东方红基金宝集合资产管理计划
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：中国银行股份有限公司

送出日期：2021年8月31日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

集合计划托管人中国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合同及说明书。

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 6

§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 8

4.1 集合计划管理人及集合计划投资经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本集合计划运作遵规守信情况的说明 10
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 12
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遵规守信情况声明 12
5.2 托管人对报告期内本集合计划投资运作遵规守信、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的真实、准确和完整发表意见 13

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13

6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 14
6.3 所有者权益（集合计划净值）变动表 15
6.4 报表附注 17

§7 投资组合报告 37

7.1 期末集合计划资产组合情况 37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 37
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 38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 40
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 40

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 40
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 40
7.9 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十名基金投资明细 40
7.10 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 41
7.11 报告期末本集合计划投资的股指期货交易情况说明 41
7.12 报告期末本集合计划投资的国债期货交易情况说明 41
7.13 投资组合报告附注 42

§8 集合计划份额持有人信息 43

8.1 期末集合计划份额持有人户数及持有人结构 43
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 43
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 43

§9 集合计划份额变动 43

§10 重大事件揭示 43

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 43
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 44
10.3 集合计划投资策略的改变 44
10.4 为集合计划进行审计的会计师事务所情况 44
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 44
10.6 其他重大事件 44

§11 影响投资者决策的其他重要信息 44

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 44
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 44

§12 备查文件目录 45

12.1 备查文件目录 45
12.2 存放地点 45
12.3 查阅方式 45

§2 集合计划简介

2.1 集合计划基本情况

集合计划名称	东方红基金宝集合资产管理计划
集合计划简称	东方红基金宝集合
集合计划主代码	916001
集合计划运作方式	契约型开放式
集合计划合同生效日	2010 年 6 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	中国银行股份有限公司
报告期末集合计划份额总额	21,733,170.01 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	本集合计划主要投资于开放式基金和封闭式基金，力求有效控制投资组合风险，保障计划资产流动性，为投资者获取高于基金平均收益的回报。
投资理念	以管理人自主研究为基础，研判市场趋势，通过构建和动态调整基金投资组合有效控制风险，分享优秀集合计划管理人的研究投资成果。
业绩比较基准	中证基金指数收益率×70%＋上证国债指数收益率×25%＋一年期定期存款利率×5%。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李云亮	许俊
	联系电话	021-53952828	010-66594319
	电子邮箱	service@dfham.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4009200808	95566
传真		021-63326381	010-66594942
注册地址		上海市黄浦区中山南路 109 号 7 层-11 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		上海市黄浦区外马路 108 号 7 层-11 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200010	100818
法定代表人		宋雪枫	刘连舸

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	8,117,871.41
本期利润	2,823,133.92
加权平均集合计划份额本期利润	0.1266
本期加权平均净值利润率	3.15%
本期集合计划份额净值增长率	3.53%
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	66,833,895.01
期末可供分配集合计划份额利润	3.0752
期末集合计划资产净值	88,567,065.02
期末集合计划份额净值	4.0752
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	337.11%

注：1、上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	0.19%	0.95%	0.89%	0.36%	-0.70%	0.59%
过去三个月	6.84%	1.13%	4.83%	0.37%	2.01%	0.76%
过去六个月	3.53%	1.60%	4.28%	0.52%	-0.75%	1.08%
过去一年	30.80%	1.57%	12.54%	0.48%	18.26%	1.09%
过去三年	62.59%	1.42%	32.09%	0.44%	30.50%	0.98%
自集合计划合同生效起至今	337.11%	1.26%	104.91%	0.58%	232.20%	0.68%

