

东方红添鑫 11 号集合资产管理计划 2021 年第 4 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：中国工商银行股份有限公司福建省分行

报告期间：2021 年 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日

报告送出日期：2022 年 01 月 26 日

重要提示

本资产管理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资产管理计划资产，但不保证本资产管理计划一定盈利。

本资产管理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资产管理计划合同及说明书。

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：	东方红添鑫 11 号集合资产管理计划
合同生效时间：	2021 年 7 月 16 日
管理人：	上海东方证券资产管理有限公司
托管人：	中国工商银行股份有限公司福建省分行

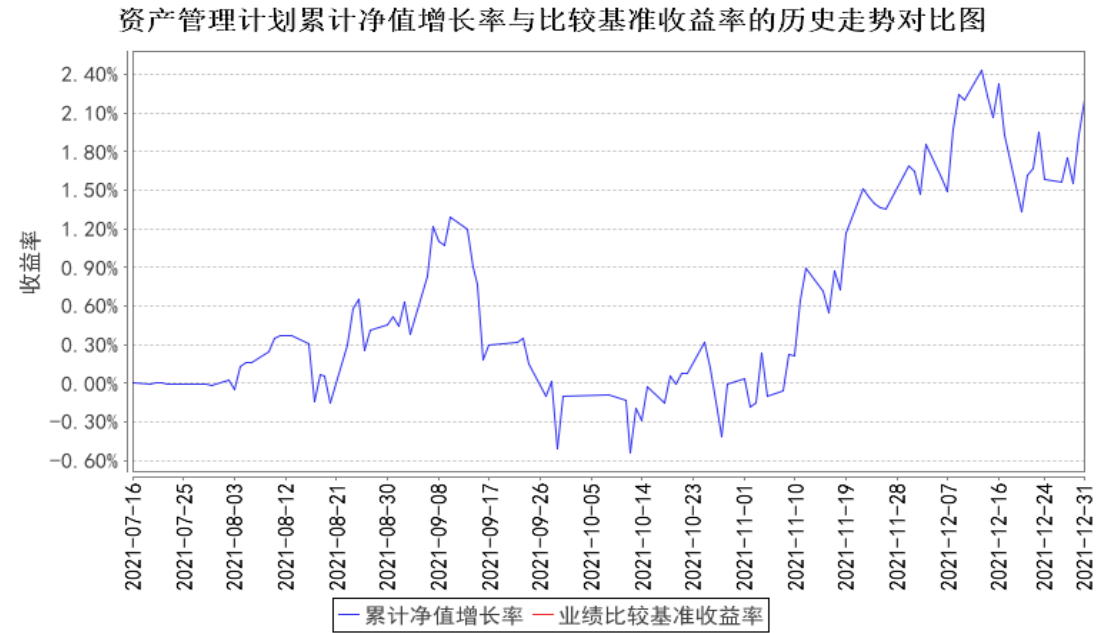
二、资产管理计划投资表现

(一) 主要财务指标

	本期末
期末资产净值(元)	102,042,484.43
本期利润(元)	2,297,411.69
期末资产管理计划可分配利润	432,101.20
期末份额净值(元)	1.0220
期末份额累计净值(元)	1.0220
本期资产管理计划净值增长率	2.30%
资产管理计划累计净值增长率	2.20%

注：本期期末资产管理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参与资产管理计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(二) 资产管理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



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	5,021,783.30	4.92
	其中：境内股票	5,021,783.30	4.92
	港股投资	-	-
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	基金投资	91,854,001.21	89.94
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	249,654.91	0.24
7	其他资产	5,005,630.84	4.90
8	资产合计	102,131,070.26	100.00

注：“其他资产”包括“应收红利”、“应收利息”、“其他应收款”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全部股票明细

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(%)
601985	中国核电	59,800.00	496,340.00	0.49
600030	中信证券	18,400.00	485,944.00	0.48
688396	华润微	6,639.00	428,879.40	0.42
601669	中国电建	43,400.00	350,672.00	0.34
688390	固德威	705.00	324,003.90	0.32
002352	顺丰控股	4,700.00	323,924.00	0.32
002385	大北农	30,600.00	320,994.00	0.31
601636	旗滨集团	18,300.00	312,930.00	0.31
600019	宝钢股份	42,800.00	306,448.00	0.30
600483	福能股份	18,100.00	294,668.00	0.29
300014	亿纬锂能	2,400.00	283,632.00	0.28
603218	日月股份	7,500.00	247,125.00	0.24
688186	广大特材	5,500.00	245,355.00	0.24
601222	林洋能源	16,800.00	203,784.00	0.20
002487	大金重工	5,200.00	201,500.00	0.20
301033	迈普医学	3,200.00	195,584.00	0.19

