

东方红新睿 5 号集合资产管理计划 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

集合计划管理人：上海东方证券资产管理有限公司

集合计划托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

集合计划托管人招商银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2021 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

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集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利

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的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 集合计划简介	5
2.1 集合计划基本情况	5
2.2 集合计划产品说明	5
2.3 集合计划管理人和集合计划托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标和集合计划净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 集合计划净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 集合计划管理人及集合计划经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本集合计划运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内集合计划的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内集合计划估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内集合计划利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本集合计划持有人数或集合计划资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本集合计划托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本集合计划投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（集合计划净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末集合计划资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
7.3 期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
7.6 期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	38

7.7 期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	39
7.8 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	39
7.9 期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	39
7.10 报告期末本集合计划投资的股指期货交易情况说明	39
7.11 报告期末本集合计划投资的国债期货交易情况说明	39
7.12 投资组合报告附注	40
§ 8 集合计划份额持有人信息	41
8.1 期末集合计划份额持有人户数及持有人结构	41
8.2 期末集合计划管理人的从业人员持有本集合计划的情况	41
8.3 期末集合计划管理人的从业人员持有本集合计划份额总量区间情况	41
§ 9 集合计划份额变动	41
§ 10 重大事件揭示	41
10.1 集合计划管理人、集合计划托管人的专门集合计划托管部门的重大人事变动	41
10.2 涉及集合计划管理人、集合计划财产、集合计划托管业务的诉讼	42
10.3 集合计划投资策略的改变	42
10.4 为集合计划进行审计的会计师事务所情况	42
10.5 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	42
10.6 其他重大事件	42
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	43
11.1 报告期内单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过 20%的情况	43
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	43
§ 12 备查文件目录	43
12.1 备查文件目录	43
12.2 存放地点	43
12.3 查阅方式	43

§ 2 集合计划简介

2.1 集合计划基本情况

集合计划名称	东方红新睿 5 号集合资产管理计划
集合计划简称	东方红新睿 5 号集合
集合计划主代码	910026
集合计划运作方式	契约型开放式
集合计划合同生效日	2013 年 4 月 24 日
集合计划管理人	上海东方证券资产管理有限公司
集合计划托管人	招商银行股份有限公司
报告期末集合计划份额总额	66,467,175.23 份
集合计划合同存续期	不定期

2.2 集合计划产品说明

投资目标	本集合计划以追求绝对收益为目标，充分挖掘各类投资品种折价和套利的机会，将价值回归转化成组合收益，并通过股指期货对冲部分系统性风险，力求在不同的市场环境下实现投资组合的稳健增值。
投资理念	本计划将在积极把握宏观经济和市场发展趋势的基础上，深入挖掘各类投资品种和交易方式中的折价和套利机会，重点把握大宗交易折价、封闭式基金折价、可转换债券价格明显低估、定向增发和定向增发破发等折价套利机会，将追求价值回归作为投资的主线。

2.3 集合计划管理人和集合计划托管人

项目		集合计划管理人	集合计划托管人
名称		上海东方证券资产管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李云亮	张燕
	联系电话	021-53952828	0755-83199084
	电子邮箱	service@dfham.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4009200808	95555
传真		021-63326381	0755-83195201
注册地址		上海市黄浦区中山南路 109 号 7 层-11 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		上海市黄浦区外马路 108 号 7 层-11 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		200010	518040
法定代表人		宋雪枫	缪建民

2.4 信息披露方式

登载集合计划中期报告正文的管理人互联网网址	www.dfham.com
集合计划中期报告备置地点	上海市黄浦区外马路 108 号 7 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
--------	----------------	------------------

§ 3 主要财务指标和集合计划净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	22,914,120.55
本期利润	3,795,243.21
加权平均集合计划份额本期利润	0.0519
本期加权平均净值利润率	1.82%
本期集合计划份额净值增长率	3.15%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	130,205,541.28
期末可供分配集合计划份额利润	1.9589
期末集合计划资产净值	196,672,716.51
期末集合计划份额净值	2.9589
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
集合计划份额累计净值增长率	212.89%

注：1、所述集合计划业绩指标不包括持有人参与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、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（不含暂估附加税）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扣除相关暂估附加税。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 集合计划净值表现

3.2.1 集合计划份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-0.35%	0.88%	—%	—%	—%	—%

过去三个月	9.90%	0.97%	—%	—%	—%	—%
过去六个月	3.15%	1.40%	—%	—%	—%	—%
过去一年	32.11%	1.39%	—%	—%	—%	—%
过去三年	48.63%	1.25%	—%	—%	—%	—%
自集合计划合同生效起至今	212.89%	1.26%	—%	—%	—%	—%

注：本集合计划无业绩比较基准。

3.2.2 自集合计划合同生效以来集合计划份额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

东方红新睿5号集合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



注：本集合计划无业绩比较基准。

§ 4 管理人报告

4.1 集合计划管理人及集合计划经理情况

4.1.1 集合计划管理人及其管理集合计划的经验

上海东方证券资产管理有限公司成立于 2010 年 7 月 28 日，是国内首家获中国证监会批准设

立的券商系资产管理公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准东方证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可[2010]518 号）批准，由东方证券股份有限公司出资 3 亿元在原东方证券资产管理业务总部的基础上成立。2013 年 8 月，公司成为首家获得“公开募集证券投资集合计划管理业务资格”的证券公司。公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。