注：本集合计划的业绩比较基准为：中证基金指数收益率×70%＋上证国债指数收益率×25%＋一年期定期存款利率×5%。

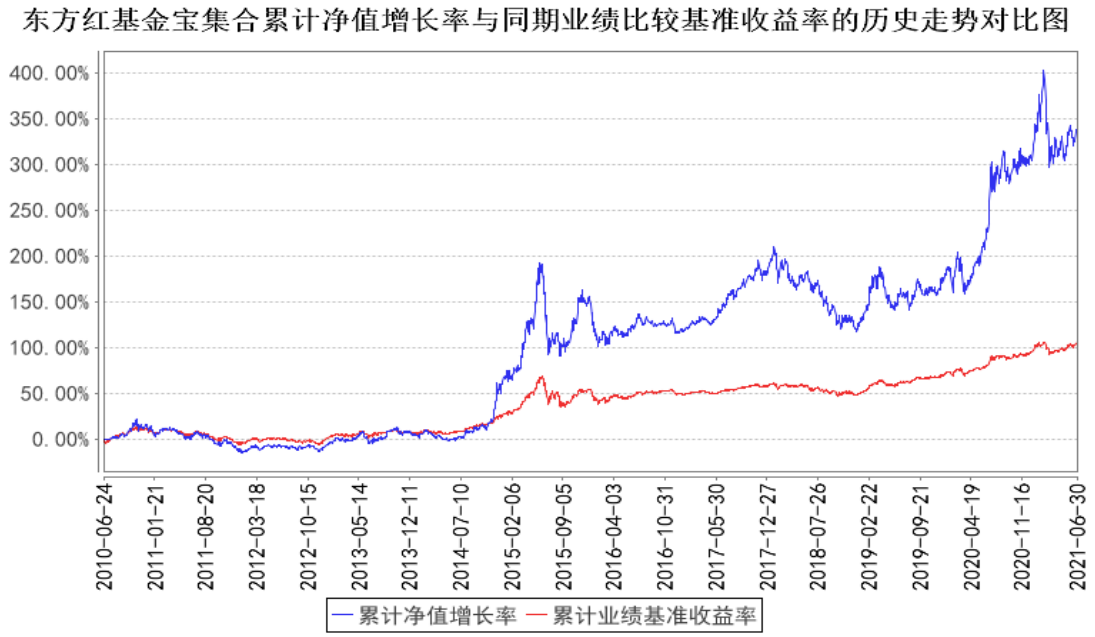
benchmarkt=70%*[t 日中证基金指数/(t-1 日中证基金指数)-1]+25%* [t 日上证国债指数/(t-1 日上证国债指数)-1]+ 5%*（t 日人民币活期存款利率（税后）/365）

期间 T 日收益率（benchmarkT）按下列公式计算：

benchmarkT=[∏(1+benchmarkt)]-1，其中 t=1,2,3,．．．T，T 表示时间截至日；

∏(1+benchmarkt)表示(1+benchmarkt)的数学连乘。

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



§4 管理人报告

4.1 集合计划管理人及集合计划投资经理情况

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“公开募集证券投资基金管理业务资格”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	本集合资产管理计划投资经理。	2014 年 4 月 8 日	-	12 年	北京大学经济学博士。曾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宏观策略研究员、投资主办人、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遵规守信情况的说明

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，增配了医药、电动车、半导体、科创板等行业。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 4.0752 元，份额累计净值为 4.2402 元；本报告期集合计划份额净值增长率为 3.53%，业绩比较基准收益率为 4.28%。

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内未进行利润分配。

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，本集合计划于 2021 年 3 月 26 日至 2021 年 6 月 30 日存在集合计划份额持有人数量不满二百人的情形；报告期内，本集合计划未出现连续二十个工作日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遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在东方红基金宝集合资产管理计划（以下称“本集合计划”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、集合计划合同和托管协议的有关规定，不存在损害集合计划份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、集合计划合同和托管协议的规定，对本集合计划管理人的投资运作进行了必要的监督，对集合计划资产净值的计算、集合计划份额申购赎回价格的计算以及集合计划费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本集合计划管理人存在损害集合计划份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“ 关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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：东方红基金宝集合资产管理计划

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	5,286,167.14	5,304,009.75
结算备付金		65,547.29	550,435.14
存出保证金		15,576.39	64,998.19
交易性金融资产	6.4.7.2	83,857,473.59	85,425,777.98
其中：股票投资		25,730,373.59	26,869,200.38
基金投资		58,127,100.00	56,494,400.00
债券投资		-	2,062,177.60
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		109,439.31	443,356.86
应收利息	6.4.7.5	551.99	2,243.30
应收股利		-	-
应收申购款		-	98,598.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		89,334,755.71	91,889,419.72
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		147,624.42	179,241.45
应付赎回款		-	1,273,713.97

