

---

# 东证资管汉得信息 1 号集合资产管理计划

## 2019 年第 2 季度报告

资产管理计划管理人：上海东方证券资产管理有限公司

资产管理计划托管人：中国光大银行股份有限公司

报告期间：2019 年 4 月 1 日-2019 年 6 月 30 日

报告送出日期：2019 年 07 月 19 日

## 重要提示

本集合计划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。

本集合计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本集合计划合同及说明书。

本报告中财务资料未经审计。

### 一、基本信息

资产管理计划名称:	东证资管汉得信息 1 号集合资产管理计划
合同生效时间:	2015 年 3 月 5 日
管理人:	上海东方证券资产管理有限公司
托管人:	中国光大银行股份有限公司

### 二、资产管理计划投资表现

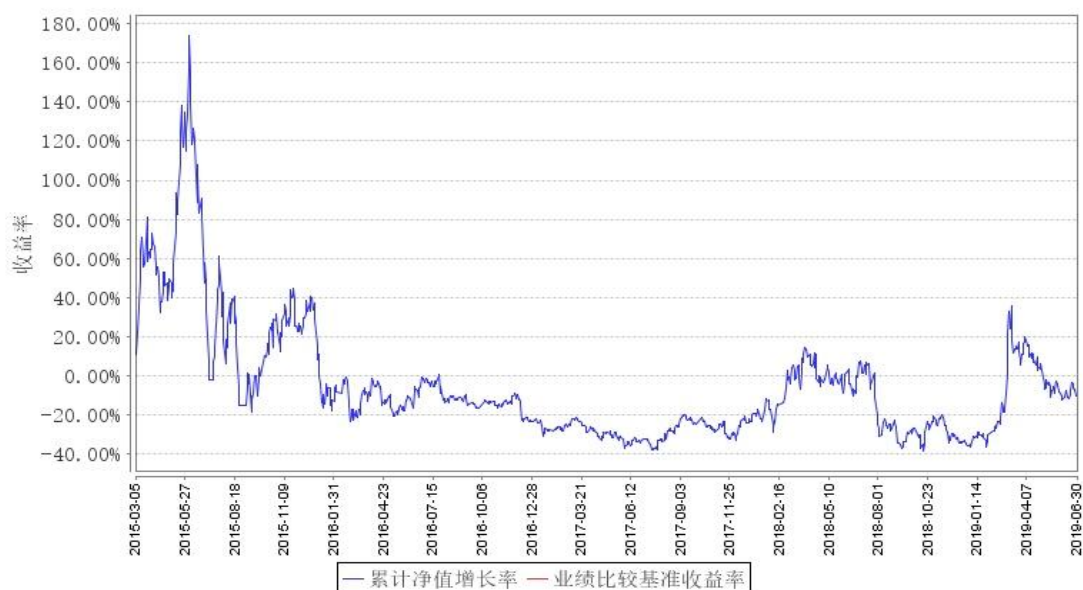
#### (一) 主要财务指标

	本期末
期末资产净值(元)	174,748,496.51
本期利润(元)	-42,334,649.55
期末资产管理计划可分配利润	-
期末份额净值(元)	0.896
期末份额累计净值(元)	0.896
本期资产管理计划净值增长率	-19.50%
资产管理计划累计净值增长率	-10.40%

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。

#### (二) 集合计划累计净值增长率与比较基准收益率的历史走势对比图

集合计划累计净值增长率与比较基准收益率的历史走势对比图



注：本集合计划无业绩比较基准。

### 三、资产管理计划投资组合报告

#### (一) 资产组合情况

序号	资产类别	期末市值（元）	占期末总资产的比例（%）
1	权益投资	175,186,502.01	99.77
	其中：境内股票	175,186,502.01	99.77
	港股投资	-	-
2	固定收益投资	-	-
3	基金投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款及清算备付金	411,229.15	0.23
7	其他资产	73.98	0.00
8	资产合计	175,597,805.14	100.00

注：“其他资产”包括“存出保证金”、“应收利息”等项目。

#### (二) 报告期末按市值占资产管理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	持仓数量(股)	市值(元)	市值占委托资产净值比例(%)
300170	汉得信息	12,890,839.00	175,186,502.01	100.25

