

东方红丰裕 1 号集合资产管理计划 2022 年第 2 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浙江省分行

报告期间：2022 年 4 月 1 日-2022 年 6 月 30 日

报告送出日期：2022 年 07 月 29 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：	东方红丰裕1号集合资产管理计划
合同生效时间：	2011年10月18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浙江省分行

二、资产管理计划投资表现

(一) 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2022年4月1日至2022年6月30日)
期末资产净值(元)	1,976,262.21
本期利润(元)	-16,516.18
期末资产管理计划可分配利润	27,533.08
期末份额净值(元)	1.0141
期末份额累计净值(元)	1.4006
本期资产管理计划净值增长率	-0.83%
资产管理计划累计净值增长率	43.21%

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或退出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	125,103.00	4.38
	其中：境内股票	125,103.00	4.38
	港股投资	-	-
2	固定收益投资	163,418.38	5.72
	其中：债券	163,418.38	5.72
	资产支持证券	-	-
3	基金投资	414,850.87	14.53
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	700,001.75	24.52
6	银行存款及清算备付金	1,451,270.27	50.83
7	其他资产	237.01	0.01
8	资产合计	2,854,881.28	100.00

(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前十名股票明细

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(%)
------	------	---------	-------	----------------

600188	兖矿能源	500.00	19,740.00	1.00
002460	赣锋锂业	100.00	14,870.00	0.75
601952	苏垦农发	1,000.00	13,990.00	0.71
601666	平煤股份	1,000.00	13,590.00	0.69
000983	山西焦煤	900.00	12,051.00	0.61
600096	云天化	300.00	9,444.00	0.48
601398	工商银行	1,800.00	8,586.00	0.43
600886	国投电力	700.00	7,350.00	0.37
600111	北方稀土	200.00	7,032.00	0.36
601088	XD 中国神	200.00	6,660.00	0.34

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

（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

债券代码	债券名称	持仓数量(张)	市值(元)	市值占委托资产净值比例(%)
113044	大秦转债	540.00	58,893.81	2.98
010303	03 国债(3)	500.00	50,959.32	2.58
110067	华安转债	270.00	29,743.87	1.51
132011	17 浙报 EB	230.00	23,821.38	1.21

（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前五名基金明细

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(%)
518880	华安黄金易(ETF)	53,300.00	203,499.40	10.30
511990	华宝添益货币 A	1,900.00	189,998.10	9.61
160221	国泰有色	12,735.00	18,567.63	0.94
160219	国泰医药	2,390.00	1,792.50	0.09
160418	华安中证银行指数	1,060.00	992.58	0.05

（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

项目	交易所市场	银行间市场
从事正回购交易而形成的卖出回购证券款余额（元）	-	-

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
刘昕	上海财经大学 管理学硕士	10 年	上海东方证券资产管理有限公司投资经理，上海财经大学管理学硕士，证券从业 10 年，曾任德邦证券股份有限公司债券投资与交易部交易员，上海东方证券资产管理有限公司投资助理、投资主办人。

（二）投资策略回顾与展望

俄乌冲突持续发酵，导致能源、化肥、粮食及部分基本金属价格大幅上行；美国通胀持续高企，加息预期上升，美元走强，对国内风险资产造成冲击，3 月底突发的疫情对华东地区的经济活动造成冲击；多重冲击叠加疫后经济修复预期和稳增长政策持续释放，股市走出“深 V”模式，债券则进入震荡模式。

目前美国通胀仍居高不下，6 月美联储 28 年来首次加息 75bp，美债一度站上 3.5% 高位，市场预期大概率仍会加息 75bp；疫情则表现为多地散发，新毒株在多个国家蔓延，后续带来的扰动仍需关注。

稳基建、稳地产、促消费、支持新产业投资等稳增长的政策方向一直未变，但上半年政策推出的节奏仍停留在“适度”的标准，对经济整体的刺激效果还有待观察；受美国加息影响，国内货币政策空间受到挤压，降息难见但市场流动性仍会在一段时间内保持较宽松的水平，宽货币转向宽信用；债券配置上则以中短久期加杠杆为主，权益方面，大盘目前已回到

疫情前水平，而风险因素仍多，目前保持中等仓位并择机逐步加仓。

（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 2022 年 4 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上季度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 3 月 31 日
当期发生的资产管理计划应支付的管理费	740.09	745.47

注：管理费计提基准：按前一日计划资产净值；费率：0.15%/年；计提方式：每日计提；支付方式：每季度支付。

（二）资产管理计划托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 4 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上季度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 3 月 31 日
当期发生的资产管理计划应支付的托管费	740.09	745.47

注：托管费计提基准：按前一日计划资产净值；费率：0.15%/年；计提方式：每日计提；支付方式：每季度支付。

（三）业绩报酬

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 4 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上季度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 3 月 31 日
当期计提的业绩报酬	-	-

注：本计划不收取业绩报酬。

七、本报告期资产管理计划投资收益分配情况

单位：人民币元

报告期	每 10 份资产管 理计划分红	收益分配合计	备注
2022 年 4 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	-	-	-

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

自 2022 年 6 月 28 日（含）起，本集合资产管理计划投资经理由王丹先生、刘昕女士变更为刘昕女士。

（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 07 月 29 日