应付管理人报酬		107,543.41	112,290.08
应付托管费		17,923.90	18,715.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	38,386.45	47,458.97
应交税费		411,336.12	503,093.79
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	44,876.39	36,400.57
负债合计		767,690.69	2,170,913.84
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	21,733,170.01	22,793,650.52
未分配利润	6.4.7.10	66,833,895.01	66,924,855.36
所有者权益合计		88,567,065.02	89,718,505.88
负债和所有者权益总计		89,334,755.71	91,889,419.72

注： 报告截止日 2021 年 06 月 30 日，集合计划份额净值 4.0752 元，集合计划份额总额 21,733,170.01 份。

6.2 利润表

会计主体：东方红基金宝集合资产管理计划

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		3,839,164.59	13,634,658.69
1.利息收入		15,387.11	91,089.02
其中：存款利息收入	6.4.7.11	13,616.16	10,434.93
债券利息收入		970.34	80,654.09
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		800.61	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		9,137,644.89	5,961,671.79
其中：股票投资收益	6.4.7.12	5,334,366.52	1,715,242.54
基金投资收益	6.4.7.13	3,678,874.91	4,325,638.03
债券投资收益	6.4.7.14	22,501.14	-232,235.78
资产支持证券投资收	6.4.7.14.5	-	-

益			
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	101,902.32	153,027.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-5,313,867.41	7,581,897.88
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-	-
减：二、费用		1,016,030.67	955,654.37
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	670,790.25	508,360.85
2．托管费	6.4.10.2.2	111,798.34	84,726.87
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	6.4.7.20	203,151.71	286,314.75
5．利息支出		-	11,861.63
其中：卖出回购金融资产支出		-	11,861.63
6．税金及附加		13,401.77	48,217.90
7．其他费用	6.4.7.21	16,888.60	16,172.37
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,823,133.92	12,679,004.32
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,823,133.92	12,679,004.32

6.3 所有者权益（集合计划净值）变动表

会计主体：东方红基金宝集合资产管理计划

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）	22,793,650.52	66,924,855.36	89,718,505.88
二、本期经营活动产生的集合计划净值变动数（本期利润）	-	2,823,133.92	2,823,133.92
三、本期集合计划份额交易产生的集合计划净值	-1,060,480.51	-2,914,094.27	-3,974,574.78

变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.集合计划申购款	1,349,787.57	4,369,355.93	5,719,143.50
2.集合计划赎回款	-2,410,268.08	-7,283,450.20	-9,693,718.28
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）	21,733,170.01	66,833,895.01	88,567,065.02
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）	27,020,717.50	42,899,839.43	69,920,556.93
二、本期经营活动产生的集合计划净值变动数（本期利润）	-	12,679,004.32	12,679,004.32
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）	-2,905,495.66	-4,561,139.20	-7,466,634.86
其中：1.集合计划申购款	1,717,733.45	2,951,265.05	4,668,998.50
2.集合计划赎回款	-4,623,229.11	-7,512,404.25	-12,135,633.36
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	24,115,221.84	51,017,704.55	75,132,926.39

净值）			

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

东方红基金宝集合资产管理计划(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 392,291,777.50 元，业经立信会计师事务所有限公司信会师报字(2010)第 24596 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 2010 年 6 月 24 日成立，成立日的集合计划份额总额为 392,397,424.74 份，其中有效参与资金利息折合 105,647.24 份集合计划份额。本集合计划管理人为东证资管，托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《东方红基金宝集合资产管理合同》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、沪港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票、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、国债期货等金融衍生品、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。本集合计划主要投资于开放式基金和封闭式基金，同时积极参与新股新券申购，另外也配置部分固定收益类资产。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《东方红基金宝集合资产管理合同》及《东方红基金宝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

本集合计划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税务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 日前取得的基金、非货物期货，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集合计划份额净值、非货物期货结算价格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。集合计划通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(4)本集合计划的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费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	5,286,167.14
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	5,286,167.14

6.4.7.2 交易性金融资产

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		20,351,591.41	25,730,373.59	5,378,782.18
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		53,718,936.31	58,127,100.00	4,408,163.69
其他		-	-	-
合计		74,070,527.72	83,857,473.59	9,786,945.87

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从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	487.65
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	57.52
应收债券利息	-
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	6.82
合计	551.99

