

东方红-量化 2 号集合资产管理计划 2023 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：中国建设银行股份有限公司

报告期间：2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日

报告送出日期：2024 年 01 月 31 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-量化2号集合资产管理计划
合同生效时间：	2012年12月31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

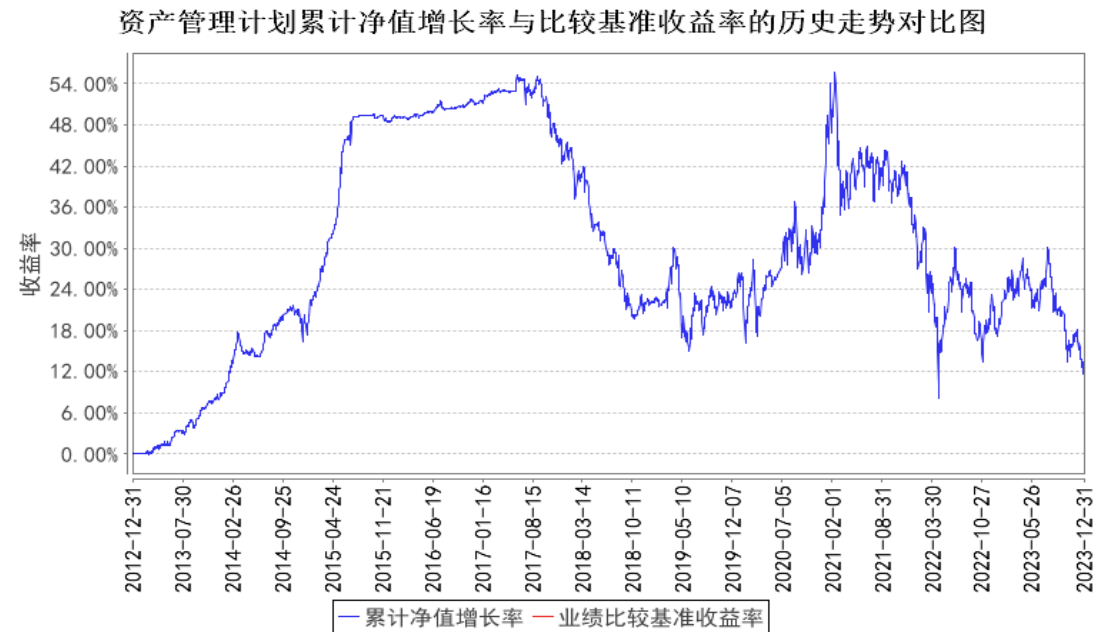
二、资产管理计划投资表现

(一) 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2023年10月1日至2023年12月31日)
期末资产净值(元)	1,745,538.21
本期利润(元)	-116,031.08
期末资产管理计划可分配利润	70,854.75
期末份额净值(元)	1.1044
期末份额累计净值(元)	1.1354
本期资产管理计划净值增长率	-6.18%
资产管理计划累计净值增长率	13.39%

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	金额（元）	占期末总资产的比例（%）
1	权益投资	1,295,031.00	73.87
	其中：境内股票	1,295,031.00	73.87
	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	-	-
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	457,780.95	26.11
7	其他资产	260.14	0.01
8	资产合计	1,753,072.09	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

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

1	600350	山东高速	5,400.00	37,476.00	2.15
2	000895	双汇发展	1,400.00	37,394.00	2.14
3	601857	中国石油	5,100.00	36,006.00	2.06
4	600028	中国石化	6,300.00	35,154.00	2.01
5	600398	海澜之家	4,700.00	34,874.00	2.00
6	600919	江苏银行	5,100.00	34,119.00	1.95
7	601000	唐山港	9,700.00	33,950.00	1.94
8	600377	宁沪高速	3,300.00	33,825.00	1.94
9	301004	嘉益股份	700.00	31,815.00	1.82
10	002966	苏州银行	4,800.00	31,008.00	1.78

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。

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
高原	复旦大学理学硕士	11 年	上海东方证券资产管理有限公司基金经理，复旦大学理学硕士。曾任上海东方证券资产管理有限公司量化研究员、投资主办人。

（二）投资策略回顾与展望

2023 年四季度沪深两市持续下跌，主要宽基指数都取得负收益。上证指数下跌 4.36%，深证成指下跌 5.79%，沪深 300 下跌 7.00%，中证 500 下跌 4.6%，中证 1000 下跌 3.15%，创业板指下跌 5.62%。

报告期内，本产品采取量化多因子模型作为基础，从估值、成长、盈利、流动性、预期、技术等多个维度综合评估精选个股，优化权重，形成核心投资组合，并积极关注个股财报业绩预告超预期、分析师评级调整等事件性机会，在有效控制风险的基础上，力争获取更高的收益。

未来的投资中会继续优化调整现有的策略，并努力开发新的选股因子和选股策略，坚持按照长期有效的量化模型来构建投资组合，努力获取长期稳定的收益。

（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

请参见管理人官网公告的本资产管理计划托管报告。

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 2023 年 10 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上季度可比期间 2023 年 7 月 1 日至 2023 年 9 月 30 日
当期发生的资产管理计划应支付的管理费	4,559.07	4,872.36

注：管理费计提基准：按前一日计划资产净值；费率：1.00%/年；计提方式：每日计提；支付方式：每月支付

(二) 资产管理计划托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 10 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上季度可比期间 2023 年 7 月 1 日至 2023 年 9 月 30 日
当期发生的资产管理计划应支付的托管费	683.85	730.87

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：每月支付

(三) 业绩报酬

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 10 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上季度可比期间 2023 年 7 月 1 日至 2023 年 9 月 30 日
当期计提的业绩报酬	-	-

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%，分红日最多提取分红金额的 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。

本计划业绩报酬的具体计提方法请见本计划合同的相关约定。

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
-----	--------------------	--------	----

2023 年 10 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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

本报告期内本资产管理计划投资经理没有发生变更。

（二）报告期末产品关联方参与本资产管理计划的情况

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	50~100
管理人控股股东、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
产品其他关联方参与本计划的情况	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）一般关联交易情况

除当期发生的应支付给关联方的管理费、托管费、业绩报酬及产品关联方参与本资产管理计划的情况（如有）外，报告期内本资产管理计划发生以下一般关联交易：

本资产管理计划本报告期内发生的应支付给关联方的佣金总计 1,384.07 元。

（五）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
2024 年 01 月 31 日