

东方红添鑫 11 号集合
资产管理计划

财务报表及审计报告
2021 年 7 月 16 日(计划成立日)至
2021 年 12 月 31 日止期间

财务报表审计报告



防 伪 编 码： 31000012202275198U

被审计单位名称： 东方红添鑫11号集合资产管理计划

审 计 期 间： 2021

报 告 文 号： 德师报(审)字(22)第P00756号

签字注册会计师： 史曼

注 师 编 号： 420000214204

签字注册会计师： 何淑婷

注 师 编 号： 310000120680

事 务 所 名 称： 德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

事 务 所 电 话： 023-88231378

事 务 所 地 址： 上海市黄浦区延安东路222号外滩中心30楼

业务报告使用防伪编码仅说明该业务报告是由依法批准设立的会计师事务所出具，业务报告的法律主体是出具报告的会计师事务所及签字注册会计师。
报告防伪信息查询网址：<https://zxfw.shcpa.org.cn/codeSearch>

东方红添鑫 11 号集合资产管理计划

财务报表及审计报告

2021 年 7 月 16 日(计划成立日)至 2021 年 12 月 31 日止期间

<u>内容</u>	<u>页码</u>
审计报告	1 - 3
资产负债表	4
利润表	5
所有者权益(计划净值)变动表	6
报表附注	7 - 18

审计报告

德师报(审)字(22)第 P00756 号
(第 1 页, 共 3 页)

东方红添鑫 11 号集合资产管理计划全体持有人:

一、审计意见

我们审计了上海东方证券资产管理有限公司(以下简称“计划管理人”)作为管理人的东方红添鑫 11 号集合资产管理计划的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年 7 月 16 日(计划成立日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益(计划净值)变动表以及相关财务报表附注。

我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则、中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了东方红添鑫 11 号集合资产管理计划 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 7 月 16 日(计划成立日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和计划净值变动情况。

二、形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于东方红添鑫 11 号集合资产管理计划,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

三、其他信息

计划管理人管理层对其他信息负责。其他信息包括东方红添鑫 11 号集合资产管理计划 2021 年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。

审计报告(续)

德师报(审)字(22)第 P00756 号
(第 2 页, 共 3 页)

四、计划管理人管理层和治理层对财务报表的责任

计划管理人管理层负责按照企业会计准则、中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表, 使其实现公允反映, 并设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

在编制财务报表时, 计划管理人管理层负责评估东方红添鑫 11 号集合资产管理计划的持续经营能力, 披露与持续经营相关的事项(如适用), 并运用持续经营假设, 除非计划管理人管理层计划清算东方红添鑫 11 号集合资产管理计划、终止运营或别无其他现实的选择。

计划管理人治理层负责监督东方红添鑫 11 号集合资产管理计划的财务报告过程。

五、注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证, 并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证, 但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致, 如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策, 则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中, 我们运用职业判断, 并保持职业怀疑。同时, 我们也执行以下工作:

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险, 设计和实施审计程序以应对这些风险, 并获取充分、适当的审计证据, 作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上, 未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制, 以设计恰当的审计程序, 但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价计划管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

审计报告(续)

德师报(审)字(22)第 P00756 号
(第 3 页, 共 3 页)

五、注册会计师对财务报表审计的责任(续)

(4) 对计划管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时, 根据获取的审计证据, 就可能导致对东方红添鑫 11 号集合资产管理计划持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性, 审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露; 如果披露不充分, 我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而, 未来的事项或情况可能导致东方红添鑫 11 号集合资产管理计划不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容, 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与计划管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)



中国注册会计师

史曼



中国注册会计师

何淑婷



2022 年 4 月 25 日

东方红添鑫 11 号集合资产管理计划

资产负债表

会计主体：东方红添鑫 11 号集合资产管理计划

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注	本期末 2021 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	七 1	207,683.05
结算备付金		41,971.86
存出保证金		4,312.32
交易性金融资产	七 2	96,875,784.51
其中：股票投资		5,021,783.30
基金投资		91,854,001.21
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产		-
买入返售金融资产	七 3	-
应收证券清算款		5,002,860.27
应收利息	七 4	-1,541.75
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		102,131,070.26
负债和所有者权益	附注	本期末 2021 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		64,572.43
应付托管费		2,537.06
应付销售服务费		-
应付交易费用		14,276.34
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债		7,200.00
负债合计		88,585.83
所有者权益：		
实收基金	七 5	99,842,402.14
未分配利润	七 6	2,200,082.29
所有者权益合计		102,042,484.43
负债和所有者权益总计		102,131,070.26