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	38,386.45
银行间市场应付交易费用	-
合计	38,386.45

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	44,876.39
合计	44,876.39

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	22,793,650.52	22,793,650.52
本期申购	1,349,787.57	1,349,787.57
本期赎回（以“-”号填列）	-2,410,268.08	-2,410,268.08
- 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	21,733,170.01	21,733,170.01

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	62,125,001.54	4,799,853.82	66,924,855.36
本期利润	8,117,871.41	-5,294,737.49	2,823,133.92
本期集合计划份额交易产生的变动数	-3,049,864.28	135,770.01	-2,914,094.27
其中：集合计划申购款	3,933,587.43	435,768.50	4,369,355.93
集合计划赎回款	-6,983,451.71	-299,998.49	-7,283,450.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	67,193,008.67	-359,113.66	66,833,895.01

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	11,120.08
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	2,245.62
其他	250.46
合计	13,616.16

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	5,334,366.52
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	5,334,366.52

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	27,206,159.43
减：卖出股票成本总额	21,871,792.91
买卖股票差价收入	5,334,366.52

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内无股票投资收益-证券出借差价收入。

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	62,446,781.85
减：卖出/赎回基金成本总额	58,767,906.94
基金投资收益	3,678,874.91

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 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	22,501.14
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	22,501.14

6.4.7.14.2 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	7,994,969.70
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	7,961,745.22
减：应收利息总额	10,723.34
买卖债券差价收入	22,501.14

6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本集合计划本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本集合计划本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

注：本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

注：本集合计划本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15.2 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内无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本集合计划本报告期内无贵金属投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本集合计划本报告期内无贵金属投资收益-申购差价收入。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本集合计划本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本集合计划本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.17 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	101,902.32
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	101,902.32

6.4.7.18 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	-5,473,283.43
股票投资	-2,726,317.21
债券投资	7,593.39
资产支持证券投资	-
基金投资	-2,754,559.61
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	-159,416.02
合计	-5,313,867.41

6.4.7.19 其他收入

注：本集合计划本报告期内无其他收入。

6.4.7.20 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	77,549.82
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	125,601.89
其中：申购费	-
赎回费	-
交易费	125,601.89
合计	203,151.71

6.4.7.21 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	14,876.39
信息披露费	-
证券出借违约金	-

银行费用	2,012.21
合计	16,888.60

6.4.7.22 分部报告

本集合计划以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本集合计划内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本集合计划管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本集合计划能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本集合计划目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

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

截至财务报表报出日，本集合计划并无须作披露的资产负债表日后事项。

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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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	50,394,370.49	100.00	89,526,661.46	100.00

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	13,895,180.10	100.00	45,560,301.73	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

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	占当期债券回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）
东方证券	12,500,000.00	100.00	37,000,000.00	100.00

6.4.10.1.4 基金交易

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	占当期基金成交总额的比例（%）	成交金额	占当期基金成交总额的比例（%）
东方证券	125,601,948.40	100.00	159,618,584.24	100.00

6.4.10.1.5 权证交易

注：本集合计划本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

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	上年度可比期间

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	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	670,790.25	508,360.85

注：1、本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 1.5%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.5%÷当年天数

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

2、本集合计划不收取业绩报酬。

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	111,798.34	84,726.87

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×0.25%÷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内及上年度可比期间未发生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内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
中国银行	5,286,167.14	11,120.08	2,461,512.26	7,743.01

注：本集合计划的银行存款由本集合计划托管人中国银行保管，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 6 月 30 日，本集合计划的结算备付金余额为 20,994.20 元，无存出保证金余额(2020 年 12 月 31 日：结算备付金 20,918.00 元，无存出保证金余额)。于 2021 年上半年，本集合计划当期结算备付金利息收入 75.78 元(2020 年同期：75.69 元)。

6.4.11 利润分配情况

注：本集合计划本报告期内未进行利润分配。

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：本集合计划本报告期末无因认购新发/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的各类重大风险，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本集合计划托管人中国银行，因而与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以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制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无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

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无按短期信用评级列示的同业存单投资。

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	-	1,057,560.00
AAA 以下	-	1,004,617.60
未评级	-	-
合计	-	2,062,177.60

注：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无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无按长期信用评级列示的同业存单投资。

