

---

# 上海东方证券资产管理有限公司

## 旗下集合资产管理计划风险评价结果

### (2022年4月)

#### 一、公司旗下集合资产管理计划风险评价方法说明

根据《上海东方证券资产管理有限公司产品风险等级评价办法实施细则》（2020年修订）等相关规定，我司集合资产管理计划的产品风险等级由低到高依次分为五个等级：R1（低风险）、R2（中低风险）、R3（中风险）、R4（中高风险）、R5（高风险）。

##### 1、新产品风险等级评价

我司集合资产管理计划成立时，先根据产品类型确定风险等级区间，再参考同类型公募产品的初始风险等级进行调整，形成产品的初始风险等级。如果公司无同类别公募产品，参照最相近类别公募产品的初始风险等级进行调整；如公司同一类公募产品有两种或两种以上的初始风险等级，则参照该类别最新（[3]个月内）成立的公募产品的初始风险等级进行调整，如该类别近[3]个月内未成立新公募产品，则参照该类别多数公募产品的初始风险等级进行调整，从而确定集合资产管理计划的初始风险等级。

我司各类型产品的风险等级区间如下表所示：

产品类型	风险等级区间
股票型	R3-R5
偏股混合型	R3-R5
其他混合型	R2-R4
偏债混合型	R2-R4
债券型	R2-R4
货币市场型	R1-R2
其他类型	R2-R5
分级产品优先份额	R3-R4
分级产品劣后份额	R4-R5

##### 2、存续产品持续风险等级评价

原则上，集合资产管理计划于每两年第二季度末前（下称“定期评价时点”）及合同变更后，应开展持续风险评价，但在定期评价时点最近半年内发生过合同

变更已进行风险等级持续评价的集合资产管理计划除外。集合资产管理计划的持续风险评价应先按照上述“新产品风险等级评价”的方法确定初始风险等级，再根据下列具体调整事项确定风险等级的调整方向及调整幅度，重新评定产品的风险等级，但调整后的风险等级不高于 R5。

具体调整事项如下：

- 1) 产品的流动性
- 2) 产品投资标的的到期时限
- 3) 产品的杠杆率
- 4) 投资方向、投资范围和投资比例
- 5) 估值政策、程序和定价模式
- 6) 发行人等相关主体的信用状况
- 7) 跨境因素
- 8) 过往业绩和历史波动程度
- 9) 有无违规情况
- 10) 其他风险等级调整事项

## 二、公司旗下集合资产管理计划风险评价结果

我司根据法律法规及公司相关制度的规定，对公司集合资产管理计划的风险等级进行了更新评价。其中，添盈 1 号集合、添利 13 号集合、鸿鼎 2 号 FOF 集合、添盈 6 号集合四只产品风险等级调高一级，其余产品风险等级不变。具体评价结果如下：

序号	产品全称	原风险等级	更新后风险等级	调整后评级相比原评级变化
1	东方红-先锋 1 号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
2	东方红-先锋 2 号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
3	东方红-先锋 4 号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
4	东方红-先锋 5 号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
5	东方红-先锋 6 号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
6	东方红-先锋 6 号 II 期集合资产管理计划	R3	R3	无变化
7	东方红-先锋 7 号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
8	东方红丰裕 1 号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
9	东方红-量化 2 号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
10	东方红明睿 2 号集合资产管理计划	R3	R3	无变化