截至 2021 年 6 月 30 日，本集合计划管理人共管理东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金、东方红价值精选混合型证券投资基金、东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红益鑫纯债债券型证券投资基金、东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红信用债券型证券投资基金、东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金、东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金、东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金、东方红稳健精选混合型证券投资基金、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金、东方红优势精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、东方红收益增强债券型证券投资基金、东方红睿轩三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红货币市场基金、东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红配置精选混合型证券投资基金、东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金、东方红恒元五年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金、东方红聚利债券型证券投资基金、东方红启元三年持有期混合型证券投资基金、东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红安鑫甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红鑫裕两年定期开放信用债券型证券投资基金、东方红恒阳五年定期开放混合型证券投资基金、东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红启东三年持有期混合型证券投资基金、东方红颐和积极养老目标五年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红颐和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红颐和稳健养老目标两年持有

期混合型基金中基金（FOF）、东方红智远三年持有期混合型证券投资基金、东方红益丰纯债债券型证券投资基金、东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金、东方红招盈甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红鑫安 39 个月定期开放债券型证券投资基金、东方红明鉴优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红鼎元 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红启航三年持有期混合型证券投资基金、东方红锦丰优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红多元策略混合型证券投资基金、东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红创新趋势混合型证券投资基金、东方红远见价值混合型证券投资基金、东方红启阳三年持有期混合型证券投资基金、东方红启瑞三年持有期混合型证券投资基金、东方红启程三年持有期混合型证券投资基金、东方红启盛三年持有期混合型证券投资基金、东方红锦和甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金、东方红启恒三年持有期混合型证券投资基金、东方红启华三年持有期混合型证券投资基金、东方红内需增长混合型证券投资基金共计 70 只公开募集证券投资基金，以及东方红 5 号灵活配置集合资产管理计划、东方红-新睿 2 号集合资产管理计划、东方红-新睿 5 号集合资产管理计划、东方红增利 2 号集合资产管理计划、东方红增利 6 号集合资产管理计划、东方红基金宝集合资产管理计划共计 6 只大集合产品。

4.1.2 集合计划投资经理简介

姓名	职务	任本集合计划投资经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
高义	上海东方证券资产管理有限公司执行董事、本集合资产管理计划投资经理	2014 年 4 月 8 日	-	12 年	上海东方证券资产管理有限公司执行董事、投资经理。北京大学经济学博士，历任东方证券研究所宏观策略高级研究员，东方证券资产管理业务总部首席策略师、上海东方证券资产管理有限公司研究部宏观策略研究员、私募权益投资部投资主办人、公募集合权益投资部投资经理。具备证券投资基金从业资格。

注：1、上述表格内集合计划首任集合计划投资经理“任职日期”指集合计划成立日，“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；对此后非首任集合计划投资经理，集合计划投资经理的“任职日期”和“离任日期”均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本集合计划运作合规守信情况的说明

本报告期，上海东方证券资产管理有限公司作为本集合计划管理人，严格遵守本集合计划资产管理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集合计划

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集合计划合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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投资组合，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《上海东方证券资产管理有限公司公平交易制度》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 管理人对报告期内集合计划的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内集合计划投资策略和运作分析

上半年，市场在经历了一季度快速下跌后，二季度逐步企稳并震荡上行。结构明显分化——指数层面，上证综指上涨 5.2%，创业板指上涨 19.9%；行业层面，电气设备、钢铁、化工、有色、煤炭等涨幅靠前，家电、非银、地产、军工、农林牧渔、传媒等跌幅较大。上半年，结合库存周期运行的过往规律，我们认为宏观经济有见顶回落的风险，同时流动性相对偏紧，加上过去两年热门板块涨幅较大、估值较高，故对 2021 年的市场持相对谨慎看法。相应的，投资策略上，我们基本没有参与上半年顺周期行业的行情，而是主要配置业绩更加稳定可预期的消费、医药、互联网和先进制造等行业。产品运作上，基于估值、成长性和景气度等因素的匹配，我们减持了部分白酒、调味品、家电等行业和可转债，增配了医药、电动车、半导体等行业。从事后效果来看，增配的行业相对表现不错，但消费、互联网等行业表现一般。总结原因，对消费而言，市场此前配置过于集中，估值偏高，短期的行业比较上不占优，存在被性价比更优行业“替代”的风险。对互联网而言，我们的错误在于，对宏观政策理解不够透彻，低估了监管政策的持续时间和力度，低估了环境不利时发生踩踏的可能性，过早使用了“逆向投资”策略。基于上述分析，我们后期将结合各行业的基本面、景气度、估值、政策导向等情形继续优化持仓分布。