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。

针对由于参与资金建仓而可能产生的流动性风险，本集合计划管理人通过灵活的交易模型，使集合计划的建仓对市场的人为影响减少到最小；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。

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，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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、债券投资和买入返售金融资产等，其余金融资产及金融负债不计息。本集合计划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	5,286,167.14	-	-	-	-	-	5,286,167.14
结算备付金	65,547.29	-	-	-	-	-	65,547.29
存出保证金	15,576.39	-	-	-	-	-	15,576.39
交易性金融资产	-	-	-	-	-	83,857,473.59	83,857,473.59
应收利息	-	-	-	-	-	551.99	551.99
应收证券清算	-	-	-	-	-	109,439.3	109,439.31

款						1	
资产总计	5,367,290.82	-	-	-	-	83,967,464.89	89,334,755.71
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	107,543.41	107,543.41
应付托管费	-	-	-	-	-	17,923.90	17,923.90
应付证券清算款	-	-	-	-	-	147,624.42	147,624.42
应付交易费用	-	-	-	-	-	38,386.45	38,386.45
应交税费	-	-	-	-	-	411,336.12	411,336.12
其他负债	-	-	-	-	-	44,876.39	44,876.39
负债总计	-	-	-	-	-	767,690.69	767,690.69
利率敏感度缺口	5,367,290.82	-	-	-	-	83,199,774.20	88,567,065.02
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	5,304,009.75	-	-	-	-	-	5,304,009.75
结算备付金	550,435.14	-	-	-	-	-	550,435.14
存出保证金	64,998.19	-	-	-	-	-	64,998.19
交易性金融资产	-	-	-	-	2,062,177.60	83,363,600.38	85,425,777.98
应收利息	-	-	-	-	-	2,243.30	2,243.30
应收申购款	-	-	-	-	-	98,598.50	98,598.50
应收证券清算款	-	-	-	-	-	443,356.86	443,356.86
资产总计	5,919,443.08	-	-	-	2,062,177.60	83,907,799.04	91,889,419.72
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,273,713.97	1,273,713.97
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	112,290.08	112,290.08
应付托管费	-	-	-	-	-	18,715.01	18,715.01
应付证券清算款	-	-	-	-	-	179,241.45	179,241.45
应付交易费用	-	-	-	-	-	47,458.97	47,458.97
应交税费	-	-	-	-	-	503,093.79	503,093.79

其他负债	-	-	-	-	-	36,400.57	36,400.57
负债总计	-	-	-	-	-	2,170,913.84	2,170,913.84
利率敏感度缺口	5,919,443.08	-	-	-	2,062,177.60	81,736,885.20	89,718,505.88

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	-	27,453.39
	2.市场利率上升 25 个基点	-	-27,024.78

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。本集合计划持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	11,208,383.87	-	11,208,383.87
资产合计	-	11,208,383.87	-	11,208,383.87
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-

资产负债表外汇风险敞口净额	-	11,208,383.87	-	11,208,383.87
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	12,970,177.38	-	12,970,177.38
资产合计	-	12,970,177.38	-	12,970,177.38
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	12,970,177.38	-	12,970,177.38

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外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、港币相对人民币升值 5%	560,419.19	648,508.87
	2、港币相对人民币贬值 5%	-560,419.19	-648,508.87

6.4.13.4.3 其他价格风险

本集合计划承受的其他价格风险，主要是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。本集合计划的其他价格风险，主要受到证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。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	25,730,373.59	29.05	26,869,200.38	29.95
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产－基金投资	58,127,100.00	65.63	56,494,400.00	62.97
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	83,857,473.59	94.68	83,363,600.38	92.92

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.沪深 300 指数上升 5%	1,643,028.33	1,556,472.13
	2.沪深 300 指数下降 5%	-1,643,028.33	-1,556,472.13

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 6 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 83,857,473.60 元，无属于第二、第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 85,425,777.98 元，无第二、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 6 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	25,730,373.59	28.80
	其中：股票	25,730,373.59	28.80
2	基金投资	58,127,100.00	65.07
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	5,351,714.43	5.99
8	其他各项资产	125,567.69	0.14
9	合计	89,334,755.71	100.00

注：1、本集合计划本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 11,208,383.87 元人民币，占期末集合计划资产净值比例 12.66%。