序号	产品全称	原风险等级	更新后风险等级	调整后评级相比原评级变化
11	东方红明睿4号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
12	东方红新公益集合资产管理计划	R3	R3	无变化
13	东方红高收益债集合资产管理计划	R3	R3	无变化
14	东方红明远5号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
15	东方红明远4号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
16	东方红明远6号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
17	东方红明远1号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
18	东方红阳光2号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
19	东方红明远8号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
20	东方红明远2号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
21	东方红添裕3号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
22	东方红明远10号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
23	东方红-私享纯债3号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
24	东方红明远9号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
25	东方红添利9号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
26	东方红添裕4号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
27	东方红明远12号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
28	东方红添利11号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
29	东方红添裕5号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
30	东方红明远11号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
31	东方红建赢1号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
32	东方红明悦3号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
33	东方红明悦6号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
34	东方红民生增利集合资产管理计划	R2	R2	无变化
35	东方红明远13号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
36	东方红添裕7号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
37	东方红建信1号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
38	东方红建信2号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
39	东方红明锋1号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
40	东方红明锋2号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
41	东方红明悦4号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
42	东方红明悦宁泓1号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
43	渊远东方红1号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
44	东方红合盈1号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
45	东方红信和添安1号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
46	东方红合盈3号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
47	东方红合盈5号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
48	东方红合盈4号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
49	东方红添盈2号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
50	东方红添盈1号集合资产管理计划	R2	R3	调高一级
51	东方红合盈2号集合资产管理计划	R2	R2	无变化

序号	产品全称	原风险等级	更新后风险等级	调整后评级相比原评级变化
52	东方红合盈 6 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
53	东方红添利 13 号集合资产管理计划	R2	R3	调高一级
54	东方红鸿鼎 2 号 FOF 集合资产管理计划	R2	R3	调高一级
55	东方红悦享添盈 1 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
56	东方红添鑫 1 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
57	东方红明悦 8 号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
58	东方红添裕 6 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
59	东方红添盈 6 号集合资产管理计划	R2	R3	调高一级
60	东方红添惠 1 号 FOF 集合资产管理计划	R3	R3	无变化
61	东方红添盈 8 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
62	东方红信和添安 4 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
63	东方红信和添安 5 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
64	东方红添鑫 5 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
65	东方红信和添安 6 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
66	东方红明悦 10 号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
67	东方红添盈 5 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
68	东方红添盈 10 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
69	东方红添盈 13 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
70	东方红添盈 7 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
71	东方红建盈添裕 1 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
72	东方红明锋 3 号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
73	东方红建盈明悦 1 号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
74	东方红信和添裕 1 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
75	东方红添鑫 9 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
76	东方红明悦 12 号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
77	东方红建盈明悦 2 号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
78	东方红建盈明悦 3 号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
79	东方红建盈明悦 4 号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
80	东方红信和添裕 2 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
81	东方红信和添裕 3 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
82	东方红添裕 10 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
83	东方红建盈明悦 5 号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
84	东方红建盈明悦 6 号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
85	东方红添鑫 8 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
86	东方红添鑫 11 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
87	东方红添鑫 15 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
88	东方红信和添裕 5 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
89	东方红添盈 22 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
90	东方红明悦 18 号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
91	东方红信和添安 7 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
92	东方红建盈私享明悦 2 号集合资产管理计划	R3	R3	无变化

序号	产品全称	原风险等级	更新后风险等级	调整后评级相比原评级变化
93	东方红添裕 11 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
94	东方红明悦 15 号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
95	东方红添盈 19 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
96	东方红信和添裕 6 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
97	东方红紫光明悦 1 号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
98	东方红添鑫 16 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
99	东方红紫光明悦 2 号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
100	东方红信和添裕 8 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
101	东方红建盈添裕 2 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
102	东方红添裕 12 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
103	东方红添盈 26 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
104	东方红乐享添裕 1 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
105	东方红添盈 23 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
106	东方红信享添盈集合资产管理计划	R2	R2	无变化
107	东方红添裕 15 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
108	东方红明悦 19 号集合资产管理计划	R3	R3	无变化
109	东方红添鑫 19 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
110	东方红添裕 16 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
111	东方红添盈 27 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
112	东方红建盈添裕 3 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
113	东方红稳添裕 1 号集合资产管理计划	R2	R2	无变化
114	东方红稳犇 888 号集合资产管理计划	R3	R3	无变化

上海东方证券资产管理有限公司

2022 年 4 月 8 日