4.4.2 报告期内集合计划的业绩表现

截至本报告期末，本集合计划份额净值为 2.9589 元，份额累计净值为 3.0739 元；本报告期

集合计划份额净值增长率为 3.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，从宏观经济看，中国经济回落的趋势逐步显现；通胀方面，尽管 PPI 仍处高位但 CPI 压力有所减轻；流动性环境可能比上半年相对要宽松一些，但可能仍会受到外部流动性环境的干扰。从政策环境看，加快构建新发展格局，是党中央近期作出的重大关键战略部署，其中“选取真正的重点堵点难点集中攻关”、“守住新发展格局的安全底线”等一系列重要提法值得关注，需要我们更加深刻学习和领会其中蕴含的投资机遇和风险。从证券市场看，我们认为，当前市场不是典型的牛市或熊市状态，而是总体处于结构分化、新兴成长风格为主的平衡市状态，这种趋势在下半年继续延续的概率较大。从行业层面看，消费升级、先进制造、半导体、新能源、新基建等有关行业仍是重点方向，但如果结构分化过于极致、赛道过于拥挤时，也应适时留意羊群效应带来的风险。总体上，我们认为，自上而下应适度降低 2021 年投资收益的预期；更多从中观层面和个股层面，立足中国经济产业结构转型升级大趋势，努力寻找符合时代特征的新兴行业和具备持续竞争优势的优秀公司，力争为投资者获取稳健回报。

4.6 管理人对报告期内集合计划估值程序等事项的说明

本报告期内，本集合计划管理人参照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和集合计划合同的约定，对集合计划所持有的投资品种进行估值，本集合计划托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。集合计划份额净值由集合计划管理人完成估值后，经集合计划托管人复核无误后由集合计划管理人对外公布。

本集合计划管理人对投资品种进行估值时原则上应保持估值程序和技术的一致性，对旗下管理的不同产品持有的具有相同特征的同一投资品种的估值调整原则、程序及技术应当一致（中国证监会规定的特殊品种除外）。为了保障集合计划能真实、准确地反映投资品种的公允价值，本集合计划管理人授权估值委员会负责建立健全估值决策体系，估值委员会成员的任命和调整由总经理办公会审议决定。运营部是估值委员会的日常办事机构，负责关注相关投资品种的动态，确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种，并提交估值委员会审议。运营部的估值人员均具有专业会计学习经历，具有基金从业人员资格。

4.7 管理人对报告期内集合计划利润分配情况的说明

本集合计划本报告期末进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本集合计划持有人数或集合计划资产净值预警情形的说明

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者集合计划资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本集合计划托管人合规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

5.2 托管人对报告期内本集合计划投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东方红新睿 5 号集合资产管理计划

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	14,871,157.82	15,511,239.25
结算备付金		251,502.09	666,726.20
存出保证金		63,246.70	108,707.81
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	6.4.7.2	182,198,177.02	220,807,866.01
其中：股票投资		96,764,261.27	116,857,341.20
基金投资		—	—

债券投资		85,433,915.75	103,950,524.81
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,658,252.25	2,479,547.74
应收利息	6.4.7.5	247,116.15	350,729.44
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		199,289,452.03	239,924,816.45
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		662,507.73	612,326.52
应付管理人报酬		812,667.20	907,384.12
应付托管费		124,158.92	146,562.18
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	115,223.12	212,962.98
应交税费		827,383.36	1,442,188.86
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	74,795.19	50,000.00
负债合计		2,616,735.52	3,371,424.66
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	66,467,175.23	82,462,718.48
未分配利润	6.4.7.10	130,205,541.28	154,090,673.31
所有者权益合计		196,672,716.51	236,553,391.79
负债和所有者权益总计		199,289,452.03	239,924,816.45

注： 报告截止日 2021 年 06 月 30 日，集合计划份额净值 2.9589 元，集合计划份额总额 66,467,175.23 份。

6.2 利润表

会计主体：东方红新睿 5 号集合资产管理计划

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021年1月1日至2021年 6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
一、收入		9,409,526.32	16,003,810.37
1. 利息收入		259,486.00	703,262.23
其中：存款利息收入	6.4.7.11	34,404.68	35,467.38
债券利息收入		214,091.20	666,594.19
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		10,990.12	1,200.66
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		28,337,994.29	19,513,238.37
其中：股票投资收益	6.4.7.12	27,039,964.10	15,396,678.75
集合计划投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,010,225.98	3,137,676.75
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	287,804.21	978,882.87
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-19,187,953.97	-4,212,690.23
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
减：二、费用		5,614,283.11	5,564,026.15
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,761,438.80	4,022,727.84
2. 托管费	6.4.10.2.2	260,224.95	401,980.10
3. 销售服务费	-	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	531,486.01	1,051,495.81
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		32,135.10	51,970.97
7. 其他费用	6.4.7.20	28,998.25	35,851.43
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,795,243.21	10,439,784.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”		3,795,243.21	10,439,784.22

号填列)			
------	--	--	--

6.3 所有者权益（集合计划净值）变动表

会计主体：东方红新睿 5 号集合资产管理计划

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（集合计划净值）	82,462,718.48	154,090,673.31	236,553,391.79
二、本期经营活动产生的集合计划净值变动数（本期利润）	-	3,795,243.21	3,795,243.21
三、本期集合计划份额交易产生的集合计划净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-15,995,543.25	-27,680,375.24	-43,675,918.49
其中：1. 集合计划申购款	250,386.55	467,678.45	718,065.00
2. 集合计划赎回款	-16,245,929.80	-28,148,053.69	-44,393,983.49
四、本期向集合计划份额持有人分配利润产生的集合计划净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（集合计划净值）	66,467,175.23	130,205,541.28	196,672,716.51
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（集合计划净值）	214,360,144.75	234,953,774.52	449,313,919.27
二、本期经营活	-	10,439,784.22	10,439,784.22