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	9,740,244.00	11.00
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	-	-
J	金融业	-	-

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,879,080.00	2.12
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	2,902,665.72	3.28
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	14,521,989.72	16.40

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占集合计划资产净值比例（%）
00 能源	0.00	0.00
01 原材料	0.00	0.00
02 工业	0.00	0.00
03 可选消费	4,745,452.09	5.36
04 主要消费	0.00	0.00
05 医药卫生	0.00	0.00
06 金融地产	0.00	0.00
07 信息技术	6,462,931.78	7.30
08 电信业务	0.00	0.00
09 公用事业	0.00	0.00
合计	11,208,383.87	12.66

注：以上分类采用中证行业分类标准。

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	00700	腾讯控股	13,300	6,462,931.78	7.30
2	600519	贵州茅台	3,000	6,170,100.00	6.97
3	03690	美团-W	17,800	4,745,452.09	5.36
4	300015	爱尔眼科	32,414	2,300,745.72	2.60
5	603259	药明康德	12,000	1,879,080.00	2.12
6	000858	五 粮 液	6,000	1,787,340.00	2.02
7	300750	宁德时代	2,400	1,283,520.00	1.45
8	000516	国际医学	32,000	601,920.00	0.68
9	002371	北方华创	1,800	499,284.00	0.56

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	00700	腾讯控股	3,789,101.92	4.22
2	300750	宁德时代	3,112,979.00	3.47
3	03690	美团-W	2,625,547.96	2.93
4	603259	药明康德	1,818,915.80	2.03
5	300015	爱尔眼科	1,576,120.00	1.76
6	300122	智飞生物	1,412,369.00	1.57
7	600519	贵州茅台	1,217,999.00	1.36
8	300059	东方财富	1,092,444.00	1.22
9	601888	中国中免	851,045.00	0.95
10	300782	卓胜微	716,747.00	0.80
11	601318	中国平安	684,701.00	0.76
12	000516	国际医学	597,114.00	0.67
13	002371	北方华创	504,060.00	0.56
14	300119	瑞普生物	475,751.00	0.53
15	00941	中国移动	417,647.43	0.47
16	601899	紫金矿业	409,480.00	0.46
17	300142	沃森生物	409,478.00	0.46
18	002475	立讯精密	376,638.00	0.42
19	603501	韦尔股份	345,094.00	0.38
20	09922	九毛九	205,091.95	0.23

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	03690	美团-W	6,470,750.42	7.21
2	300122	智飞生物	2,725,926.00	3.04
3	00700	腾讯控股	2,548,271.74	2.84
4	300750	宁德时代	2,150,917.77	2.40
5	600519	贵州茅台	1,265,672.00	1.41
6	000858	五 粮 液	1,192,140.00	1.33
7	300059	东方财富	1,117,279.80	1.25
8	601012	隆基股份	1,057,700.00	1.18
9	601888	中国中免	923,140.00	1.03
10	603259	药明康德	921,641.00	1.03
11	000568	泸州老窖	786,272.00	0.88
12	000799	酒鬼酒	716,630.00	0.80
13	300782	卓胜微	710,784.00	0.79
14	601318	中国平安	679,084.00	0.76

15	300119	瑞普生物	458,948.00	0.51
16	300142	沃森生物	446,528.00	0.50
17	00388	香港交易所	414,610.35	0.46
18	00941	中国移动	398,985.62	0.44
19	601899	紫金矿业	390,011.00	0.43
20	002475	立讯精密	339,175.00	0.38

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	23,188,211.06
卖出股票收入（成交）总额	27,206,159.43

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

注：本集合计划本报告期末未持有债券。

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

注：本集合计划本报告期末未持有债券。

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 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十名基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占集合计划资产净值比例（%）	是否属于集合计划管理人及管理人关联方所管理的基金
1	513050	易中证海外中国互联网50(QDII-ETF)	交易型开放式(ETF)	4,500,000.00	8,694,000.00	9.82	否
2	164906	中国互联	上市契约型	4,500,000.00	8,104,500.00	9.15	否

