

光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券型集
合资产管理计划
2024 年第 4 季度报告

2024 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：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：2025 年 1 月 22 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 01 月 21 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 10 月 01 日起至 2024 年 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	光大阳光北斗星 180 天滚动
基金主代码	860051
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 8 月 30 日
报告期末基金份额总额	24,159,949.67 份
投资目标	本集合计划主要投资于债券为主的固定收益类产品，并在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过对不同资产类别的优化配置，充分挖掘市场潜在的投资机会，力求实现集合计划资产的长期稳健增值。
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。同时结合新股申购、权益类资产投资等，在严格控制投资风险、保持资产流动性的前提下，争取获得相对较高的资产组合投资收益水平。</p> <p>2、固定收益类品种投资策略</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</p>

	<p>全性与收益性的统一。</p> <p>3、权益类品种的投资策略</p> <p>(1) 新股申购策略</p> <p>本集合计划通过对新股的分析，参考同类公司的估值水平，判断一、二级市场价差的大小，并根据过往新股的中签率及上市后股价涨幅的统计，对新股投资的收益率进行预测，同时综合考虑锁定期间的投资风险以及资金成本，制定新股申购策略。</p> <p>(2) 股票二级市场的投资策略</p> <p>本集合计划采取自上而下的行业配置与自下而上的个股选择相结合的股票二级市场投资策略。在行业配置方面，除通过对包括产业政策、行业成长性、市场竞争、行业估值等方面进行深入研究以外，根据公司盈利的持续性、稳定性、增长性以及资本回报率调整和修正折溢价，寻找合适的个股。</p> <p>4、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> <p>5、国债期货投资策略</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	<p>沪深 300 指数收益率×5%+中债综合指数收益率×90%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%</p>
风险收益特征	<p>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。</p> <p>本集合计划可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本集合计划还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。</p>
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
下属分级基金的基金简称	光大阳光北斗星 180 天滚动 A 光大阳光北斗星 180 天滚动 C
下属分级基金的交易代码	865040 860051
报告期末下属分级基金的份额总额	8,591,688.11 份 15,568,261.56 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。

§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 10 月 1 日-2024 年 12 月 31 日）	
	光大阳光北斗星 180 天滚动 A	光大阳光北斗星 180 天滚动 C
1. 本期已实现收益	642,896.79	1,132,396.96
2. 本期利润	204,282.18	346,330.18
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0238	0.0222
4. 期末基金资产净值	14,698,997.19	26,340,212.68
5. 期末基金份额净值	1.7108	1.6919

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

光大阳光北斗星 180 天滚动 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	1.40%	0.31%	1.90%	0.15%	-0.50%	0.16%
过去六个月	3.36%	0.29%	3.62%	0.13%	-0.26%	0.16%
过去一年	2.65%	0.29%	6.32%	0.12%	-3.67%	0.17%
过去三年	3.99%	0.23%	5.91%	0.12%	-1.92%	0.11%
自基金合同 生效起至今	2.13%	0.26%	6.01%	0.12%	-3.88%	0.14%

光大阳光北斗星 180 天滚动 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	①-③	②-④
----	--------	---------------	----------------	------------------	-----	-----