(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
本资产管理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十名资产支持
证券明细

本资产管理计划本报告期末未持有资产支持证券。

(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全部基金明细

基金代 码	基金名称	持仓数量(份)	市值(元)	市值占委托资产 净值比例(%)
004933	招商丰拓灵活混合 C	4,315,099.01	7,316,250.37	7.17
001405	东方红策略精选混合 A	4,380,989.14	6,228,452.26	6.10
002783	东方红价值精选混合 A	4,211,908.00	6,131,695.67	6.01
003327	万家鑫璟纯债债券 A	4,928,507.42	5,849,152.61	5.73
001447	天弘惠利混合	3,152,089.96	5,704,337.20	5.59
005552	国富新趋势混合 A	4,190,956.89	5,223,189.57	5.12
001147	中欧瑾源灵活配置混合 C	3,325,716.18	5,124,596.06	5.02
161722	招商丰泰灵活配置混合 (LOF)	3,550,426.14	5,101,962.36	5.00
002017	招商瑞丰灵活配置混合发 起式 C	2,325,234.12	4,220,299.93	4.14
005865	浦银安盛量化多策略混合 A	2,722,029.25	4,049,835.12	3.97

002513	金鹰元安混合 C	2,248,409.72	3,576,545.34	3.50
210011	金鹰灵活配置混合 C	1,947,293.26	3,118,979.61	3.06
002144	华安新优选灵活配置混合 C	2,165,940.56	3,103,792.82	3.04
003435	博时鑫泽混合 C	1,362,356.95	3,054,404.28	2.99
001862	东方红收益增强债券 A	2,585,416.65	3,047,689.15	2.99
501073	华安科创主题混合	2,610,897.00	2,960,757.20	2.90
000314	招商瑞丰灵活配置混合发起式 A	1,442,498.56	2,698,914.81	2.64
001503	南方利鑫混合 C	1,783,400.64	2,685,801.36	2.63
11616	国投瑞银瑞祥灵活配置混合 C	1,183,501.98	2,025,681.99	1.99
11232	光大保德信锦弘混合 C	1,408,294.46	1,462,654.63	1.43
005821	万家新机遇龙头企业混合 A	379,958.96	1,013,274.55	0.99
516970	广发中证建设工程 ETF	822,300.00	996,627.60	0.98
501078	广发科创主题 3 年封闭混合	384,681.00	970,550.16	0.95
513090	易方达中证香港证券投资主题 ETF	744,000.00	964,224.00	0.94
001410	信达澳银新能源产业股票	151,684.60	813,636.19	0.80
003751	万家瑞隆混合	222,850.12	596,280.07	0.58
001475	易方达国防军工混合	254,330.68	553,423.56	0.54
501075	万家科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合 A	247,104.00	530,779.39	0.52
515790	华泰柏瑞中证光伏产业 ETF	307,600.00	526,611.20	0.52
516950	银华中证基建 ETF	457,800.00	511,820.40	0.50
510410	博时上证自然资源 ETF	448,000.00	479,360.00	0.47
001605	国富沪港深成长精选股票	188,967.12	471,850.90	0.46
010055	万家健康产业混合 C	241,080.04	302,941.18	0.30
506002	易方达科创板两年定期开放混合	236,497.00	280,958.44	0.28
501025	鹏华香港银行指数 (LOF) A	166,300.00	156,671.23	0.15

(六) 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
本资产管理计划本报告期末未持有期权。

(七) 报告期末期货投资情况

本资产管理计划本报告期末未持有期货。

(八) 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
本资产管理计划本报告期末未持有权证。

(九) 资产管理计划运用杠杆情况

本资产管理计划本报告期末，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) 投资经理情况

投资经理姓名	学历	证券从业年限	主要工作经历
桑柳玉	上海财经大学经济学硕士	10 年	上海东方证券资产管理有限公司投资经理，上海财经大学经济学硕士，证券从业 10 年，曾任海通证券研究所研究员、凯石财富研究部首席分析师、凯石基金管理有限公司 FOF 投资部负责人。

(二) 投资策略回顾与展望

市场回顾方面，股市方面，2021 年四季度市场始终在对经济、通胀、政策的担忧中来回摇摆，因此呈现出非常明显的结构分化，成长、周期、防御三类属性资产轮番表现，总体成长占优。债市方面，利率债四季度上涨，反映出市场对经济下行的预期非常一致，而信用债方面，则相对艰难，地产债依然水生火热，高等级信用债的信用利差又极小，获取收益难度非常大。

