

# 东方红基金宝集合资产管理计划 2021 年第 1 季度报告

2021 年 3 月 31 日

集合计划管理人：上海东方证券资产管理有限公司

集合计划托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 4 月 22 日

## § 1 重要提示

集合计划托管人中国银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2021 年 4 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。

集合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集合计划的合同及说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## § 2 集合计划产品概况

|              |                                                                 |
|--------------|-----------------------------------------------------------------|
| 集合计划简称       | 东方红基金宝集合                                                        |
| 集合计划主代码      | 916001                                                          |
| 集合计划运作方式     | 契约型开放式                                                          |
| 集合计划合同生效日    | 2010 年 6 月 24 日                                                 |
| 报告期末集合计划份额总额 | 22,574,176.83 份                                                 |
| 投资目标         | 本集合计划主要投资于开放式基金和封闭式基金，力求有效控制投资组合风险，保障计划资产流动性，为投资者获取高于基金平均收益的回报。 |
| 投资理念         | 以管理人自主研究为基础，研判市场趋势，通过构建和动态调整基金投资组合有效控制风险，分享优秀集合计划管理人的研究投资成果。    |
| 业绩比较基准       | 中证基金指数收益率×70%+上证国债指数收益率×25%+一年期定期存款利率×5%                        |
| 集合计划管理人      | 上海东方证券资产管理有限公司                                                  |
| 集合计划托管人      | 中国银行股份有限公司                                                      |

## § 3 主要财务指标和集合计划净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标            | 报告期（2021 年 1 月 1 日-2021 年 3 月 31 日） |
|-------------------|-------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益        | 4,649,226.72                        |
| 2. 本期利润           | -2,946,057.42                       |
| 3. 加权平均集合计划份额本期利润 | -0.1304                             |

|               |               |
|---------------|---------------|
| 4. 期末集合计划资产净值 | 86,103,363.46 |
| 5. 期末集合计划份额净值 | 3.8142        |

注：1、所述集合计划业绩指标不包括持有人参与集合计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指集合计划本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用（不含暂估附加税）后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益扣除相关暂估附加税。

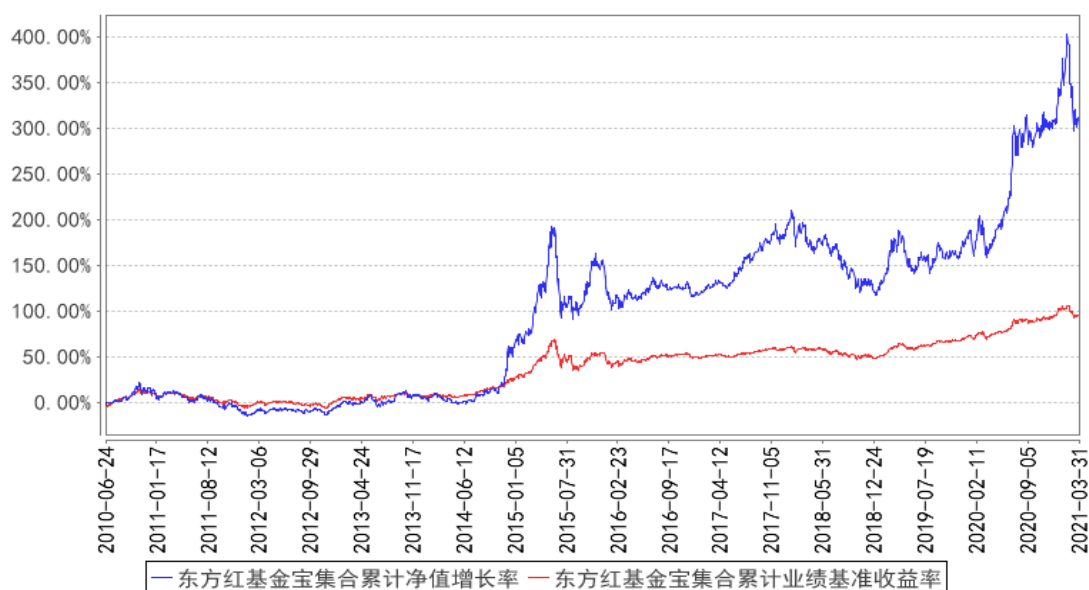
## 3.2 集合计划净值表现

### 3.2.1 集合计划份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段                   | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③     | ②—④   |
|----------------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|---------|-------|
| 过去三个月                | -3.10%     | 1.99%         | -0.53%         | 0.64%                 | -2.57%  | 1.35% |
| 过去六个月                | 5.69%      | 1.62%         | 3.79%          | 0.52%                 | 1.90%   | 1.10% |
| 过去一年                 | 54.30%     | 1.57%         | 13.98%         | 0.47%                 | 40.32%  | 1.10% |
| 过去三年                 | 49.13%     | 1.41%         | 23.43%         | 0.45%                 | 25.70%  | 0.96% |
| 过去五年                 | 87.30%     | 1.21%         | 33.13%         | 0.40%                 | 54.17%  | 0.81% |
| 自集合计划<br>合同生效起<br>至今 | 309.11%    | 1.26%         | 95.46%         | 0.59%                 | 213.65% | 0.67% |

