# 阳光青睿盈全球价值日开 2 号（360 天最低持有）
# 2026 年三季度报告

光大理财有限责任公司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、准确性和完整性负责。本报告披露的相关净值数据已由理财产品托管人复核。光大理财有限责任公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用产品资产，但不保证产品本金及收益。**理财产品过往业绩不代表其未来表现，不等于理财产品实际收益。理财非存款，产品有风险，投资须谨慎。**

产品管理人：光大理财有限责任公司

产品托管人：中国光大银行股份有限公司

报告期：2026 年 7 月 1 日至 2026 年 9 月 30 日

# 第一章　产品基本信息

| | | |
|---|---|---|
| 产品登记编码 | Z7001425001308<br>（可在中国理财网 www.chinawealth.com.cn 查询产品信息） | |
| 产品名称 | 阳光青睿盈全球价值日开 2 号（360 天最低持有） | |
| 产品代码 | EW5012 | |
| 分级安排（如有） | - | |
| 产品募集方式 | 公募 | |
| 募集币种 | 人民币 | |
| 产品运作模式 | 开放式净值型 | |
| 产品投资性质 | 固定收益类 | |
| 产品风险等级 | 二星级(中低风险)<br>（该等级为理财产品发行机构评定结果，该产品通过代理销售机构渠道销售的，理财产品评级应当以代理销售机构最终披露的评级结果为准） | |
| 产品成立日期 | 2025 年 8 月 19 日 | |
| 产品终止日期 | 持续运作 | |
| 报告期末产品总份额 | 1,289,755,226.79 | |
| 报告期末产品份额 | 份额代码（如有） | 产品份额 |
| | EW5012A | 1,268,735,240.57 |
| | EW5012H | 20,038,914.88 |
| | EW5012I | 970,214.42 |
| | EW5012K | 10,856.92 |
| 报告期末穿透后杠杆率 | 103.43% | |

# 第二章　收益表现

## 2.1 产品净值表现

金额单位：元

| 份额代码（如有） | 首个非零份额日 | 时点指标：报告期末 | | | 区间指标：报告期 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 份额净值 | 份额累计净值 | 资产净值 | 涨跌幅（%） | 年化收益率（%） |
| EW5012A | 2025 年 8 月 19 | 1.0337 | 1.0337 | 1,311,481, | 0.16<br>2026 年 7 月 1 日 | 0.65<br>2026 年 7 月 1 日 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 日 | | | 097.54 | -2026 年 9 月 30 日 | -2026 年 9 月 30 日 |
| EW5012H | 2026 年 3 月 30 日 | 1.0318 | 1.0318 | 20,677,050.11 | 0.12<br>2026 年 7 月 1 日<br>-2026 年 9 月 30 日 | 0.46<br>2026 年 7 月 1 日<br>-2026 年 9 月 30 日 |
| EW5012I | 2026 年 3 月 16 日 | 1.0348 | 1.0348 | 1,003,991.42 | 0.17<br>2026 年 7 月 1 日<br>-2026 年 9 月 30 日 | 0.69<br>2026 年 7 月 1 日<br>-2026 年 9 月 30 日 |
| EW5012K | 2026 年 5 月 15 日 | 1.0318 | 1.0318 | 11,202.68 | 0.11<br>2026 年 7 月 1 日<br>-2026 年 9 月 30 日 | 0.42<br>2026 年 7 月 1 日<br>-2026 年 9 月 30 日 |

注：1、本产品报告期收益表现（涨跌幅及年化收益率）由理财公司计算并确认，相关净值数据已由产品托管人核对。

2、首个非零份额日至本报告期末不足一个月的份额可以不披露报告期收益表现(涨跌幅及年化收益率）。

3、根据产品说明书，因理财产品发行对象不同，或有不同的份额及份额代码，不同份额之间可能存在销售服务费收费条件、收费标准和收费方式等的不同，以及因计算过程产生尾差等原因，均可能导致各份额份额净值、份额累计净值不完全一致。