动产生的集合计划净值变动数（本期利润）			
三、本期集合计划份额交易产生的集合计划净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-97,326,954.29	-100,291,229.34	-197,618,183.63
其中：1. 集合计划申购款	-	-	-
2. 集合计划赎回款	-97,326,954.29	-100,291,229.34	-197,618,183.63
四、本期向集合计划份额持有人分配利润产生的集合计划净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（集合计划净值）	117,033,190.46	145,102,329.40	262,135,519.86

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张锋

汤琳

陈培

集合计划管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 集合计划基本情况

东方红-新睿 5 号集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”)由上海东方证券资产管理有限公司(以下简称“东证资管”或“本集合计划管理人”)设立,并负责推广计划、开展投资管理和后续服务活动。

本集合计划不设固定存续期限,首次设立推广不包括认购资金利息共募集人民币 1,306,380,485.56 元,业经立信会计师事务所有限公司信会师报字(2013)第 130363 号验资报告予以验证。经本集合计划管理人公告,本集合计划于 2013 年 4 月 24 日成立,成立日的集合计划份额总额为 1,307,060,743.30 份,其中有效参与资金利息折合 680,257.74 份集合计划份额。本集合计划管理人为东证资管,托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

根据《东方红-新睿 5 号集合资产管理合同》的有关规定,本集合计划的投资范围为中国证券

监督管理委员会允许集合计划投资的品种。主要包括：中国境内依法发行的股票、债券、证券投资基金、央行票据、短期融资券、资产支持证券、中期票据、股指期货等金融衍生品、保证收益及保本浮动收益商业银行理财计划、证券回购以及中国证监会认可的其他投资品种。本集合计划可以参与融资融券交易，也可以将其持有的股票作为融券标的证券出借给证券金融公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划的财务报表按照《东方红-新睿 5 号集合资产管理合同》及《东方红-新睿 5 号集合资产管理计划说明书》约定的资产估值、会计核算方法及其他重要会计政策和会计估计编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划 2021 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日的期间经营成果和集合计划净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本集合计划本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

集合计划目前比照公开募集证券投资基金所依据的相关财税法规和实务操作及其他相关国内财税法规计提和缴纳税款，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价(2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、集合计划份额净值作为买入价计算销售额。

(2)对集合计划从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，从证券投资基金分配中取得的收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税。

(3)集合计划卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(4)本集合计划的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
活期存款	14,871,157.82
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	14,871,157.82

6.4.7.2 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	73,683,190.98	96,764,261.27	23,081,070.29
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	87,476,041.17	85,433,915.75
	银行间市场	-	-
	合计	87,476,041.17	85,433,915.75
资产支持证券	-	-	-
集合计划	-	-	-

其他	-	-	-
合计	161,159,232.15	182,198,177.02	21,038,944.87

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本集合计划本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本集合计划本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本集合计划本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,468.98
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	110.20
应收债券利息	245,508.47
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	28.50
合计	247,116.15

6.4.7.6 其他资产

注：本集合计划本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	115,223.12
银行间市场应付交易费用	-
合计	115,223.12

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	74,795.19
合计	74,795.19

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	集合计划份额（份）	账面金额
上年度末	82,462,718.48	82,462,718.48
本期申购	250,386.55	250,386.55
本期赎回（以“-”号填列）	-16,245,929.80	-16,245,929.80
- 集合计划拆分/份额折算前	-	-
集合计划拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	66,467,175.23	66,467,175.23

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	151,527,216.80	2,563,456.51	154,090,673.31
本期利润	22,914,120.55	-19,118,877.34	3,795,243.21
本期集合计划份额 交易产生的变动数	-29,085,405.11	1,405,029.87	-27,680,375.24
其中：集合计划申 购款	493,056.00	-25,377.55	467,678.45
集合计划赎 回款	-29,578,461.11	1,430,407.42	-28,148,053.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	145,355,932.24	-15,150,390.96	130,205,541.28

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	29,837.09
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,923.41
其他	644.18
合计	34,404.68

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	27,039,964.10
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	27,039,964.10

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	212,398,154.23
减：卖出股票成本总额	185,358,190.13
买卖股票差价收入	27,039,964.10

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本集合计划本报告期无股票投资收益-证券出借差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,010,225.98
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,010,225.98

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	99,618,110.79
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	98,371,900.20
减：应收利息总额	235,984.61
买卖债券差价收入	1,010,225.98

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本集合计划本报告期无债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本集合计划本报告期无债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本集合计划本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本集合计划本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本集合计划本报告期无贵金属投资收益—买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本集合计划本报告期无贵金属投资收益—赎回差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本集合计划本报告期无贵金属投资收益—申购差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本集合计划本报告期无衍生工具收益—买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本集合计划本报告期无衍生工具收益—其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	287,804.21
其中：证券出借权益补偿收入	—
集合计划投资产生的股利收益	—
合计	287,804.21

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-19,763,592.59
股票投资	-14,461,425.34
债券投资	-5,302,167.25
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-575,638.62
合计	-19,187,953.97

6.4.7.18 其他收入

注：本集合计划本报告期无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	531,486.01
银行间市场交易费用	—
合计	531,486.01

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	—
证券出借违约金	—
银行费用	4,203.06
合计	28,998.25

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本集合计划并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