注：1、报告截止日 2021 年 12 月 31 日，计划份额净值人民币 1.0220 元，计划份额总额 99,842,402.14 份。

2、本计划合同于 2021 年 7 月 16 日生效，本期数据按实际存续期计算，无上年度可比期间数据。

东方红添鑫 11 号集合资产管理计划

利润表

会计主体：东方红添鑫 11 号集合资产管理计划

本报告期：2021 年 7 月 16 日(计划成立日)至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注	本期 2021 年 7 月 16 日(计划成立日)至 2021 年 12 月 31 日
一、收入		2,205,105.34
1.利息收入		25,821.89
其中：存款利息收入		17,753.17
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		8,068.72
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以“-”填列)		622,113.38
其中：股票投资收益		58,440.82
基金投资收益		-98,179.34
债券投资收益		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		661,851.90
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	七 7	1,557,170.07
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		-
减：二、费用		193,418.91
1.管理人报酬	九 3	106,640.67
2.托管费	九 3	4,163.79
3.销售服务费		-
4.交易费用		72,841.64
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.税金及附加		672.81
7.其他费用		9,100.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		2,011,686.43
减：所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		2,011,686.43

东方红添鑫 11 号集合资产管理计划

所有者权益(计划净值)变动表

会计主体：东方红添鑫 11 号集合资产管理计划

本报告期：2021 年 7 月 16 日(计划成立日)至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 7 月 16 日(计划成立日)至 2021 年 12 月 31 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(计划净值)	10,000,000.00	-	10,000,000.00
二、本期经营活动产生的计划净值变动数(本期利润)	-	2,011,686.43	2,011,686.43
三、本期计划份额交易产生的计划净值变动数(净值减少以“-”号填列)	89,842,402.14	188,395.86	90,030,798.00
其中：1. 计划参与款	116,752,402.14	247,597.86	117,000,000.00
2. 计划退出款	-26,910,000.00	-59,202.00	-26,969,202.00
四、本期向计划份额持有人分配利润产生的计划净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(计划净值)	99,842,402.14	2,200,082.29	102,042,484.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告财务报表由下列负责人签署：

张锋
计划管理人负责人

汤琳
主管会计工作负责人

陈培
会计机构负责人

报表附注

一、 资产管理计划基本情况

东方红添鑫 11 号集合资产管理计划(以下简称“本计划”)系由上海东方证券资产管理有限公司依照中国人民银行银发[2018]106 号《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监会令[第 151 号]《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、证监会公告[2018]31 号《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》等有关规定和《东方红添鑫 11 号集合资产管理计划资产管理合同》、《东方红添鑫 11 号集合资产管理计划说明书》的约定设立运作。

本计划到期日为 2022 年 12 月 31 日,符合法律法规规定及本合同约定条件同时经三方协商同意后可展期。本计划提前结束的,存续期提前届满。本计划于 2021 年 7 月 16 日开始运作,初始委托资产规模为人民币 10,000,000.00 元,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(21)第 00355 号验资报告。本计划的管理人为上海东方证券资产管理有限公司,托管人为中国工商银行股份有限公司。

本计划的投资范围为根据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》和《东方红添鑫 11 号集合资产管理计划资产管理合同》的有关规定允许集合资产管理计划投资的金融资产。

二、 会计报表的编制基础

本计划的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会和中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

三、 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表的编制符合企业会计准则及中国证监会和中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作的要求,真实、完整地反映了本计划 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 7 月 16 日(计划成立日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和计划净值变动情况。

四、 重要会计政策和会计估计

1. 会计年度

本计划的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2021 年 7 月 16 日(计划成立日)至 2021 年 12 月 31 日止期间。

2. 记账本位币

本计划以人民币为记账本位币。

3. 金融工具

3.1 金融资产和金融负债的分类

在本计划成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

金融资产的分类

根据本计划的业务特点和持有目的，本计划将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、可供出售金融资产、持有至到期投资和贷款及应收款项，持有至到期投资是指到期日固定、回收金额固定或可确定，且资产管理人有明确意图和能力持有至到期的非衍生金融资产。本计划暂无金融资产分类为可供出售金融资产和持有至到期投资，衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示。