4、区间涨跌幅及年化收益率计算公式如下：

涨跌幅=（期末累计净值-区间起始日日初累计净值）/区间起始日日初单位净值；

年化收益率=（期末累计净值-区间起始日日初累计净值）/区间起始日日初单位净值/区间天数*365；

其中，区间起始日为本报告期期初日与首个非零份额日孰晚之日；区间天数为区间起始日（含）至报告期末日（含）累计运作天数；计算结果采用四舍五入方式展示。

## 2.2 报告期内产品收益分配

金额单位：元

| 份额代码（如有） | 报告期内每单位份额累计分红金额 |
|---|---|
| - | - |

注：以上累计分红金额根据除权日在本报告期内的分红记录统计；累计分红金额为四舍五入后数值，投资者应以实际分红为准。

## 2.3 产品业绩比较基准历次调整情况

| 份额代码（如有） | 生效日期 | 业绩比较基准 |
|---|---|---|
| EW5012A | 2026 年 08 月 25 日至 | 中债-新综合全价（1 年以下）指数 |

| | | |
|---|---|---|
| | 今 | *98.5%+中证 800 指数*1%+上海黄金交易所黄金现货实盘合约 Au9999 价格收益率*0.5% |
| EW5012A | 2026 年 01 月 01 日-2026 年 08 月 24 日 | 1.50%-3.70% |
| EW5012H | 2026 年 08 月 25 日至今 | 中债-新综合全价（1 年以下）指数*98.5%+中证 800 指数*1%+上海黄金交易所黄金现货实盘合约 Au9999 价格收益率*0.5% |
| EW5012H | 2026 年 03 月 30 日-2026 年 08 月 24 日 | 1.35%-3.55% |
| EW5012I | 2026 年 08 月 25 日至今 | 中债-新综合全价（1 年以下）指数*98.5%+中证 800 指数*1%+上海黄金交易所黄金现货实盘合约 Au9999 价格收益率*0.5% |
| EW5012I | 2026 年 03 月 16 日-2026 年 08 月 24 日 | 1.50%-3.70% |
| EW5012K | 2026 年 08 月 25 日至今 | 中债-新综合全价（1 年以下）指数*98.5%+中证 800 指数*1%+上海黄金交易所黄金现货实盘合约 Au9999 价格收益率*0.5% |
| EW5012K | 2026 年 05 月 15 日-2026 年 08 月 24 日 | 1.30%-3.50% |

注：1、业绩比较基准不是预期收益率，不代表产品的未来表现和实际收益，不构成对产品收益的承诺。

2、本报告仅披露 2026 年起生效的历次业绩比较基准。

# 第三章 管理人报告

## 3.1 报告期内投资策略和运作分析

三季度全球大类资产表现分化。国内权益出现回调，中证 1000 下跌约 17%，黄金前高后低，季度上涨约 3%，但 9 月回吐部分涨幅。债券市场在经济修复斜率平缓、货币环境偏松的组合下相对稳健，10 年期国债收益率下行 5BP，债市在低利率环境下仍具有一定配置支撑，资金面保持平稳。海外方面，通胀与就业数据的韧性使主要央行维持偏高利率环境，美元与实际利率走势仍是影响全球权益与贵金属估值空间的主要变量。

海外高利率环境与美元走势仍是影响全球资产定价的主要变量，长端利率能否企稳

将直接决定权益与黄金的估值空间。配置上延续保守思路：权益整体仓位保持克制，以优质权益资产和指数增强工具参与；黄金继续以备兑策略稳健参与；通过股票中性、CTA、多资产组合等低相关性策略分散单一方向波动；组合基于风险预算动态再平衡，以固收票息为收益基石，追求净值平稳。

# 第四章 资产持仓与交易信息

## 4.1 报告期末持有资产情况

金额单位：元

| 序号 | 资产分类 | 穿透前 | 穿透后 |
|---|---|---|---|
| | | 占产品总资产的比例（%） | 占产品总资产的比例（%） |
| 1 | 现金及银行存款 | 6.01 | 17.96 |
| 2 | 同业存单 | 0.00 | 1.16 |
| 3 | 拆放同业及债券买入返售 | 0.00 | 0.28 |
| 4 | 债券 | 5.33 | 61.11 |
| 5 | 非标准化债权类资产 | 0.00 | 0.00 |
| 6 | 权益类资产 | 0.00 | 1.75 |
| 7 | 金融衍生品 | 0.00 | -0.09 |
| 8 | 境外资产 | 0.00 | 0.38 |
| 9 | 商品类资产 | 0.00 | 0.00 |
| 10 | 另类资产 | 0.00 | 0.00 |
| 11 | 公募基金 | 0.00 | 17.44 |
| 12 | 私募基金 | 0.00 | 0.00 |
| 13 | 资产管理产品 | 88.66 | 0.00 |
| 14 | 委外投资——协议方式 | 0.00 | 0.00 |
| 15 | 其他资产 | 0.00 | 0.00 |
| 16 | 合计 | 100.00 | 100.00 |

