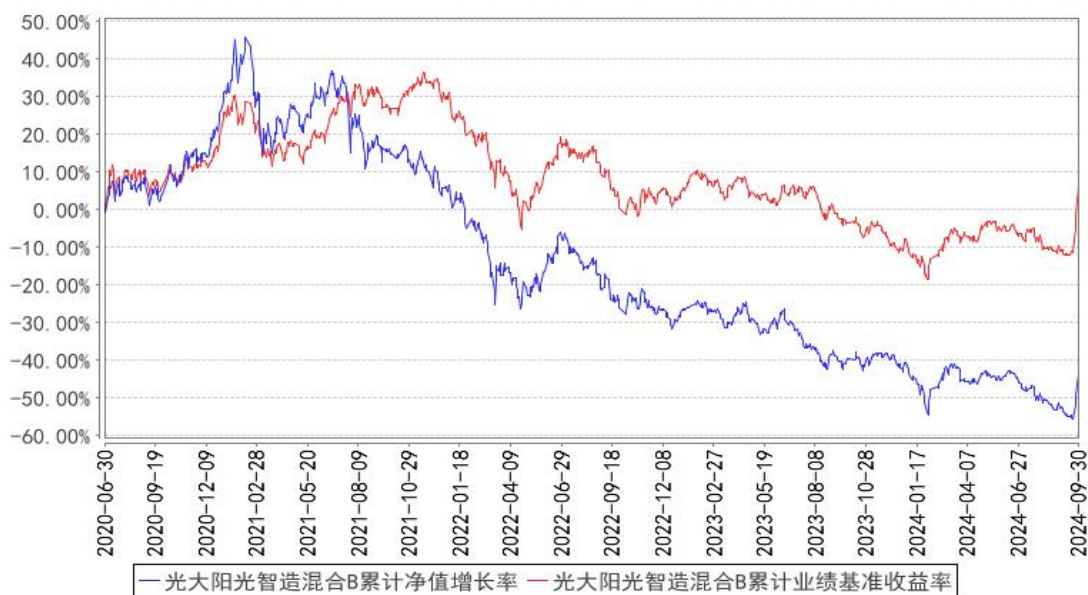
3、B 类份额、C 类份额设立日均为 2020 年 6 月 30 日。

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

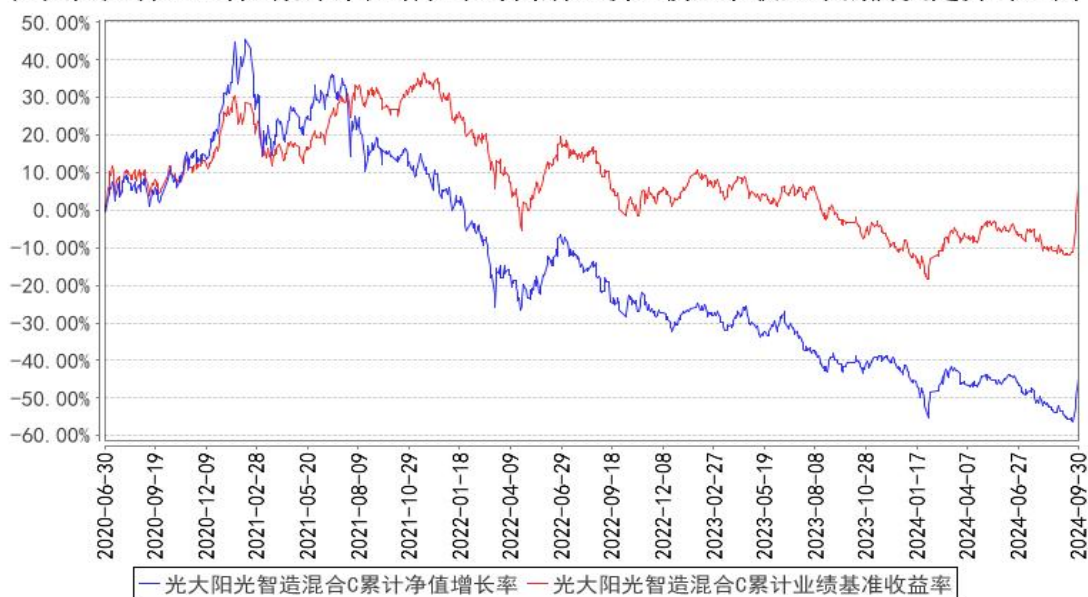
光大阳光智造混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



光大阳光智造混合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



光大阳光智造混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### 3.3 其他指标

无。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李公民	本集合计划投资经理	2022年7月29日	-	19年	李公民先生，南京大学经济学硕士，历任华西证券、招商证券、富国基金、华安基金研究员，平安资产管理有限公司、万家

					基金管理有限公司投资经理, 万家共赢资产管理有限公司证券投资部总监, 2022 年加入上海光大证券资产管理有限公司, 现任权益公募投资部副总经理, 担任光大阳光智造混合型集合资产管理计划投资经理。
饶于晨	本集合计划投资经理	2023 年 12 月 27 日	-	9 年	饶于晨先生, 本科毕业于上海外贸大学, 硕士毕业于德克萨斯大学达拉斯分校, 2015 年加入上海光大证券资产管理有限公司, 历任研究员、投资经理助理, 现任权益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、光大阳光智造混合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“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期;