			开放式(LOF)				
3	515650	富国中证消费50ETF	交易型开放式(ETF)	4,000,000.00	6,632,000.00	7.49	否
4	588000	华夏上证科创板 50 成份 ETF	交易型开放式(ETF)	4,000,000.00	6,592,000.00	7.44	否
5	513100	国泰纳斯达克100(QDII-ETF)	交易型开放式(ETF)	1,200,000.00	5,804,400.00	6.55	否
6	512690	鹏华中证酒 ETF	交易型开放式(ETF)	4,000,000.00	5,692,000.00	6.43	否
7	512170	华宝中证医疗 ETF	交易型开放式(ETF)	6,000,000.00	5,646,000.00	6.37	否
8	159949	创业板 50	交易型开放式(ETF)	2,200,000.00	3,388,000.00	3.83	否
9	515170	华夏中证细分食品饮料产业主题 ETF	交易型开放式(ETF)	3,000,000.00	2,823,000.00	3.19	否
10	512760	国泰 CES 半导体芯片 ETF	交易型开放式(ETF)	1,200,000.00	1,818,000.00	2.05	否

7.10 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。

7.11 报告期末本集合计划投资的股指期货交易情况说明

7.11.1 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未进行股指期货投资。

7.11.2 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的主要目的是回避市场风险和实施套利策略。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。管理人通过动态管理股指期货合约数量，以萃取相应股票组合的超额收益或获取低风险套利收益。另外，管理人在控制风险的前提下也会进行少量的投机交易，以更好地提高产品收益。

7.12 报告期末本集合计划投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 本期国债期货投资政策

本集合计划参与国债期货的主要目的是套期保值和套利，在控制风险的前提下也会进行少量的投机交易，以更好地提高产品收益。管理人将根据不同的市场行情动态管理国债期货合约数量，在控制风险的前提下萃取收益。

7.12.2 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未进行国债期货投资。

7.12.3 本期国债期货投资评价

本集合计划本报告期未进行国债期货投资。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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

本集合计划投资的腾讯控股（代码：00700）的发行主体腾讯控股有限公司因未依法申报违法实施的经营者集中行为于 2021 年 3 月 12 日被市场监管总局罚款 50 万元人民币。

本集合计划持有的美团-W（代码：03690）的发行主体美团集团股份有限公司于 2021 年 4 月 26 日因实施“二选一”等涉嫌垄断行为被国家市场监督管理总局通知依法进行立案调查。

本集合计划对上述证券的投资决策程序符合集合计划合同及公司制度的相关规定，本集合计划管理人会对上述证券继续保持跟踪研究。

本集合计划持有的前十名证券中其余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。

7.13.2 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

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。

7.13.3 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	15,576.39
2	应收证券清算款	109,439.31
3	应收股利	-
4	应收利息	551.99
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	125,567.69

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本集合计划本报告期末未持有处于转股期的可转债。

7.13.5 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不存在流通受限情况。

7.13.6 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（%）
193	112,607.10	-	-	21,733,170.01	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	194,488.59	0.89

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	10~50

§9 集合计划份额变动

单位：份

集合计划合同生效日（2010 年 6 月 24 日）集合计划份额总额	392,397,424.74
本报告期期初集合计划份额总额	22,793,650.52
本报告期集合计划总申购份额	1,349,787.57
减：本报告期集合计划总赎回份额	2,410,268.08
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	21,733,170.01

§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	东方红基金宝集合资产管理计划 2020 年第 4 季度托管报告	公司官网	2021 年 1 月 22 日
2	东方红基金宝集合资产管理计划 2020 年第 4 季度报告	公司官网	2021 年 1 月 22 日
3	东方红基金宝集合资产管理计划 2020 年年度报告	公司官网	2021 年 3 月 31 日
4	东方红基金宝集合资产管理计划 2020 年年度审计报告	公司官网	2021 年 3 月 31 日
5	东方红基金宝集合资产管理计划 2020 年年度托管报告	公司官网	2021 年 3 月 31 日
6	东方红基金宝集合资产管理计划 2021 年第 1 季度托管报告	公司官网	2021 年 4 月 22 日
7	东方红基金宝集合资产管理计划 2021 年第 1 季度报告	公司官网	2021 年 4 月 22 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无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、《东方红基金宝集合资产管理计划说明书》；

2、《东方红基金宝集合资产管理计划合同》；

3、《东方红基金宝集合资产管理计划托管协议》；

4、《东方红基金宝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、《东方红基金宝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