金融负债的分类

根据本计划的业务特点和风险管理要求，本计划将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本计划暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项等。

3.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本计划成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。持有至到期投资、贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，持有至到期投资采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量，在终止确认、发生减值或摊销时产生的利得或损失，计入当期损益。贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

3.3 金融资产和金融负债的估值原则

本计划持有的金融资产及金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

- (1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，计划管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。
- (2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。
- (3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

3.4 金融资产和金融负债的抵销

当本计划具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

4. 实收基金

实收基金为对外发行集合计划份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于参与和退出引起的实收基金变动分别于集合计划参与确认日及集合计划退出确认日认列。

5. 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在参与或退出资产管理计划份额时，参与或退出款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占资产净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在参与或退出资产管理计划份额时，参与或退出款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占资产净值比例计算的金额。损益平准金于参与确认日或退出确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

6. 收入/(损失)的确认和计量

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由计划管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券投资在持有期间收到的款项,根据资产支持证券投资的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分,将本金部分冲减资产支持证券投资成本,并将投资收益部分扣除在适用情况下由计划管理人缴纳的增值税后确认为利息收入。买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

股票投资在持有期间应取得的现金股利确认为投资收益,基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由计划管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

7. 费用的确认和计量

本计划的管理人报酬(包括固定管理费和业绩报酬)和托管费在费用涵盖期间按资产管理合同约定的费率和方法进行确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

8. 计划的收益分配政策

- (1) 收益采用现金分配或红利再投资方式,每位投资者获得的分红收益金额或再投资份额保留小数点后两位,第三位四舍五入。
- (2) 每一集合计划份额享有同等分配权。
- (3) 收益分配的基准日为可供分配利润的计算截止日。计划收益分配基准日的份额净值减去每单位份额收益分配金额后不能低于初始面值。
- (4) 本集合计划的默认分红方式为现金分红,投资者可以选择现金分红或者红利再投资分红方式。
- (5) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。
- (6) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

在符合上述原则和具备收益分配条件的情况下,收益分配时间和分配比例由管理人根据实际情况决定。

9. 外币交易

本计划本报告期内无外币交易。

五、 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

1. 会计政策变更的说明

本计划本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

2. 会计估计变更的说明

本计划本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

3. 差错更正的说明

本计划本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

六、 税项

本计划参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税务法规计提和缴纳税款，主要税项列示如下：

- (1) 本计划运营过程中发生的资管产品运营业务，以计划管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

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。计划管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

- (2) 对本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，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税。

- (3) 对于本计划从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

- (4) 本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。

七、重要财务报表项目的说明

1. 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	207,683.05
定期存款	-
其他存款	-
合计	207,683.05

2. 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	5,065,675.34	5,021,783.30	-43,892.04
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	90,252,939.10	91,854,001.21	1,601,062.11
其他	-	-	-
合计	95,318,614.44	96,875,784.51	1,557,170.07

3. 买入返售金融资产

本计划本报告期末无买入返售金融资产。

4. 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	580.68
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	20.68
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	-2,145.20
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	2.09
合计	-1,541.75

东方红添鑫 11 号集合资产管理计划

5. 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 7 月 16 日(计划成立日)至 2021 年 12 月 31 日	
	计划份额(份)	账面金额
计划成立日	10,000,000.00	10,000,000.00
本期参与	116,752,402.14	116,752,402.14
本期退出(以“-”号填列)	-26,910,000.00	-26,910,000.00
本期末	99,842,402.14	99,842,402.14

6. 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
计划成立日	-	-	-
本期利润	454,516.36	1,557,170.07	2,011,686.43
本期计划份额交易产生的变动数	-22,415.16	210,811.02	188,395.86
其中：计划参与款	-29,239.27	276,837.13	247,597.86
计划退出款(以“-”号填列)	6,824.11	-66,026.11	-59,202.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	432,101.20	1,767,981.09	2,200,082.29

7. 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 7 月 16 日(计划成立日)至 2021 年 12 月 31 日	
	1. 交易性金融资产	
——股票投资		1,557,170.07
——债券投资		-43,892.04
——资产支持证券投资		-
——贵金属投资		-
——基金投资		-
2. 衍生工具		1,601,062.11
——权证投资		-
——期货投资		-
3. 其他		-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税		-
合计		1,557,170.07