根据本集合计划管理人发布的《东方红-新睿 5 号集合资产管理计划正式变更为东方红新源三年持有期混合型证券投资基金及法律文件变更的公告》，自 2021 年 07 月 05 日起，本集合计划变更为公开募集证券投资基金，名称变更为“东方红新源三年持有期混合型证券投资基金”，《东方红新源三年持有期混合型证券投资基金基金合同》生效，《东方红-新睿 5 号集合资产管理合同》于同一起失效。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本集合计划本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与集合计划发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本集合计划的关系
上海东方证券资产管理有限公司（“东证资管”）	集合计划管理人、集合计划销售机构
招商银行（“招商银行”）	集合计划托管人、集合计划销售机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	集合计划管理人的股东、集合计划销售机构
上海东证期货有限公司（“东证期货”）	受东方证券控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
-------	---------------------------------------	--

	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
东方证券	-	-	199,116,475.51	26.58

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
东方证券	-	-	67,919,825.80	26.12

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本集合计划本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本集合计划本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 集合计划管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的集合计划应支付的管理费	4,761,438.80	4,022,727.84

注：1、本集合计划本期共发生应支付的管理费 1,561,349.89 元（2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日：2,411,880.85 元）。本集合计划的管理费根据前一日的累计单位净值分档收取：集合计划前一日的累计单位净值 < 0.95 时，适用的年管理费率为 0；集合计划前一日的累计净值 ≥ 0.95 时，适用的管理费率为 1.50%。

集合计划管理费按前一日集合计划资产净值及适用的年管理费计提，逐日累计至每季度末，按季支付。

2、本集合计划本期共发生应支付的业绩报酬 3,200,088.91 元（2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日：1,610,846.99 元）。上述金额于相应的本集合计划收益分配基准日、委托人退出日或本

集合计划终止日按投资者实际收益情况计算确认，未达到支付条件的暂估业绩报酬不计入当期损益。在本集合计划收益分配基准日、委托人退出日或本集合计划终止日，本集合计划对每份集合计划份额参与日(推广期参与的为本集合计划成立日，存续期参与的为参与当日)至本次业绩报酬计提日期间的年化收益率超过 5.0%的部分计提 20%的集合计划管理人业绩报酬。其计算公式为：

$$\text{当年化收益率} > 5.0\% \text{ 时, 业绩报酬} = \text{MAX} [0, (\text{年化收益率} - 5.0\%) \times 20\% \times \text{该笔份额参与日的计划单位净值} \times \text{提取业绩报酬的份额} \times \text{该笔份额参与日到本次业绩报酬计提日间隔天数} / 365 - \text{该笔份额存续期间已计提的业绩报酬总额}]$$

管理人在收益分配基准日提取的业绩报酬，不应超过该笔份额本次分红金额的 20%，故业绩报酬上限为：本次收益分配基准日每份集合计划份额分红金额 $\times$ 该笔提取业绩报酬的份额数 $\times$ 20%。

6.4.10.2.2 集合计划托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的集合计划应支付的托管费	260,224.95	401,980.10

注：本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本集合计划本报告期内及上年度可比期间未有与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限

限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本集合计划本报告期内及上年度可比期间未有与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本集合计划的情况

6.4.10.5.1 报告期内集合计划管理人运用固有资金投资本集合计划的情况

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间，集合计划管理人未运用固有资金投资本集合计划。

6.4.10.5.2 报告期末除集合计划管理人之外的其他关联方投资本集合计划的情况

注：本集合计划本报告期末及上年度末除集合计划管理人以外的其他关联方未投资本集合计划。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	14,871,157.82	29,837.09	10,962,653.99	28,748.61

注：本集合计划的银行存款由集合计划托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本集合计划在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本集合计划本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本集合计划用于期货交易结算的资金分别存放于东证期货的结算账户和保证金账户中，结算备付金按银行同业利率计息，存出保证金不计息。于 2021 年 06 月 30 日，本集合计划的结算备付金余额为 12,097.67 元，存出保证金余额为 0 元。(2020 年 12 月 31 日：结算备付金 12,053.76 元，无存出保证金)。于 2021 年上半年，本集合计划当期结算备付金利息收入为 43.67 元(2020 年同期：43.59 元)。

6.4.11 利润分配情况

注：本集合计划本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末(2021 年 6 月 30 日)本集合计划持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本集合计划无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本集合计划本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本集合计划本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本集合计划本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本集合计划本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本集合计划管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本集合计划管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在经营层面设立风险控制委员会，负责督促各职能部门在日常工作中识别各项业务所涉及各类重大风险，组织对重大事件、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，就相关解决方案进行评审；督促各职能部门识别和评估新产品、新业务的风险，就相关控制措施进行评审；督促各职能部门重点关注内控机制薄弱环节和可能给公司带来重大损失的事件，审议并决定相应的控制措施和解决方案等。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者集合计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。

本集合计划的管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本集合计划的银行存款存放在托管人招商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本集合计划在交易所进行的

交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

本集合计划管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本集合计划债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本集合计划本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本集合计划本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本集合计划本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	51,583,007.18	73,232,839.75
AAA 以下	33,850,908.57	30,717,685.06
未评级	—	—
合计	85,433,915.75	103,950,524.81