### 3.2.2 自集合计划合同生效以来集合计划累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东方红基金宝集合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 4 管理人报告

### 4.1 集合计划投资经理简介

| 姓名 | 职务                                | 任本集合计划投资经理期限   |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                         |
|----|-----------------------------------|----------------|------|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                                   | 任职日期           | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                            |
| 高义 | 上海东方证券资产管理有限公司执行董事，本集合资产管理计划投资经理。 | 2014 年 4 月 8 日 | -    | 12 年   | 上海东方证券资产管理有限公司执行董事，东方红新睿 2 号、东方红新睿 5 号、东方红基金宝集合资产管理计划投资经理。北京大学经济学博士，曾任东方证券研究所宏观策略高级研究员，东方证券资产管理业务总部首席策略师、上海东方证券资产管理有限公司研究部宏观策略研究员、私募权益投资部投资主办人、公募集合权益投资部投资经理。具备证券投资基金从业资格。 |

注：1、上述表格内集合计划首任集合计划投资经理“任职日期”指集合计划成立日，“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；对此后非首任集合计划投资经理，集合计划投资经理的“任职日期”和“离任日期”均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、上述表格内对本集合计划投资经理的“职务”及“说明”仅包括其兼任本公司大集合产品投资经理的情况。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的集合计划经理同时管理的产品情况

## 4.2 管理人对报告期内本集合计划运作合规守信情况的说明

本报告期，上海东方证券资产管理有限公司作为本集合计划管理人，严格遵守本集合计划资产管理合同以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，为集合计划份额持有人谋求最大利益，无损害集合计划持有人利益的行为，本集合计划投资组合符合有关法规及集合计划合同的约定。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本集合计划管理人一贯公平对待旗下管理的所有投资组合，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《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《上海东方证券资产管理有限公司公平交易制度》等规定。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本集合计划存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本集合计划的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

## 4.4 报告期内集合计划的投资策略和运作分析

一季度以来，市场大起大落——春节前快速上涨，节后大幅回落；行情热点由节前的“抱团龙头”切换为“碳中和”等相关主题概念；成交量大幅萎缩。投资策略上，我们自上而下对市场趋势持谨慎看法，中观层面重点关注增长稳定可持续、竞争结构良好的行业，同时坚持自下而上选择优秀公司。产品运作上，我们减持了部分食品饮料、新能源、券商等行业，增持了医药、互联网等行业。报告期内，产品总体仓位变化不大，仍看好互联网、消费、医药和先进制造等行业。

## 4.5 报告期内集合计划的业绩表现

截至本报告期末，本集合计划份额净值为 3.8142 元，份额累计净值为 3.9792 元；本报告期间集合计划份额净值增长率为-3.10%，业绩比较基准收益率为-0.53%。

## 4.6 报告期内集合计划持有人数或集合计划资产净值预警说明

报告期内，本集合计划未出现连续二十个工作日集合计划份额持有人数量不满二百人或者集合计划资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末集合计划资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）         | 占集合计划总资产的比例（%） |
|----|-------------------|---------------|----------------|
| 1  | 权益投资              | 25,593,743.25 | 29.36          |
|    | 其中：股票             | 25,593,743.25 | 29.36          |
| 2  | 基金投资              | 54,454,400.00 | 62.47          |
| 3  | 固定收益投资            | —             | —              |
|    | 其中：债券             | —             | —              |
|    | 资产支持证券            | —             | —              |
| 4  | 贵金属投资             | —             | —              |
| 5  | 金融衍生品投资           | —             | —              |
| 6  | 买入返售金融资产          | —             | —              |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | —             | —              |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 6,886,586.32  | 7.90           |
| 8  | 其他资产              | 234,610.89    | 0.27           |
| 9  | 合计                | 87,169,340.46 | 100.00         |

注：1、本集合计划本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 11,490,898.25 元人民币，占期末集合计划资产净值比例 13.35%。