注：1、资产分类及统计口径与国家金融监管总局G06a非保本理财业务月度统计表保持一致。

2、占总资产的比例=各类资产持有金额/产品总资产*100%（其中穿透前占产品总资产的比例分母使用穿透前总资产，穿透后占产品总资产的比例分母使用穿透后总资产）。

3、由于四舍五入的原因，金额占产品总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

## 4.2 报告期末持有前十项资产情况（穿透前）

金额单位：元

| 序号 | 资产名称 | 持有金额 | 占净资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 建信信托-光鑫策略 36 号集合资金信托计划 | 190,557,506.63 | 14.29 |
| 2 | 陆家嘴信托-光诚 1 号集合资金信托计划 | 117,343,268.31 | 8.80 |
| 3 | 华润信托-光耀 2 号 | 107,265,734.32 | 8.05 |
| 4 | 华润信托-光耀 27 号 | 99,479,871.98 | 7.46 |
| 5 | 华润信托-光耀 39 号 | 98,253,128.49 | 7.37 |
| 6 | 华润信托-光耀 33 号 | 86,073,568.94 | 6.46 |
| 7 | 陆家嘴信托-光诚 6 号集合资金信托计划 | 80,545,591.45 | 6.04 |
| 8 | 现金及活期存款 | 80,197,435.38 | 6.02 |
| 9 | 华润信托-光耀 37 号 | 51,716,266.28 | 3.88 |
| 10 | 建信信托-光鑫策略 42 号集合资金信托计划 | 50,144,146.07 | 3.76 |

注：1、其中现金及活期存款、股东银行存款、股东银行之外的其他银行存款、股东银行发行的大额存单、股东银行之外的其他银行发行的大额存单、拆放同业、债券买入返售类资产、其他资产（资产分类按国家金融监管总局 G06a 非保本理财业务月度统计表口径）分别合并披露，其他相同代码资产可合并披露。

2、占净资产的比例合计可能超过 100%，但最高不超过杠杆率。

3、占净资产的比例=各项资产持有金额/产品净资产*100%。

## 4.3 报告期末持有前十项资产情况（穿透后）

金额单位：元

| 序号 | 资产名称 | 持有金额 | 占净资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 现金及活期存款 | 246,120,482.64 | 18.46 |
| 2 | 24 珠高 K1 | 31,486,375.49 | 2.36 |
| 3 | 26 象港 01 | 20,430,520.55 | 1.53 |
| 4 | 易方达优选投资级信用指数发起式 A | 11,233,023.36 | 0.84 |
| 5 | 汇添富投资级信用债指数 A | 10,685,083.35 | 0.80 |
| 6 | 25 常投 05 | 10,274,635.62 | 0.77 |
| 7 | 兴银中债优选投资级 | 10,247,145.55 | 0.77 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 信用债指数 A | | |
| 8 | 22 晋纾 01 | 10,218,591.08 | 0.77 |
| 9 | 天弘中债投资级公司信用债精选指数发起 A | 8,082,144.07 | 0.61 |
| 10 | 鹏华中债-0-3 年 AA+优选信用债指数 D | 7,680,647.76 | 0.58 |

注：1、其中现金及活期存款、股东银行存款、股东银行之外的其他银行存款、股东银行发行的大额存单、股东银行之外的其他银行发行的大额存单、拆放同业、债券买入返售类资产、其他资产（资产分类按国家金融监管总局 G06a 非保本理财业务月度统计表口径）分别合并披露，其他相同代码资产可合并披露。

2、占净资产的比例合计可能超过 100%，但最高不超过杠杆率。

3、占净资产的比例=各项资产持有金额/产品净资产*100%。

## 4.4 报告期内投资关联方发行的证券的情况

金额单位：元

| 关联方名称 | 证券简称 | 关联交易金额 |
|---|---|---|
| 中国太平洋人寿保险股份有限公司 | 24 太保寿险永续债 01 | 2,197,430.55 |
| 申万宏源证券有限公司 | 22 申证 Y1 | 1,008,845.98 |
| 中信银行股份有限公司 | 24 中信银行永续债 01 | 850,629.98 |
| 中信建投证券股份有限公司 | 22 信投 Y3 | 736,672.36 |
| 东方证券股份有限公司 | 23 东证 C3 | 662,685.09 |
| 中信银行股份有限公司 | 23 中信银行二级资本债 01A | 508,219.27 |
| 招商证券股份有限公司 | 22 招证 Y2 | 494,328.19 |
| 华电融资租赁有限公司 | G26 华租 1 | 493,788.71 |
| 光大金融租赁股份有限公司 | 23 光大租赁债 | 377,908.83 |
| 中国信达资产管理股份有限公司 | 22 中国信达债 01 | 246,096.84 |
| 中信银行股份有限公司 | 23 中信银行二级资本债 01B | 210,801.45 |
| 中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司 | 24 海运集装 MTN002(科创票据) | 157,039.70 |
| 光大金瓯资产管理有限公司 | 25 金瓯 Y1 | 93,096.68 |
| 中信证券股份有限公司 | 中信证券 | 83,170.50 |
| 中国太平洋保险(集团)股份有限公司 | 中国太保 | 68,640.66 |
| 中远海运控股股份有限公司 | 中远海控 | 48,960.21 |
| 江苏恒瑞医药股份有限公司 | 恒瑞医药 | 36,541.20 |