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本集合计划本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本集合计划本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指集合计划在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于集合计划委托人于约定开放日要求退出集合计划，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对由于集合计划委托人退出造成的流动性风险，本集合计划的管理人采取了一系列管理措施，如规定在开放期内方可办理退出、保持一定比例的现金、在极端情况下启用暂停退出的机制等。

针对投资品种变现的流动性风险，本集合计划管理人通过对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。且本集合计划所持证券均在证券交易所上市，因此均能及时变现。

于 2021 年 06 月 30 日，本集合计划所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可退出集合计划份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指集合计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本集合计划持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资等，其余金融资产及金融负债不计息。本集合计划的管理人定期对本集合计划面临的利率敏感性缺口进行监控，以对该风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							

银行存款	14,871,157.82	-	-	-	-	-	14,871,157.82
结算备付金	251,502.09	-	-	-	-	-	251,502.09
存出保证金	63,246.70	-	-	-	-	-	63,246.70
交易性金融资产	-	-	-	34,204,730.42	51,229,185.33	96,764,261.27	182,198,177.02
应收利息	-	-	-	-	-	247,116.15	247,116.15
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,658,252.25	1,658,252.25
资产总计	15,185,906.61	-	-	34,204,730.42	51,229,185.33	98,669,629.67	199,289,452.03
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	662,507.73	662,507.73
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	812,667.20	812,667.20
应付托管费	-	-	-	-	-	124,158.92	124,158.92
应付交易费用	-	-	-	-	-	115,223.12	115,223.12
应交税费	-	-	-	-	-	827,383.36	827,383.36
其他负债	-	-	-	-	-	74,795.19	74,795.19
负债总计	-	-	-	-	-	2,616,735.52	2,616,735.52
利率敏感度缺口	15,185,906.61	-	-	34,204,730.42	51,229,185.33	96,052,894.15	196,672,716.51
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产	-	-	-	-	-	-	-
银行存款	15,511,239.25	-	-	-	-	-	15,511,239.25
结算备付金	666,726.20	-	-	-	-	-	666,726.20
存出保证金	108,707.81	-	-	-	-	-	108,707.81
交易性金融资产	-	-	-	46,032,492.83	57,918,031.98	116,857,341.20	220,807,866.01
应收利息	-	-	-	-	-	350,729.44	350,729.44
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,479,547.74	2,479,547.74
资产总计	16,286,673.26	-	-	46,032,492.83	57,918,031.98	119,687,618.38	239,924,816.45

负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	612,326.52	612,326.52
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	907,384.12	907,384.12
应付托管费	-	-	-	-	-	146,562.18	146,562.18
应付交易费用	-	-	-	-	-	212,962.98	212,962.98
应交税费	-	-	-	-	-	1,442,188.86	1,442,188.86
其他负债	-	-	-	-	-	50,000.00	50,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	3,371,424.66	3,371,424.66
利率敏感度缺口	16,286,673.26	-	-	46,032,492.83	57,918,031.98	116,316,193.72	236,553,391.79

注：表中所示为本集合计划资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日集合计划资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	1. 市场利率下降 25 个基点	909,619.31	1,064,824.52
	2. 市场利率上升 25 个基点	-896,960.61	-1,050,240.55

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本集合计划的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指集合计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇

率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本集合计划主要投资于证券交易所上市的股票、基金和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本集合计划管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合集合计划合同约定范围的投资品种进行投资。本集合计划管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

本集合计划通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本集合计划管理人每日对本集合计划所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行其他价格风险管理。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占集合计划资产净值比例 (%)	公允价值	占集合计划资产净值比例 (%)
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产—股票投资	96,764,261.27	49.20	116,857,341.20	49.40
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产—集合计划投资	—	—	—	—
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	96,764,261.27	49.20	116,857,341.20	49.40

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变	对资产负债表日集合计划资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	1. 沪深 300 指数上升 5%	7,405,635.57	6,972,007.21
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-7,405,635.57	-6,972,007.21

注：本集合计划管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本集合计划的其他价格风险进行分析。

上表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，股票市场指数（沪深 300）价格发生合理、可能的变动时，将对集合计划净值产生的影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

（1）公允价值

（a）金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

（b）持续的以公允价值计量的金融工具

（i）各层次金融工具公允价值

于 2021 年 06 月 30 日，本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 182,198,177.02 元，无属于第二层次和第三层次的余额（2020 年 12 月 31 日：第一层次 220,807,866.01 元，无第二层次和第三层次）。

（ii）公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本集合计划不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

（iii）第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 06 月 30 日，本集合计划未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本集合计划无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末集合计划资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占集合计划总资产的比例 (%)
1	权益投资	96,764,261.27	48.55
	其中：股票	96,764,261.27	48.55
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	85,433,915.75	42.87
	其中：债券	85,433,915.75	42.87
	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	15,122,659.91	7.59
8	其他各项资产	1,968,615.10	0.99
9	合计	199,289,452.03	100.00

注：1、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。

2、本集合计划本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占集合计划资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	57,521,065.65	29.25

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,017,033.20	1.03
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,845,047.70	2.97
M	科学研究和技术服务业	8,352,510.60	4.25
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	23,028,604.12	11.71
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	96,764,261.27	49.20

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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。