八、或有事项、资产负债表日后事项的说明

1. 或有事项

截至资产负债表日，本计划无需要说明的重大或有事项。

2. 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本计划无需要披露的资产负债表日后事项。

九、 关联方关系及关联方交易

1. 关联方关系

关联方名称	与本计划的关系
上海东方证券资产管理有限公司(以下简称“东证资管”)	计划管理人、注册登记机构、计划销售机构
中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)	计划托管人
东方证券股份有限公司(以下简称“东方证券”)	计划管理人的股东

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 通过关联方交易单元进行的交易

2.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 7 月 16 日(计划成立日)至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
东方证券	27,944,647.98	100%

2.2 债券交易

本计划本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

2.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 7 月 16 日(计划成立日)至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
东方证券	68,000,000.00	100%

2.4 权证交易

本计划本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

2.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 7 月 16 日(计划成立日)至 2021 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东方证券	19,876.95	100%	14,276.34	100%

注：1、上述佣金参考市场价格经本计划管理人与对方协商确定。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本计划提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

东方红添鑫 11 号集合资产管理计划

3. 关联方报酬

3.1 计划管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 7 月 16 日(计划成立日)至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的计划应支付的管理费	106,640.67
其中：固定管理费	106,640.67
业绩报酬	-
当期末应付管理费	64,572.43

3.2 计划托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 7 月 16 日(计划成立日)至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的应支付的托管费	4,163.79
当期末应付托管费	2,537.06

4. 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本计划本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

5. 各关联方投资本计划的情况

5.1 报告期内计划管理人运用固有资金投资本计划的情况

本计划本报告期内计划管理人无运用固有资金投资本计划的情况。

5.2 报告期末除计划管理人之外的其他关联方投资本计划的情况

本计划本报告期内除计划管理人之外的其他关联方无投资本计划的情况。

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 7 月 16 日(计划成立日)至 2021 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	207,683.05	17,001.79

注：本计划的银行存款由计划托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7. 本计划在承销期内参与关联方承销证券的情况

本计划本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

8. 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本计划持有计划管理人所管理的基金合计 15,407,837.08 元，占本计划资产净值的比例为 15.0995%。

十、 利润分配情况

本计划本报告期内无利润分配的情况。

十一、 期末(2021 年 12 月 31 日)本计划持有的流通受限证券

1. 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本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。

2. 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本计划本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

3. 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

3.1 银行间市场债券正回购

本计划本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

3.2 交易所市场债券正回购

本计划本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

十二、 金融工具风险及管理

1. 风险管理政策和组织架构

本计划在日常经营活动中涉及的风险主要包括市场风险、流动性风险及信用风险。本计划管理人制定了相应的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，负责对合规管理和风险管理的总体目标、基本政策进行审议并提出意见；对合规管理和风险管理的机构设置及其职责进行审议并提出意见；对需董事会审议的重大决策的风险和重大风险的解决方案进行评估并提出意见；对需董事会审议的合规报告和风险评估报告进行审议并提出意见等。在经营层面设立风险控制委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作；根据董事会制定的风险管理原则制订相关风险控制政策，使公司整体业务发展战略与风险承受能力保持相当；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；根据公司风险管理总体策略和各职能部门与业务单元职责分工，指导实施风险应对方案；审议公司投资授权有关的风险控制方案等。

2. 信用风险

信用风险是指计划在交易过程中因交易对手履行合约责任，或者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，导致计划资产损失和收益变化的风险。

本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。本计划的银行存款存放在本计划托管人中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本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。

3. 流动性风险

流动性风险是指计划资产在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本计划的流动性风险一方面来自于计划委托人于约定开放日要求退出计划，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，本计划管理人通过灵活的交易模型，使计划的建仓对市场的人为影响减少到最小；针对由于计划委托人退出造成的流动性风险，本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。

4. 市场风险

市场风险是指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。

4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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。

本计划主要投资于固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

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。

本计划的所有资产及负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

4.3 其他价格风险

其他价格风险是指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。本计划主要投资于证券交易所上市或场外市场交易的股票、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，选择符合计划合同约定范围的投资品种进行投资。本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市场价格风险。

本计划通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本计划管理人每日对本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。

本计划主要投资于固定收益品种，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本计划资产净值无重大影响。

十三、财务报表之批准

本财务报表于 2022 年 4 月 25 日已经本计划管理人批准报出。

财务报告结束