投资运作上，组合四季度总体配置上高配了权益资产，主要以成长风格基金为主，同时阶段性参与了光伏、军工、基建、地产等主题基金。债券资产方面，主要以有打新增强为主的偏债混合型基金为主，少量配置了利率交易策略基金。

展望一季度，经济下行，通胀压力缓解，以及信贷难以大幅提升是我们对宏观环境的基本展望，结合当前各类资产的价格，组合在股债上相较于四季度会降低权益资产仓位，增加债券资产仓位。债券资产上，依然偏好利率交易策略的基金，但会密切关注信用市场，在一季度可能会有比较好的参与信用债基金的机会。

(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

本资产管理计划管理人一贯公平对待旗下管理的所有计划和组合，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

本资产管理计划的投资决策、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 2021年10月1日至2021年 12月31日	上季度可比期间 2021年7月16日至2021 年9月30日
当期发生的资产管理计划应支付的管理费	64,572.43	42,068.24

注：本计划投资于本计划管理人所管理的公开募集证券投资基金的部分不收取管理费。本计划的管理费按前一日资产管理计划资产净值扣除所持有本计划管理人管理的公开募集证券投资基金的基金份额的资产净值后的余额（若为负数，则取0）的0.30%来计提管理费。计算方法如下：

$$G=E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

G为每日应计提的资产管理计划财产管理费

E为前一日资产管理计划资产净值扣除所持有本计划管理人管理的公开募集证券投资基金的基金份额的资产净值后的余额（若为负数，则取0）

资产管理计划财产管理费自资产计划成立日起，每日计提，按自然季度支付。

（二）资产管理计划托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年10月1日至2021年 12月31日	上季度可比期间 2021年7月16日至2021 年9月30日
当期发生的资产管理计划应支付的托管费	2,537.06	1,626.73

注：本资产管理计划财产年托管费率为[0.01]%。计算方法如下：

$$H=E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的资产管理计划财产托管费

E为前一日计划资产净值

资产管理计划财产托管费自资产计划成立日起，每日计提，按自然季度支付。

（三）业绩报酬

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 10 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上季度可比期间 2021 年 7 月 16 日至 2021 年 9 月 30 日
当期计提的业绩报酬	-	-

注：业绩报酬计提日为委托人退出日或本集合计划终止日。

以投资者年化收益率，作为计提业绩报酬的基准。本集合计划的业绩报酬计提基准是年化 5.5%。当年化收益率不高于 5.5%时，管理人不提取业绩报酬；当年化收益率高于 5.5%时，管理人对超过 5.5%的收益部分提取 10%的业绩报酬。在委托人退出和集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬 H 从退出资金中扣除。

具体计算方法如下：

业绩报酬计提标准	计提比例	业绩报酬(H)
当 $R \leq 5.5\%$ 时	0	不提取业绩报酬
当 $R > 5.5\%$ 时	10%	$H = N * P * (R - 5.5\%) \times 10\% * T / 365$

其中：R 为投资者每笔认购的年化收益率；

$R = 100\% \times (P1 - P0) / P \times (365 \div T)$ 。

P1=集合计划业绩报酬提取日该笔份额累计净值；

P0=集合计划该笔份额参与日份额累计净值；

P=集合计划该笔份额参与日份额单位净值；

T=投资者上一个业绩报酬计提日（不含）到本次业绩报酬计提日（含）的天数；未计提过业绩报酬的首个业绩报酬计提日为投资者份额认购/参与确认日；

H=集合计划本笔退出份额管理人业绩报酬；

N=集合计划本笔退出份额；

业绩报酬在业绩报酬计提日计提，由管理人在计提当日向托管人发送业绩报酬计提金额，托管人复核后据此计提应付管理人业绩报酬。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

特别声明：业绩报酬计提基准仅作为业绩报酬计算依据，不作为管理人对集合计划收益率的承诺或保证。

（3）业绩报酬支付

由管理人向托管人发送业绩报酬划款指令，托管人于 5 个工作日内将业绩报酬划拨给登记结算机构或管理人账户。划拨至登记结算机构的，由登记结算机构将业绩报酬支付给管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

七、本报告期资产管理计划投资收益分配情况

本报告期内，本资产管理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）投资经理变更

本报告期内本资产管理计划投资经理没有发生变更。

（二）公司关联人员及自有资金的持有情况

项目	持有计划份额总量的数量区间（万份）
管理人董事、监事、从业人员及其配偶参与本计划的情况	0
控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本计划的情况	0
管理人自有资金参与本计划的情况	0

注：数量区间：0、0~50、50~100、100~500、500~1000、1000~2000、>2000

（三）重大关联交易情况

本报告期内本资产管理计划未发生重大关联交易。

（四）其他

本报告期内本资产管理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
2022年01月26日