7.3 期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占集合计划资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	7,100	14,602,570.00	7.42
2	300015	爱尔眼科	170,444	12,098,115.12	6.15
3	300750	宁德时代	21,800	11,658,640.00	5.93
4	000858	五粮液	38,641	11,510,767.49	5.85
5	603259	药明康德	53,340	8,352,510.60	4.25
6	300760	迈瑞医疗	17,100	8,208,855.00	4.17
7	601888	中国中免	19,477	5,845,047.70	2.97
8	300347	泰格医药	25,300	4,890,490.00	2.49
9	300119	瑞普生物	118,200	3,997,524.00	2.03
10	600763	通策医疗	9,300	3,822,300.00	1.94
11	000516	国际医学	117,900	2,217,699.00	1.13
12	688111	金山办公	5,109	2,017,033.20	1.03
13	000568	泸州老窖	8,300	1,958,302.00	1.00
14	002371	北方华创	5,600	1,553,328.00	0.79
15	601012	隆基股份	11,940	1,060,749.60	0.54

16	002594	比亚迪	4,100	1,029,100.00	0.52
17	300896	爱美客	1,000	788,880.00	0.40
18	688050	爱博医疗	1,950	736,671.00	0.37
19	688363	华熙生物	1,496	415,678.56	0.21

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初集合计划资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初集合计划资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	11,994,865.02	5.07
2	300122	智飞生物	8,736,084.00	3.69
3	300760	迈瑞医疗	7,825,818.00	3.31
4	300015	爱尔眼科	7,164,281.42	3.03
5	603259	药明康德	7,032,035.20	2.97
6	600763	通策医疗	6,769,939.00	2.86
7	600519	贵州茅台	6,684,359.00	2.83
8	300347	泰格医药	6,363,431.00	2.69
9	605337	李子园	6,313,575.82	2.67
10	601888	中国中免	6,134,701.00	2.59
11	000568	泸州老窖	5,896,113.79	2.49
12	600276	恒瑞医药	5,853,915.00	2.47
13	300750	宁德时代	5,657,149.00	2.39
14	300119	瑞普生物	5,314,854.00	2.25
15	002821	凯莱英	5,179,738.00	2.19
16	000858	五粮液	5,123,146.00	2.17
17	601012	隆基股份	4,708,845.68	1.99
18	002493	荣盛石化	4,262,528.00	1.80
19	603501	韦尔股份	4,079,354.95	1.72
20	600309	万华化学	3,524,970.00	1.49

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初集合计划资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初集合计划资产净值比例 (%)
1	000858	五粮液	15,347,930.00	6.49
2	600519	贵州茅台	14,912,564.47	6.30
3	300750	宁德时代	14,168,588.00	5.99
4	601012	隆基股份	14,053,227.62	5.94
5	603288	海天味业	12,611,918.42	5.33
6	300122	智飞生物	12,123,485.20	5.13
7	601318	中国平安	11,383,838.30	4.81

8	601888	中国中免	10,431,988.57	4.41
9	605337	李子园	6,961,394.00	2.94
10	600276	恒瑞医药	6,552,545.20	2.77
11	000568	泸州老窖	5,580,212.00	2.36
12	000799	酒鬼酒	5,226,502.00	2.21
13	002304	洋河股份	5,089,251.00	2.15
14	002821	凯莱英	4,688,820.00	1.98
15	002568	百润股份	4,391,268.00	1.86
16	603501	韦尔股份	4,187,890.00	1.77
17	002493	荣盛石化	4,162,302.00	1.76
18	600309	万华化学	3,372,794.00	1.43
19	600763	通策医疗	3,132,710.20	1.32
20	000333	美的集团	3,114,367.00	1.32

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	179,726,535.54
卖出股票收入（成交）总额	213,239,659.94

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占集合计划资产净值比例 (%)
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）	85,433,915.75	43.44
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	85,433,915.75	43.44

7.6 期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占集合计划
----	------	------	-------	------	-------

					资产净值比例 (%)
1	128136	立讯转债	80,277	9,386,789.61	4.77
2	123111	东财转 3	61,430	8,990,280.50	4.57
3	113013	国君转债	78,220	8,800,532.20	4.47
4	127005	长证转债	74,827	8,757,752.08	4.45
5	110073	国投转债	78,020	8,400,413.40	4.27

7.7 期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本集合计划本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本集合计划本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本集合计划投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本集合计划投资的股指期货持仓和损益明细

注：本集合计划本报告期末未进行股指期货投资。

7.10.2 本集合计划投资股指期货的投资政策

本集合计划投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，以回避市场风险。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。集合计划管理人通过动态管理股指期货合约数量，以期萃取相应股票组合的超额收益。

7.11 报告期末本集合计划投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

集合计划在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

7.11.2 报告期末本集合计划投资的国债期货持仓和损益明细

注：本集合计划本报告期末未进行国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本集合计划本报告期末未进行国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 集合计划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

本集合计划持有的前十名证券的发行主体本期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。

7.12.2 集合计划投资的前十名股票是否超出集合计划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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	63,246.70
2	应收证券清算款	1,658,252.25
3	应收股利	—
4	应收利息	247,116.15
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,968,615.10