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

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

本集合计划本报告期末投资经理无兼任私募资产管理计划的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本集合计划存在异常交易行为。报告期内, 未出现涉及本集合计划的交易所



公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度市场波动较大,尤其在央行、证监会等部门发布会后,市场扭转了之前的阴跌走势,出现了大幅上涨。央行、证监会、财政等部门一系列的发布会后,标志着政策开始转向,经济向好的趋势可以预期。

在大幅上行的过程中,我们适当进行了仓位调整,对市场保持积极乐观的态度,积极寻找在经济底部甚至已经出现景气向上方向的行业及公司,这其中包括电子、半导体、机械、家电等,以及布局格局不断优化,竞争力不断加强的消费类公司。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 09 月 30 日,光大阳光智造混合 A 类份额净值为 1.1600 元,本报告期份额净值增长率为 3.81%;光大阳光智造混合 B 类份额净值为 0.5551 元,本报告期份额净值增长率为 3.80%;光大阳光智造混合 C 类份额净值为 0.5461 元,本报告期份额净值增长率为 3.70%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	198,420,149.92	92.15
	其中:股票	198,420,149.92	92.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	96,532.47	0.04
	其中:债券	96,532.47	0.04
	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	15,571,052.85	7.23
8	其他资产	1,232,905.64	0.57
9	合计	215,320,640.88	100.00

注:本集合计划本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 18,717,998.20 元人民币,

占期末集合计划资产净值比例 8.85%。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	6,012,343.00	2.84
C	制造业	170,222,953.50	80.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,504,490.00	1.18
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,465.48	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	460,551.00	0.22
I	信息传输、软件和信息技术服务业	475,638.60	0.22
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	7,213.74	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	13,496.40	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	179,702,151.72	84.99

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	335,519.99	0.16
消费者非必需品	4,948,572.63	2.34
消费者常用品	3,452,340.69	1.63
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	6,523,236.30	3.09
工业	1,414,728.16	0.67
信息技术	-	-
电信服务	1,844,304.84	0.87
公用事业	199,295.59	0.09
房地产	-	-

合计	18,717,998.20	8.85
----	---------------	------

注：以上行业分类采用港交所二级分类标准。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688596	正帆科技	478,025	16,467,961.25	7.79
2	688120	华海清科	93,818	15,186,319.66	7.18
3	688072	拓荆科技	96,204	13,853,376.00	6.55
4	603605	珀莱雅	118,060	12,997,225.40	6.15
5	688012	中微公司	78,805	12,924,020.00	6.11
6	002126	银轮股份	659,200	12,854,400.00	6.08
7	002371	北方华创	33,700	12,333,526.00	5.83
8	000157	中联重科	1,415,300	10,727,974.00	5.07
9	300014	亿纬锂能	198,100	9,663,318.00	4.57
10	000333	美的集团	107,200	8,153,632.00	3.86

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

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（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	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	96,532.47	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	96,532.47	0.05

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113653	永 22 转债	1,000	96,532.47	0.05

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

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

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

本集合计划本报告期末未持有贵金属。

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

本集合计划本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末未进行股指期货投资。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

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

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本集合计划本报告期末未持有国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

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

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

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本集合计划投资的前十名股票未超出集合计划合同规定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	88,553.96
2	应收证券清算款	939,327.82
3	应收股利	28,743.20
4	应收利息	-
5	应收申购款	176,000.66
6	其他应收款	280.00
7	其他	-
8	合计	1,232,905.64

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113653	永 22 转债	96,532.47	0.05

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

集合计划本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	光大阳光智造混合 A	光大阳光智造混合 B	光大阳光智造混合 C
报告期期初基金份额总额	12,211,401.43	334,495,224.38	33,271,629.77
报告期期间基金总申购份额	-	562,063.55	196,466.14
减：报告期期间基金总赎回份额	137,185.24	11,639,606.80	705,674.99
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
报告期期末基金份额总额	12,074,216.19	323,417,681.13	32,762,420.92

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	光大阳光智造混合 A	光大阳光智造混合 B	光大阳光智造混合 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	25,810,031.83	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-	-

报告期期间卖出/赎回总份额	-	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	25,810,031.83	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	-	7.01	-

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内集合计划管理人未新增固有资金投资本集合计划。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

- 1) 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 31 日, 关于旗下光大阳光智造混合型集合资产管理计划 2024 年港股通非交易日暂停开放公告;
- 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 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;

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予《光大阳光智造混合型集合资产管理计划资产管理合同》变更批复的文件;
- 2、《光大阳光智造混合型集合资产管理计划资产管理合同》;
- 3、《光大阳光智造混合型集合资产管理计划托管协议》;
- 4、《光大阳光智造混合型集合资产管理计划招募说明书》;
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告;
- 6、集合计划管理人业务资格批件、营业执照;
- 7、中国证监会要求的其他文件

### 9.2 存放地点

备查文件存放于集合计划管理人的办公场所：

1、中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层

### 9.3 查阅方式

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

上海光大证券资产管理有限公司

2024 年 10 月 25 日