
东方红明远 12 号集合资产管理计划 2022 年年度报告

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：中国建设银行股份有限公司广东省分行

报告期间：2022 年 1 月 1 日-2022 年 12 月 31 日

报告送出日期：2023 年 04 月 25 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。

本报告中年度财务会计报告已经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，并出具无保留意见的审计报告。

一、基本信息

资产管理计划名称：	东方红明远 12 号集合资产管理计划
合同生效时间：	2019 年 4 月 18 日
管理人：	上海东方证券资产管理有限公司
托管人：	中国建设银行股份有限公司广东省分行

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 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日）
期末资产净值(元)	134,621,866.18
本期利润(元)	-83,822,502.32
期末资产管理计划可分配利润	43,512,320.45
期末份额净值(元)	1.5741
期末份额累计净值(元)	1.5741
本期资产管理计划净值增长率	-11.90%
资产管理计划累计净值增长率	57.41%

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

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



注：本资产管理计划无业绩比较基准。

三、年度财务会计报告

(一) 资产负债表

会计主体：东方红明远 12 号集合资产管理计划

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本报告期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
资产：		
银行存款	25,442,001.79	92,946,938.88
结算备付金	514,687.64	349,425.57
存出保证金	16,586.20	21,800.77
交易性金融资产	110,123,150.52	369,189,422.14
其中：股票投资	110,123,150.52	369,189,422.14
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-

贵金属投资	-	-
其他投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
债权投资	-	-
其中：债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
其他投资	-	-
其他债权投资	-	-
其他权益工具投资	-	-
应收清算款	-	-
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	18,833.09
资产总计	136,096,426.15	462,526,420.45
负债和净资产	本报告期末	上年度末
	2022年12月31日	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	-	-
应付清算款	0.68	3.43
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	483,787.05	1,716,186.91
应付托管费	64,504.93	228,824.89

应付销售服务费	-	-
应付投资顾问费	-	-
应交税费	836,009.30	4,089,981.02
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	90,258.01	124,307.51
负债合计	1,474,559.97	6,159,303.76
净资产：		
实收基金	85,523,142.59	255,419,736.00
其他综合收益（若有）	-	-
未分配利润	49,098,723.59	200,947,380.69
净资产合计	134,621,866.18	456,367,116.69
负债和净资产总计	136,096,426.15	462,526,420.45

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，计划份额净值(暂估业绩报酬前)1.5741 元，计划份额总额 85,523,142.59 份，计划资产净值(暂估业绩报酬前)134,621,866.18 元。2022 年，利润表未体现暂估业绩报酬金额为-26,990,731.93 元（2021 年：-8,064,679.40 元）。于 2022 年 12 月 31 日，相关暂估业绩报酬余额为 6,150,490.22 元（2021 年 12 月 31 日：33,141,222.15 元），计划资产净值(暂估业绩报酬后)128,471,375.96 元。该暂估业绩报酬余额是各资产管理计划份额持有人于期末时点的暂估业绩报酬的合计，各资产管理计划份额持有人实际应承担的业绩报酬金额根据其持有期间的实际收益情况计算确认，可能与上述暂估业绩报酬金额存在差异。

（二）利润表

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2022 年 1 月 1 日 至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入	-69,361,181.62	-18,937,481.10
1.利息收入	308,662.62	692,746.00

其中：存款利息收入	308,662.62	692,745.69
债券利息收入	-	0.31
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
证券出借利息收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	21,585,188.76	62,910,120.23
其中：股票投资收益	20,029,961.35	62,211,890.24
基金投资收益	-	-
债券投资收益	107,127.90	182.51
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,448,099.51	2,510,049.61
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）	-	-
金融商品转让增值税抵扣	-	-1,812,002.13
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-91,255,033.00	-82,540,347.33
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
减：二、营业总支出	14,461,320.70	8,445,979.06
1. 管理人报酬	14,253,651.40	7,072,268.35
2. 托管费	429,710.66	942,969.09
3. 销售服务费	-	-
4. 投资顾问费	-	-
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 信用减值损失	-	-
7. 税金及附加	-252,749.27	-79,705.02
8. 其他费用	30,707.91	510,446.64
三、利润总额（亏损总额以“-”	-83,822,502.32	-27,383,460.16

号填列)		
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-83,822,502.32	-27,383,460.16
五、其他综合收益的税后净额	-	-
六、综合收益总额	-83,822,502.32	-27,383,460.16

(三) 净资产（基金净值）变动表

本报告期：2022年1月1日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	本报告期 2022年1月1日至2022年12月31日			
	实收基金	其他综合收益 (若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	255,419,736.00	-	200,947,380.69	456,367,116.69
加：会计政策变更（若有）	-	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-	-
其他（若有）	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	255,419,736.00	-	200,947,380.69	456,367,116.69
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-169,896,593.41	-	-151,848,657.10	-321,745,250.51
（一）、综合收益总额	-	-	-83,822,502.32	-83,822,502.32
（二）、本期基金份额交易产生的基	-169,896,593.41	-	-68,026,154.78	-237,922,748.19