| | | |
|---|---|---|
| 中国光大银行股份有限公司 | 光大银行 | 34,119.72 |
| 中信重工机械股份有限公司 | 中信重工 | 23,116.50 |
| 中信建投证券股份有限公司 | 中信建投 | 23,015.32 |
| 中远海运能源运输股份有限公司 | 中远海能 | 21,036.86 |

注：1、以上披露口径以国家金融监督管理总局关联交易监管要求口径填列。

## 4.5 报告期内投资关联方承销期内承销的证券情况

金额单位：元

| 关联方名称 | 证券简称 | 关联交易金额 |
|---|---|---|
| 中信建投证券股份有限公司 | 26 中行永续债 02BC | 1,444,304.94 |
| 中信建投证券股份有限公司 | 26 广安 06 | 1,059,801.13 |
| 中信证券股份有限公司 | 26 国券 C1 | 709,138.53 |
| 东方证券股份有限公司 | 26 浙商银行永续债 01BC | 678,174.68 |
| 东方证券股份有限公司 | 26 鲁铁 06 | 639,521.59 |
| 中信建投证券股份有限公司 | 26 工行永续债 04BC | 563,233.70 |
| 中信建投证券股份有限公司 | 26 拱城 06 | 488,432.73 |
| 中信建投证券股份有限公司 | 26 漳州交通 MTN002 | 485,969.88 |
| 中信建投证券股份有限公司 | 26 穗高 Y2 | 472,236.76 |
| 中信建投证券股份有限公司 | 26 北京银行永续债 02 | 405,174.97 |
| 中信建投证券股份有限公司 | 26 临交 01 | 395,837.83 |
| 中信银行股份有限公司 | 26 台州交通 PPN003 | 386,923.63 |
| 中信证券股份有限公司 | 26 扬帆 2 号 ABN001 优先 A | 374,687.68 |
| 中国光大银行股份有限公司 | 26 恒信 10 号 ABN001 优先 A | 373,894.26 |
| 光大证券股份有限公司 | G26 华租 1 | 344,214.01 |
| 中信证券股份有限公司 | 26 建行永续债 02BC | 203,240.77 |
| 中信建投证券股份有限公司 | 长鑫科技 | 19,155.69 |
| 招商证券股份有限公司 | 长鑫科技 | 19,155.69 |
| 中信证券股份有限公司 | 宇树科技 | 4,115.10 |
| 中信证券股份有限公司 | 燧原科技 | 3,455.75 |
| 中信建投证券股份有限公司 | 频准激光 | 859.31 |
| 东方证券股份有限公司 | 乔路铭 | 258.53 |
| 中信建投证券股份有限公司 | 龙鑫智能 | 107.00 |
| 中信证券股份有限公司 | 马矿股份 | 95.71 |
| 中信建投证券股份有限公司 | 金钛股份 | 40.80 |

| | | |
|---|---|---|
| 中信证券股份有限公司 | 南方乳业 | 30.30 |
| 中信建投证券股份有限公司 | 华大海天 | 12.24 |
| 中信建投证券股份有限公司 | 聚仁新材 | 9.93 |
| 东方证券股份有限公司 | 世纪数码 | 8.35 |