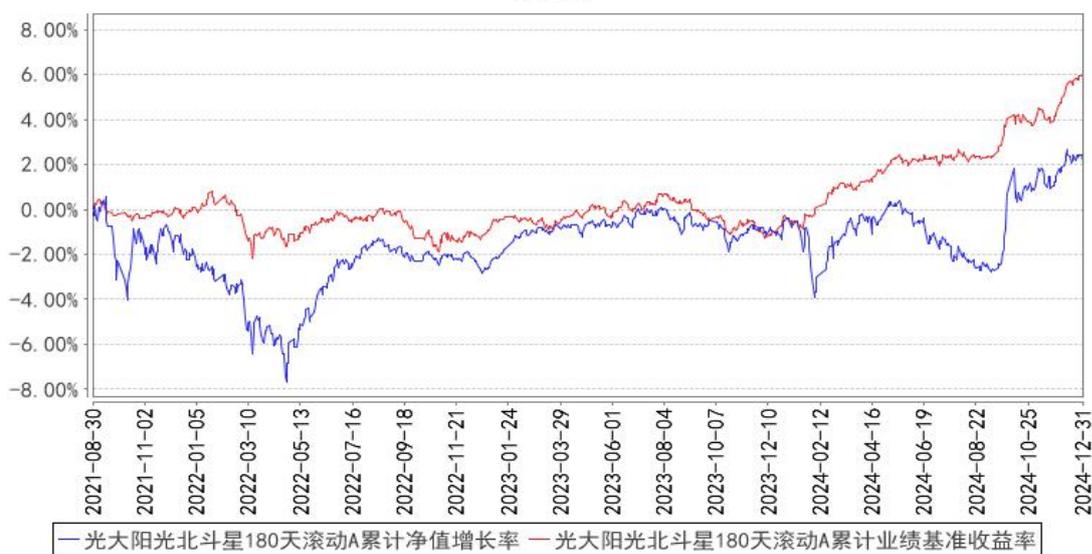
				④		
过去三个月	1.33%	0.31%	1.90%	0.15%	-0.57%	0.16%
过去六个月	3.21%	0.29%	3.62%	0.13%	-0.41%	0.16%
过去一年	2.35%	0.29%	6.32%	0.12%	-3.97%	0.17%
过去三年	3.06%	0.23%	5.91%	0.12%	-2.85%	0.11%
自基金合同生效起至今	1.12%	0.26%	6.01%	0.12%	-4.89%	0.14%

注：1、自基金合同生效起至今指 2021 年 8 月 30 日至 2024 年 12 月 31 日；

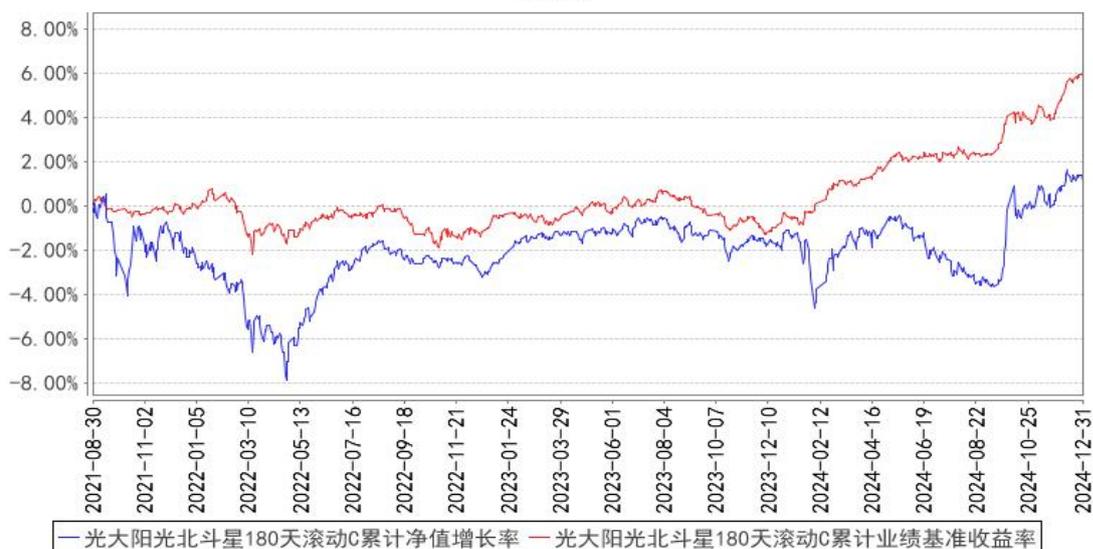
2、业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×5%+中债综合指数收益率×90%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%

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

光大阳光北斗星 180 天滚动 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



光大阳光北斗星180天滚动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		
张丁	本集合计划投资经理	2021年8月30日	-	17年	张丁先生，硕士学历。先后担任九富投资顾问有限公司研究员、中诚信国际信用评级有限责任公司信用评级部总经理助理、招商证券股份有限公司研究发展中心债券研究员、华商基金管理有限公司研究部债券研究员、中国国际金融股份有限公司资产管理部债券投资经理。2017年加入光证资管，现任公司副总经理，担任光大阳光添利债券型集合资产管理计划、光大阳光北斗星 180 天持有债券型集合资产管理计划、光大阳光北斗星 9 个月持有期债券型集合资产管理计划投资经理。
陈韵聘	本集合计划投资经理	2022年10月20日	-	14年	陈韵聘先生，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

					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。
--	--	--	--	--	---------------------------------------