金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	7,116,542.59	-	3,202,722.21	10,319,264.80
2. 基金赎回款	-177,013,136.00	-	-71,228,876.99	-248,242,012.99
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益 (若有)	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	85,523,142.59	-	49,098,723.59	134,621,866.18
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日			
	实收基金	其他综合收益 (若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	255,419,736.00	-	228,330,840.85	483,750,576.85
加：会计政策变更 (若有)	-	-	-	-
前期差错更正 (若有)	-	-	-	-

其他 (若有)	-	-	-	-
二、本期 期初净资产 (基金 净值)	255,419,736.00	-	228,330,840.85	483,750,576.85
三、本期 增减变动 额(减少 以“-”号 填列)	-	-	-27,383,460.16	-27,383,460.16
(一)、 综合收益 总额	-	-	-27,383,460.16	-27,383,460.16
(二)、 本期基金 份额交易 产生的基 金净值变 动数 (净值减 少以“-” 号填列)	-	-	-	-
其中: 1. 基金申购 款	-	-	-	-
2. 基金赎回 款	-	-	-	-
(三)、 本期向基 金份额持 有人分配 利润产生 的基金净 值变动 (净值减 少以“-” 号填列)	-	-	-	-
(四)、 其他综合 收益结转 留存收益 (若有)	-	-	-	-

四、本期期末净资产（基金净值）	255,419,736.00	-	200,947,380.69	456,367,116.69
-----------------	----------------	---	----------------	----------------

注：本资产管理计划财务报表附注请参见管理人官网公告的本资产管理计划审计报告。

四、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	110,123,150.52	80.92
	其中：境内股票	107,438,329.28	78.94
	港股投资	2,684,821.24	1.97
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	基金投资	-	-
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	25,956,689.43	19.07
7	其他资产	16,586.20	0.01
8	资产合计	136,096,426.15	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(%)
000858	五粮液	62,708.00	11,330,708.52	8.42
000568	泸州老窖	50,000.00	11,214,000.00	8.33
600519	贵州茅台	6,400.00	11,052,800.00	8.21
600600	青岛啤酒	69,600.00	7,482,000.00	5.56
002304	洋河股份	42,700.00	6,853,350.00	5.09
600132	重庆啤酒	43,201.00	5,502,943.38	4.09
600809	山西汾酒	16,688.00	4,755,913.12	3.53
688059	华锐精密	25,274.00	4,069,114.00	3.02
002727	一心堂	128,200.00	4,039,582.00	3.00
603317	天味食品	139,821.00	3,842,281.08	2.85

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

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前五名基金明细
本资产管理计划本报告期末未持有基金。

(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。

五、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
谭鹏万	复旦大学经济学博士	15年	上海东方证券资产管理有限公司私募权益投资部总经理、投资经理，复旦大学经济学博士，证券从业15年，曾任华宝信托研究员，信诚基金投资部基金经理，中民投国际投资部投研总监，上海东方证券资产管理有限公司投资主办人，私募权益投资部副总经理（主持工作），拥有丰富的证券投资经验。

(二) 投资策略回顾与展望

2022 年是非常艰难的一年，各产品的净值出现了较大幅度的波动，持有人承受了较大的心理压力。但面对各种不确定性，我依然坚持了一贯以来的投资框架和逻辑，对组合进行了一定的调整，第四季度净值显著回升。

2023 年，是一个经济复苏、消费复苏、投资复苏的年份，也大概率将是一个能获得不错权益投资收益的年份。尽管中美关系依然紧张，但是影响国内经济复苏的各种不确定性已然消失，民众的消费偏好、投资偏好将显著回升。

我依然对消费板块的走势充满信心。大消费板块将是 2023 年的投资主线之一，白酒依然是消费品中最好的子行业之一，竞争格局持续改善，强者恒强。医药特别是创新药预计会迎来不错的投资机会。建设现代产业体系，提高产业链的韧性和安全性将是中国较长时间坚持的方向，在这个过程中，将诞生非常多的细分龙头，持续加大这些制造业公司的投资是我 2023 年的重要工作之一。

（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。

六、托管人履职报告

请参见管理人官网公告的本资产管理计划托管报告。

七、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 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
----	---	--

当期发生的资管计划应支付的管理费	3,222,830.19	7,072,268.35
------------------	--------------	--------------

注：管理费计提基准：按前一日计划资产净值；费率：1.50%/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1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
当期发生的资管计划应支付的托管费	429,710.66	942,969.09

注：托管费计提基准：按前一日计划资产净值；费率：0.20%/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1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
当期计提的业绩报酬	11,030,821.21	-

注：业绩报酬计提基准：5.00%；计提方式：区间年化收益率5%以上计提20%，分红日最多计提分红金额的20%；支付方式：本计划分红日、投资者退出日或本计划终止日一次性计提并支付。

八、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。

九、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
2023年04月25日