#### (三) 报告期末按市值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前五名债券明

细

本集合计划本报告期末未持有债券。

(四) 报告期末按市值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前五名基金明  
细

本集合计划本报告期末未持有基金。

(五) 报告期末按市值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前十名期权明  
细

本集合计划本报告期末未持有期权。

(六) 报告期末期货投资情况

本集合计划本报告期末未持有期货。

(七) 报告期末按市值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前十名权证明  
细

本集合计划本报告期末未持有权证。

(八) 资产管理计划运用杠杆情况

本集合计划本报告期末，无因从事证券交易所、银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

## 四、管理人履职报告

(一) 投资主办人情况

投资主办人姓名	学历	证券从业年限	主要工作经历
曹建明	学士	19	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。

## （二） 投资策略回顾与展望

二季度以来，市场有所回调，主要原因包括贸易争端再度紧张、金融市场去杠杆、一季度上涨之后有回调压力等。从行业季度对比看，大部分行业都从一季度的上涨转为下跌，但食品饮料、家电、金融等行业继续上涨，显示出较强的“韧性”。

这样的行情分化特征，既有“北上”资金持续买入价值股的影响，也有中国经济进入特定发展阶段的影响。从中长期看，中国经济逐步降速，开始转为高质量发展阶段，各行业的发展都将呈现优胜劣汰、结构分化的特征。具备核心竞争力的优质公司将在竞争中脱颖而出，业绩增长或更加持续、稳定；同时，随着中国投资者结构更加国际化、更加成熟化，或也将推动优质公司估值提升。业绩和估值双轮驱动下，优质公司的股价可能会继续表现出“强者恒强”特征。

产品管理上，我们保持持仓总体稳定，并持续优化持仓结构，取得了一定收益。

展望未来几个季度，我们认为，尽管外部环境复杂多变，尤其是贸易争端仍未结束，但中国自身应对困难和挑战的信心在增强，市场也在一定程度上反应了部分不利因素。同时，在基建、减税、结构化改革等政策推动下，预计经济将趋于稳定，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、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。

## （三） 公平交易专项说明

### 1、公平交易制度的执行情况的专项说明

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《上海东方证券资产管理有限公司公平交易制度》等规定。

### 2、异常交易行为的专项说明

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法规规定的要求；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。

## 五、托管人履职报告

托管人履职报告详见《托管报告》。

## 六、管理费、托管费、业绩报酬的计提基准、计提方式和支付方式

### （一） 资产管理计划管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年4月1日至2019年6 月30日	上季度可比期间 2019年1月1日至2019 年3月31日
当期发生的资产管理计划应支付的管理费	145,201.79	122,313.40

注：本集合计划应给付管理人管理费，按前一日的资产净值的年费率计提。本集合计划的年管理费率为0.3%。计算方法如下：

$$H=E\times 0.3\%\div \text{当年实际天数。}$$

H为每日应支付的管理费；  
E为前一日集合计划资产净值。

管理人的管理费每日计算，逐日累计至每季度末，按季度支付，由托管人于次季度首日起5个工作日内依据管理人划款指令从本集合计划资产中一次性支付，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

## (二) 资产管理计划托管费

单位：人民币元

项目	本期	上季度可比期间
	2019年4月1日至2019年6月30日	2019年1月1日至2019年3月31日
当期发生的资产管理计划应支付的托管费	72,600.86	61,156.70

注：本集合计划应给付托管人托管费，按前一日的资产净值的年费率计提。本集合计划的年托管费率为0.15%。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年实际天数}$$

H为每日应支付的托管费；

E为前一日集合计划资产净值。

托管人的托管费每日计算，托管费计算逐日累计至每季度末，按季度支付，由托管人于次季度首日起5个工作日内依据管理人划款指令从本集合计划资产中一次性支付，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

## (三) 业绩报酬

本集合计划无业绩报酬。

## 七、资产管理计划投资收益分配情况

本报告期内，本集合计划未进行收益分配。

## 八、本报告期涉及投资者权益的重大事项及其他需要说明的情况

### (一) 投资主办人变更

本报告期内本集合计划投资主办人没有发生变更。

### (二) 重大关联交易情况

本报告期内本集合计划未发生重大关联交易。

### (三) 其他

本报告期内本集合计划无需要说明的其他情况。

上海东方证券资产管理有限公司  
2019年07月19日