

东证资管汉得信息 1 号集合资产管理计划 2019 年第 1 季度资产管理报告

计划管理人：上海东方证券资产管理有限公司
计划托管人：中国光大银行股份有限公司
报告期间：2019 年 01 月 01 日-2019 年 03 月 31 日

重要提示

本报告由集合资产管理计划管理人上海东方证券资产管理有限公司制作。

集合资产管理计划托管人中国光大银行股份有限公司于2019年04月18日对本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等数据进行了复核。本报告未经审计。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

管理人保证本报告书中所载资料的真实性、准确性和完整性，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担责任。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

本报告期起止时间：2019年01月01日-2019年03月31日

一、集合计划简介

1、基本资料

集合计划名称：东证资管汉得信息1号集合资产管理计划

集合计划类型：集合资产管理计划

集合计划成立日：2015年03月05日

集合计划成立规模：200,000,000.00份

集合计划报告期末计划总规模：195,029,411.29份

集合计划存续期：2015年03月05日-2020年09月04日

集合计划投资目标：根据“员工持股计划”的约定，本集合计划通过主动管理，投资“员工持股计划”约定的股票“汉得信息”。

集合计划投资理念：本集合计划在积极控制风险的前提下，根据“员工持股计划”的约定进行主动管理，力争实现委托人资产持续稳健增值。

2、集合计划管理人

名称：上海东方证券资产管理有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路318号31层

办公地址：上海市黄浦区中山南路318号2号楼31层

法人代表：潘鑫军

联系人：吴比

联系电话：4009200808
传真电话：021-63326981
网址：<http://www.dfham.com>

3、集合计划托管人

名称：中国光大银行股份有限公司
办公地址：北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
法定代表人：李晓鹏
联系人：石立平
联系电话：95595
传真：010-63639132
网址：www.cebbank.com

4、注册登记机构

名称：东方证券股份有限公司
办公地址：上海市中山南路318号东方国际金融广场2号楼22层

5、会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
办公地址：上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
经办注册会计师：叶尔甸、陈熹
联系电话：021-23232035
传真：021-23238800

二、主要财务指标和集合资产管理计划净值表现

1、主要财务指标

单位：人民币元

	主要财务指标	2019年03月31日
1	期初单位集合计划资产净值	0.644
2	期末单位集合计划资产净值	1.113
3	期末单位集合计划累计资产净值	1.113
4	期末集合计划资产净值	217,083,146.06
5	本期集合计划利润	91,421,975.32
6	期末集合计划可分配利润	-
7	单位期末集合计划可分配利润	-
8	本期集合计划净值增长率	72.83%
9	集合计划累计净值增长率	11.30%

注：本期期末集合计划可分配利润和净值未扣除管理人可提取的业绩报酬，以上财务指标不包括认购或交易集合计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、财务指标的计算公式

(1) 单位期末集合计划可分配利润= 集合计划期末可分配利润 ÷ 期末集合计划份额

- (2) 期末单位集合计划资产净值 = 期末集合计划资产净值 ÷ 期末集合计划份额
- (3) 期末单位集合计划累计资产净值 = 期末单位集合计划资产净值 + 单位集合计划累计分红
- (4) 本期集合计划净值增长率 = (分红前一天单位净值 / 期初单位净值) * {期末单位净值 / (分红前一天单位净值 - 分红金额)} - 1
- (5) 集合计划累计净值增长率 = (第一次分红后单位集合计划资产净值增长率 + 1) × (第二次分红后单位集合计划资产净值增长率 + 1) × …… × (最后一次分红后单位集合计划资产净值增长率 + 1) - 1

3、集合计划净值收益率图



4、收益分配情况

集合计划成立以来，本集合计划收益分配情况：

分配红利日期	每10份集合计划分红（至少保留2位小数）	备注

5、管理人提取业绩报酬情况

根据本计划说明书与合同约定，本期管理人未提取业绩报酬。

三、集合计划管理人报告

(一) 业绩表现

截止到2019年03月31日，集合计划单位资产净值为1.113元，本期净值增长率为72.83%，集合计划单位累计资产净值1.113元，累计净值增长率为11.30%。

(二) 投资主办人简介

曹建明先生，上海东方证券资产管理有限公司执行董事、私募权益投资部投资主办人，中央财经大学国际保险学学士，证券从业年限19年，历任深圳发展银行上海分行国际业务部信贷员，东方证券研究所研究员，南京证券资产管理部研究员、投资经理、上海东方证券资产管理有限公司专户投资部投资经理助理、投资主办人。

根据管理人公告，自2019年1月18日起，钱思佳女士因工作需要不再担任本集合资产管理计划的投资主办人，增聘曹建明先生为本集合资产管理计划的投资主办人。

(三) 投资主办人工作报告

一季度以来，受外资持续流入、流动性放松、政府减税降费政策支持、中美贸易争端缓和、经济转好预期等多重利好因素影响，估值降到历史低位的市场终于赢来了强劲反弹。涨幅靠前的行业包括计算机、农林牧渔、食品饮料、券商、电子等，涨幅靠后的行业包括银行、公用事业、建筑装饰、汽车等。