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。

4.1.1 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

债市方面，尽管 10-12 月 PMI 连续三个月处在荣枯线以上，地产销售也有所改善，显示国内总需求改善效果较为明显，且出口“抢订单”的状况仍在持续；但物价指数仍然较为低迷，工业品价格持续偏弱，PPI 同比预计因低基数而回升但幅度有限，四季度通缩压力略有缓解但总体仍旧低迷，企业部门加杠杆意愿匮乏，社融同比数据依旧较低，若要改变经济运行趋势，仍需要财政政策加大力度。但从近期政策动作来看，政治局会议与中央经济工作会议更多强调货币政策，而财政政策的“更加积极”，上调狭义赤字率的幅度大概率在市场预期之内，财政政策的不确定

性有所降低。美国近期就业数据保持韧性，美联储在 12 月降息继续鹰派降息 25bp 后，通胀持续粘性，因总统任期交接、相关政策预期变化引发的再通胀交易仍显著，降息预期压缩到极致，美债利率也极限走高，离岸人民币汇率快速突破 7.3，国内货币政策“适度宽松”的大方向已经明确，但在具体节奏方面，仍会面临一些外部扰动，降准的拖延就是例证。尽管 9 月开始稳增长的政策态度较为明确，但在弱现实的情况下，四季度债市仍然以收益率下行为主，12 月以来利率下行幅度较大。我们继续保持多头思维，但随着收益率的较快下行透支了部分降息预期，我们将择机调整久期，灵活应对。

展望 2025 年，由于当前经济基本面偏弱已是市场共识，内生需求不足、产能过剩等“内忧”问题尚待解决，贸易战等“外患”挑战接踵而至，如何走出价格预期-需求偏弱的通缩螺旋应是当前政策的着力点，但目前已出台的财政政策重在解决化债和供给侧问题，对需求端刺激较温和，经济仍处于弱修复过程中；相比托底的财政政策，支持性货币政策是当前债市最为确定的博弈方向，债牛基础仍在，支撑债市在岁末年初走出快牛行情。不过，尽管债市行情仍可持续，但目前收益率水平已隐含 30bp 以上的降息预期，短期或面临一定波折。

股市方面，在积极的政策刺激下，十月市场冲高回落，之后企稳小幅上行。风格角度来看，小微盘股大幅反弹修复前三个季度的负向超额，而前期强势的大盘股和红利风格则表现疲软，四季度股价有小幅回撤。行业也同样被高风险偏好所主导，高弹性的 TMT、军工、汽车涨幅显著。

12 月 9 日政治局会议提出 2025 年要实施适度宽松的货币政策，这是十几年来首次非“稳健”的货币政策导向定性。明确的政策导向将对市场产生实质的托底作用，我们认为 2025 年不会有系统性下跌的空间。而具体的市场路径，将是市场博弈与宏观趋势交替作用的结果。

从宏观面，尽管制造业景气度略有回落，但 12 月 PMI 指标积极因素仍然较多。制造业需求继续改善，非制造业则全面修复。此前数月非制造业景气度始终偏低，本月则迎来建筑业与服务业的大幅度反转，表明前期政策在需求端落地生根。但经济结构性问题仍然存在，企业信心偏弱，且通胀迟迟无法回升，25 年有望看到进一步的需求刺激政策。

从市场面，九月底以来的反弹吸引大量投资者进场，A 股持续保持 1.5 万亿以上的日成交，大幅高于历史水平。陡增的风险偏好主导了相当多股票的重新定价，但是也必然会出现定价偏差。即将发布的上市公司业绩预告将产生今年行业景气程度的锚定效应，对于主力资金的流向和个股的估值调整产生影响。

短期内，我们将以公司业绩为基础，回归基本面驱动的策略主题。中期以上，我们认为 A 股 beta 是性价比优秀的资产，适度的风险偏好提升有利于提升产品的收益水平。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 12 月 31 日，光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券型集合资产管理计划 A 类份额净值为 1.7108 元，本报告期份额净值增长率为 1.4%；光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券型集合资产管理计划 C 类份额净值为 1.6919 元，本报告期份额净值增长率为 1.33%。