注：1、以上披露口径以国家金融监督管理总局关联交易监管要求口径填列。

## 4.6 报告期内投资关联方发行的资产管理产品情况

金额单位：元

| 关联方名称 | 资产管理产品名称 | 关联交易金额 |
|---|---|---|
| 光大期货有限公司 | 光大期货新曜 1 号集合资产管理计划 | 2,926.75 |
| 上海光大证券资产管理有限公司 | 光证资管致诚 26 号集合资产管理计划 | 2,827.98 |
| 光大永明资产管理股份有限公司 | 光大永明资产聚优稳鑫 12 号混合类 | 1,952.85 |
| 上海光大证券资产管理有限公司 | 光证资管诚享 66 号集合资产管理计划 | 1,537.85 |
| 光大期货有限公司 | 光大期货光芒 19 号集合资产管理计划 | 1,374.58 |
| 光大期货有限公司 | 光大期货光芒 1 号集合资产管理计划 | 940.65 |
| 光大期货有限公司 | 光大期货光芒 8 号集合资产管理计划 | 587.62 |
| 光大期货有限公司 | 光大期货新曜 2 号集合资产管理计划 | 505.74 |
| 中信信托有限责任公司 | 中信信托和盈 1 号 | 416.47 |
| 光大期货有限公司 | 光大期货光策 11 号 | 215.79 |
| 光大期货有限公司 | 光大期货光芒 10 号集合资产管理计划 | 85.10 |
| 光大期货有限公司 | 光大期货光芒 14 号集合资产管理计划 | 77.22 |
| 光大期货有限公司 | 光大期货鑫安 10 号集合资产管理计划 | 39.89 |

注：1、以上披露口径以国家金融监督管理总局关联交易监管要求口径填列。

## 4.7 报告期内其他类型关联交易的情况

金额单位：元

| 关联方名称 | 关联交易类型 | 关联交易金额 |
| --- | --- | --- |
| 中信证券股份有限公司 | 资金类-其他 | 1,680,900.03 |
| 中国光大银行股份有限公司 | 服务类-销售服务费 | 666,921.79 |
| 申万宏源证券有限公司 | 资金类-其他 | 570,954.92 |
| 中信建投证券股份有限公司 | 资金类-其他 | 570,954.92 |
| 中国光大银行股份有限公司 | 服务类-托管费 | 101,664.80 |
| 中信银行股份有限公司 | 服务类-销售服务费 | 378.96 |
| 关联自然人 | 服务类-投资者端管理费 | 205.30 |

注：1、以上披露口径以国家金融监督管理总局关联交易监管要求口径填列。

## 4.8 报告期内重大关联交易的情况

金额单位：元

| 序号 | 关联交易类型 | 关联方名称 | 关联交易日期 | 交易标的 | 交易金额 | 备注 |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| - | - | - | - | - | - | - |

注：1、以上披露口径以国家金融监督管理总局关联交易监管要求口径填列。

# 第五章 风险分析

## 5.1 报告期末持有及报告期内到期的非标准化债权类资产情况

金额单位：元

| 序号 | 融资人 | 项目名称 | 剩余融资期限(天) | 到期收益分配 | 交易结构 | 风险状况 | 备注 |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| - | - | - | - | - | - | - | - |

注：1、报告期内非标准化债权类资产情况，包含报告期末持有的非标资产及报告期内到期的非标资产，以“备注”列予以区分，“备注”列枚举值为“报告期末持有”、“报告期内到期或卖出”和“投资不良资产及其收益权”。

2、剩余融资期限为非标准化债权类资产自报告期末至项目结束之间的期限，如该笔资产在报告期内已到期或已卖出，则显示为“-”。

3、到期收益分配情况，对于截至报告期末仍持有的资产，本项填写为“-”；对于报告期已到期或已卖出的资产，本项列示理财产品持有该笔资产期间的投资收益金额。

4、对于投资非标准化债权类资产穿透后基础资产为零售资产的，融资人可以按项目合并披露。

## 5.2 报告期末产品投资债券面临的利率、汇率变化等市场风险以及报告期债券价格波动情况

报告期内国内债券市场相对稳健，10 年期国债收益率下行 5BP，债市在低利率环境下仍具有一定配置支撑，资金面保持平稳，信用利差窄幅震荡，未发生明显信用风险事件。组合债券资产以中短久期、高等级信用债及存款类资产为主，持仓信用资质良好，报告期内未发生信用风险事件，票息收益为债券部分的主要回报来源，债券资产整体风险可控。

## 5.3 产品的流动性风险分析

组合持有充足比例的存款、货币市场工具及利率债等高流动性资产作为赎回备付，以应对负债端集中流出的风险，报告期内运作平稳，未发生流动性风险事件。

# 第六章 投资账户信息

| 序号 | 账户类型 | 账户名称 | 账户账号 | 账户开户机构 |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 托管账户 | 光大理财阳光青睿盈全球价值日开 2 号（360 天最低持有）理财产品 | 38250188000495394 | 中国光大银行青岛崂山支行 |

# 第七章 影响投资者决策的其他重要信息

## 7.1 影响投资者决策的其他重要信息

| |
|---|
| 无 |

光大理财有限责任公司

2026 年 10 月 27 日