这既有外部因素利好的刺激，也有内部政策调整的推动，但更多的是体现了市场运行的内在基本规律，即市场和情绪总是像弹簧和钟摆一样运动——当一个方向走到了极致，就会开始向另一个方向运动。作为理性的投资者而言，我们不应该随波逐流，而是要看到危中有机、看清长远趋势、保持足够耐心、注重长远价值等等。

产品管理上，我们及时增加了仓位和弹性，优化了个股持仓结构，取得了一定收益。

展望未来几个季度，我们认为，在基建、减税、信用放松等政策推动下，预计经济将逐步见底，名义GDP在下半年有回升可能；叠加相对较为宽松的流动性及可能的赚钱效应，预计市场总体可能继续保持较好态势。

行业方面，我们继续看好竞争格局稳定，对宏观经济敏感度较低的家电、食品饮料等行业，同时对汽车、白酒、金融、化工、地产等顺周期行业也会保持关注。我们也将自下而上积极寻找具备持续竞争优势的低估、优质龙头公司，继续优化持仓结构，与优秀企业一起成长，力争为投资者带来长期稳定回报。

(四) 内部性说明

1、集合计划运作合规性声明

本报告期内，集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》及其他法律法规的规定，本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划资产，在严格控制风险的基础上为集合计划持有人谋求最大利益，运作合法合规，无损害集合计划持有人利益的行为。

2、风险控制报告

集合计划管理人设立合规与风险管理部作为独立风险监督管理部门，通过系统监控和现场检查，对集合资产管理计划运作过程中的各类风险进行全面的监督、检查和评价。在交易系统中设置各类合规性指标进行限制，实现交易事前控制，确保集合资产管理计划运作的合法合规。对于每日风险监控中发现的可能出现的风险状况，及时提醒投资主办人或责任部门采取相应措施，尽可能规避风险事件发生。

集合计划管理人在实行严格的内部风险控制的同时，也接受托管银行、上级监管机构、中介审计机构以及委托人的监督。

在本报告期内，本集合计划管理人对集合计划的管理始终都能按照有关法律法规、公司相关制度和本集合计划说明书的要求进行。本集合计划的投资决策、投资交易程序、

投资权限等各方面均符合规定的要求；交易行为合法合规，未出现异常交易、操纵市场的现象；未发现内幕交易的情况；相关的信息披露和财务数据皆真实、完整、准确、及时。

四、集合计划投资组合报告

2019年03月31日

单位：元

1、资产组合情况

项 目	期末市值	占期末总资产比例
银行存款和清算备付金	24,443.53	0.01%
交易保证金	-	-
证券清算款	-	-
应收申购款	-	-
股票投资	218,370,812.66	99.99%
其中：港股投资	-	-
债券投资	-	-
权证投资	-	-
基金投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
买入返售金融资产	-	-
其它投资	-	-
其它资产	4.90	-
合计	218,395,261.09	100.00%

注：“其它资产”包括“应收股利”、“应收利息”、“其他应收款”等项目。

2、报告期末按市值占集合计划资产净值比例大小排序的前十名股票明细

股票代码	股票名称	数 量	市 值	市值占净值比
300170	汉得信息	12,890,839	218,370,812.66	100.59%

3、报告期末按市值占集合计划资产净值比例大小排序的前十名基金明细

基金代码	基金名称	数 量	市 值	市值占净值比
------	------	-----	-----	--------

4、报告期末按市值占集合计划资产净值比例大小排序的前十名权证明细

权证代码	权证名称	数量	市值	市值占净值比
------	------	----	----	--------

5、报告期末按市值占集合计划资产净值比例大小排序的前十名期权明细

期权代码	期权名称	数量	市值	市值占净值比
------	------	----	----	--------

6、报告期末按市值占集合计划资产净值比例大小排序的前五名债券明细

债券代码	债券名称	数量	市值	市值占净值比
------	------	----	----	--------

7、报告期末期货投资情况

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
总额合计				-
减：可抵销期货暂收款				-
股指期货投资净额				0.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

五、集合计划份额变动情况

本期 2019年01月01日-2019年03月31日本计划份额变动情况：

期初总份额	本期参与份额	本期退出份额	期末总份额
195,029,411.29	-	-	195,029,411.29

六、重要事项揭示

- （一）在本报告期内本集合计划托管人的董事长、行长没有发生变更。
- （二）在本报告期内本集合计划管理人的董事长、总经理没有发生变更。
- （三）在本报告期内本集合计划未发生重大关联交易。

七、备查文件目录

(一) 本集合计划备查文件目录

- 1、《东证资管汉得信息1号集合资产管理计划说明书》
- 2、《东证资管汉得信息1号集合资产管理合同》
- 3、《东证资管汉得信息1号集合资产管理计划托管协议》
- 4、《东证资管汉得信息1号集合资产管理计划验资报告》
- 5、管理人业务资格批件、营业执照。
- 6、《东证资管汉得信息1号集合资产管理计划年度审计报告【正本】》

(二) 查阅方式

投资者可在工作时间到管理人办公地址或登录管理人网站查阅。如有疑问，可通过以下途径向管理人上海东方证券资产管理有限公司咨询：

网址：www.dfham.com，客户服务热线：4009200808

上海东方证券资产管理有限公司
2019年04月22日