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占集合计划资产净值比例 (%)
1	128136	立讯转债	9,386,789.61	4.77
2	113013	国君转债	8,800,532.20	4.47
3	127005	长证转债	8,757,752.08	4.45
4	110073	国投转债	8,400,413.40	4.27
5	113043	财通转债	7,777,309.70	3.95
6	128035	大族转债	7,754,563.74	3.94
7	110067	华安转债	4,981,212.00	2.53
8	110075	南航转债	3,979,435.40	2.02
9	110059	浦发转债	3,910,670.40	1.99
10	123079	运达转债	1,982,504.10	1.01
11	113602	景 20 转债	1,213,114.00	0.62
12	123064	万孚转债	968,485.00	0.49

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本集合计划本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

7.12.6 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。

§ 8 集合计划份额持有人信息

8.1 期末集合计划份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 集合计划份 额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
598	111, 149. 12	-	-	66, 467, 175. 23	100. 00

8.2 期末集合计划管理人的从业人员持有本集合计划的情况

项目	持有份额总数 (份)	占集合计划总份额比例 (%)
集合计划管理人所有从业人员持有本集合计划	0. 00	0

8.3 期末集合计划管理人的从业人员持有本集合计划份额总量区间情况

项目	持有集合计划份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、集合计划投资和研 究部门负责人持有本集合计划	0
本集合计划投资经理持有本集合计划	0

§ 9 集合计划份额变动

单位：份

集合计划合同生效日 (2013 年 4 月 24 日) 集合计划份额总额	1, 307, 060, 743. 30
本报告期期初集合计划份额总额	82, 462, 718. 48
本报告期集合计划总申购份额	250, 386. 55
减：本报告期集合计划总赎回份额	16, 245, 929. 80
本报告期集合计划拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末集合计划份额总额	66, 467, 175. 23

§ 10 重大事件揭示

10.1 集合计划管理人、集合计划托管人的专门集合计划托管部门的重大人事变动

自 2021 年 3 月 12 日起，饶刚不再担任本集合计划管理人副总经理职务。

本报告期内本集合计划托管人的专门集合计划托管部门无重大人事变动。

10.2 涉及集合计划管理人、集合计划财产、集合计划托管业务的诉讼

报告期内无涉及集合计划管理人、集合计划财产、集合计划托管业务的诉讼。

10.3 集合计划投资策略的改变

本集合计划本报告期内投资策略无改变。

10.4 为集合计划进行审计的会计师事务所情况

为本集合计划进行审计的会计师事务所是普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

报告期内本集合计划未发生改聘会计师事务所的情形。

10.5 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内集合计划管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东方红-新睿 5 号集合资产管理计划 2020 年第 4 季度托管报告	公司网站 (www.dfham.com)	2021 年 1 月 22 日
2	东方红-新睿 5 号集合资产管理计划 2020 年第 4 季度报告	公司网站 (www.dfham.com)	2021 年 1 月 22 日
3	东方红-新睿 5 号集合资产管理计划 2020 年年度报告	公司网站 (www.dfham.com)	2021 年 3 月 31 日
4	东方红-新睿 5 号集合资产管理计划 2020 年年度审计报告	公司网站 (www.dfham.com)	2021 年 3 月 31 日
5	东方红-新睿 5 号集合资产管理计划 2020 年年度托管报告	公司网站 (www.dfham.com)	2021 年 3 月 31 日
6	东方红-新睿 5 号集合资产管理计划 2021 年第 1 季度托管报告	公司网站 (www.dfham.com)	2021 年 4 月 22 日
7	东方红-新睿 5 号集合资产管理计划 2021 年第 1 季度报告	公司网站 (www.dfham.com)	2021 年 4 月 22 日
8	关于东方红-新睿 5 号集合资产管理计划变更为东方红新源三年持有期混合型证券投资基金及法律文件变更的确认函及回执	公司网站 (www.dfham.com)	2021 年 6 月 4 日
9	关于东方红-新睿 5 号集合资产管理计划变更为东方红新源三年持有期混合型证券投资基金及法律文件变更的公告	公司网站 (www.dfham.com)	2021 年 6 月 4 日
10	东方红新源三年持有期混合型证券投资基金基金合同	公司网站 (www.dfham.com)	2021 年 6 月 4 日
11	东方红新源三年持有期混合型证券投资基金托管协议	公司网站 (www.dfham.com)	2021 年 6 月 4 日
12	东方红新源三年持有期混合型证券投资	公司网站	2021 年 6 月 4 日

	资基金招募说明书	(www.dfham.com)	
13	关于东方红-新睿 5 号集合资产管理计划变更为东方红新源三年持有期混合型证券投资基金及法律文件变更的征询意见函	公司网站 (www.dfham.com)	2021 年 6 月 7 日
14	关于东方红-新睿 2 号集合资产管理计划与东方红-新睿 5 号集合资产管理计划暂停办理申购业务的公告	公司网站 (www.dfham.com)	2021 年 6 月 18 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过 20%的情况

注：本集合计划本报告期内未发生单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《东方红-新睿 5 号集合资产管理计划说明书》
- 2、《东方红-新睿 5 号集合资产管理合同》
- 3、《东方红-新睿 5 号集合资产管理计划托管协议》
- 4、《东方红-新睿 5 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、《东方红-新睿 5 号集合资产管理计划年度审计报告【正本】》

12.2 存放地点

备查文件存放于集合计划管理人的办公场所：上海市黄浦区外马路 108 号 7 层。

12.3 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.dfham.com。

上海东方证券资产管理有限公司

2021 年 8 月 31 日