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 2024 年 8 月 22 日起至 12 月 31 日集合计划资产净值低于五千万元，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	5,314,764.00	11.02
	其中：股票	5,314,764.00	11.02
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	37,492,779.78	77.72
	其中：债券	37,492,779.78	77.72
	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	3,825,220.07	7.93
8	其他资产	1,606,825.42	3.33
9	合计	48,239,589.27	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	155,508.00	0.38
B	采矿业	287,786.00	0.70
C	制造业	3,151,727.00	7.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	267,856.00	0.65
E	建筑业	65,856.00	0.16
F	批发和零售业	41,850.00	0.10

G	交通运输、仓储和邮政业	392,846.00	0.96
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	133,446.00	0.33
J	金融业	649,750.00	1.58
K	房地产业	58,420.00	0.14
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	42,840.00	0.10
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	31,212.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	35,667.00	0.09
S	综合	-	-
	合计	5,314,764.00	12.95

5.2.2 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。

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	601877	正泰电器	5,500	128,755.00	0.31
2	601919	中远海控	7,700	119,350.00	0.29
3	002142	宁波银行	4,700	114,257.00	0.28
4	600295	鄂尔多斯	10,900	106,384.00	0.26
5	002557	洽洽食品	3,600	104,580.00	0.25
6	603167	渤海轮渡	11,400	100,776.00	0.25
7	002546	新联电子	23,000	99,590.00	0.24
8	002714	牧原股份	2,500	96,100.00	0.23
9	603998	方盛制药	9,000	93,780.00	0.23
10	002273	水晶光电	4,200	93,324.00	0.23

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	35,171,269.05	85.70
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）	2,321,510.73	5.66
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	37,492,779.78	91.36

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	019740	24 国债 09	40,000	4,050,535.89	9.87
2	019749	24 国债 15	40,000	4,031,046.58	9.82
3	019739	24 国债 08	35,000	3,647,906.16	8.89
4	019741	24 国债 10	35,000	3,599,428.77	8.77
5	019736	24 国债 05	35,000	3,593,520.00	8.76

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投资。

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投资。

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持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本集合计划投资范围中不包括股指期货。

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。

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持仓。

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持仓。

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	12,159.38
2	应收证券清算款	1,594,666.04
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,606,825.42

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	110064	建工转债	127,597.89	0.31
2	123149	通裕转债	127,199.59	0.31
3	127017	万青转债	127,123.10	0.31
4	110095	双良转债	125,599.60	0.31
5	113545	金能转债	118,784.93	0.29
6	113641	华友转债	93,429.97	0.23
7	113052	兴业转债	86,899.46	0.21
8	113058	友发转债	86,894.73	0.21
9	127049	希望转 2	86,816.18	0.21
10	127016	鲁泰转债	86,609.88	0.21
11	123104	卫宁转债	86,417.19	0.21
12	128130	景兴转债	86,380.18	0.21
13	110070	凌钢转债	86,132.99	0.21
14	127015	希望转债	86,079.19	0.21

15	127070	大中转债	85,398.60	0.21
16	113647	禾丰转债	84,973.10	0.21
17	127054	双箭转债	84,599.38	0.21
18	123091	长海转债	82,524.44	0.20
19	110081	闻泰转债	43,257.74	0.11
20	113532	海环转债	41,836.31	0.10
21	113542	好客转债	41,617.86	0.10
22	127025	冀东转债	41,028.15	0.10
23	127030	盛虹转债	41,013.39	0.10
24	123161	强联转债	40,774.90	0.10
25	113046	金田转债	40,757.65	0.10
26	113579	健友转债	40,395.91	0.10
27	118013	道通转债	40,364.46	0.10
28	123145	药石转债	40,326.03	0.10
29	113061	拓普转债	40,177.56	0.10
30	127082	亚科转债	40,029.30	0.10
31	113068	金铜转债	39,920.18	0.10
32	118030	睿创转债	23,733.79	0.06
33	127018	本钢转债	16,817.10	0.04

5.11.5 报告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的情况。

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	光大阳光北斗星 180 天滚动 A	光大阳光北斗星 180 天滚动 C
报告期期初基金份额总额	8,596,167.69	15,568,447.10
报告期期间基金总申购份额	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	4,479.58	185.54
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	8,591,688.11	15,568,261.56

§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

本报告期内集合计划管理人未持有本集合计划份额。

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 11 月 8 日，关于解聘投资经理助理的公告；
- 2) 2024 年 11 月 14 日，关于聘任投资经理助理的公告。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予《光大阳光北斗星 180 天滚动持有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、《光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《光大阳光北斗星 180 天滚动持有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。

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

2025 年 1 月 22 日