2、本集合计划本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）      | 占集合计划资产净值比例（%） |
|----|------------------|--------------|----------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | —            | —              |
| B  | 采矿业              | —            | —              |
| C  | 制造业              | 9,740,555.00 | 11.31          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | —            | —              |
| E  | 建筑业              | —            | —              |
| F  | 批发和零售业           | —            | —              |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | —            | —              |
| H  | 住宿和餐饮业           | —            | —              |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | —            | —              |
| J  | 金融业              | —            | —              |
| K  | 房地产业             | —            | —              |
| L  | 租赁和商务服务业         | 918,240.00   | 1.07           |

|   |               |               |       |
|---|---------------|---------------|-------|
| M | 科学研究和技术服务业    | 1,962,800.00  | 2.28  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | —             | —     |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | —             | —     |
| P | 教育            | —             | —     |
| Q | 卫生和社会工作       | 1,481,250.00  | 1.72  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | —             | —     |
| S | 综合            | —             | —     |
|   | 合计            | 14,102,845.00 | 16.38 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别    | 公允价值（人民币）     | 占集合计划资产净值比例（%） |
|---------|---------------|----------------|
| 00 能源   |               |                |
| 01 原材料  |               |                |
| 02 工业   |               |                |
| 03 可选消费 | 4,788,620.85  | 5.56           |
| 04 主要消费 |               |                |
| 05 医药卫生 |               |                |
| 06 金融地产 |               |                |
| 07 信息技术 | 6,702,277.40  | 7.78           |
| 08 电信业务 |               |                |
| 09 公用事业 |               |                |
| 合计      | 11,490,898.25 | 13.35          |

注：以上分类采用中证行业分类标准。

### 5.3 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）  | 公允价值（元）      | 占集合计划资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|--------------|----------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台 | 3,500  | 7,031,500.00 | 8.17           |
| 2  | 00700  | 腾讯控股 | 13,000 | 6,702,277.40 | 7.78           |
| 3  | 03690  | 美团-W | 19,000 | 4,788,620.85 | 5.56           |
| 4  | 000858 | 五粮液  | 8,500  | 2,277,830.00 | 2.65           |
| 5  | 603259 | 药明康德 | 14,000 | 1,962,800.00 | 2.28           |
| 6  | 300015 | 爱尔眼科 | 25,000 | 1,481,250.00 | 1.72           |
| 7  | 601888 | 中国中免 | 3,000  | 918,240.00   | 1.07           |
| 8  | 300122 | 智飞生物 | 2,500  | 431,225.00   | 0.50           |

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。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本集合计划本报告期末未持有债券。

### 5.5 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本集合计划本报告期末未持有债券。

## 5.6 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.7 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本集合计划本报告期末未持有贵金属。

## 5.8 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

| 序号 | 基金代码   | 基金名称                   | 运作方式          | 持有份额（份）      | 公允价值（元）      | 占集合计划资产净值比例（%） | 是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金 |
|----|--------|------------------------|---------------|--------------|--------------|----------------|------------------------|
| 1  | 515650 | 富国中证消费50ETF            | 交易型开放式(ETF)   | 5,000,000.00 | 8,285,000.00 | 9.62           | 否                      |
| 2  | 513050 | 易中证海外中国互联网50(QDII-ETF) | 交易型开放式(ETF)   | 4,000,000.00 | 8,148,000.00 | 9.46           | 否                      |
| 3  | 164906 | 中国互联                   | 上市契约型开放式(LOF) | 4,000,000.00 | 7,976,000.00 | 9.26           | 否                      |
| 4  | 512690 | 鹏华中证酒ETF               | 交易型开放式(ETF)   | 3,200,000.00 | 7,596,800.00 | 8.82           | 否                      |
| 5  | 513100 | 国泰纳斯达克100(QDII-ETF)    | 交易型开放式(ETF)   | 1,400,000.00 | 6,060,600.00 | 7.04           | 否                      |
| 6  | 515170 | 华夏中证细分食品饮料产业主题ETF      | 交易型开放式(ETF)   | 6,000,000.00 | 5,118,000.00 | 5.94           | 否                      |
| 7  | 512170 | 华宝中证医疗ETF              | 交易型开放式(ETF)   | 6,000,000.00 | 4,548,000.00 | 5.28           | 否                      |
| 8  | 159996 | 家电ETF                  | 交易型开放式(ETF)   | 2,500,000.00 | 3,455,000.00 | 4.01           | 否                      |
| 9  | 512010 | 易方达沪深300医药ETF          | 交易型开放式(ETF)   | 500,000.00   | 1,444,000.00 | 1.68           | 否                      |

|    |        |        |              |            |              |      |   |
|----|--------|--------|--------------|------------|--------------|------|---|
| 10 | 159941 | 纳指 ETF | 交易型开放式 (ETF) | 500,000.00 | 1,302,000.00 | 1.51 | 否 |
|----|--------|--------|--------------|------------|--------------|------|---|

## 5.9 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本集合计划本报告期末未持有权证。

## 5.10 报告期末本集合计划投资的股指期货交易情况说明

### 5.10.1 报告期末本集合计划投资的股指期货持仓和损益明细

注：本集合计划本报告期末未进行股指期货投资。

### 5.10.2 本集合计划投资股指期货的投资政策

本集合计划投资股指期货的主要目的是回避市场风险和实施套利策略。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。管理人通过动态管理股指期货合约数量，以萃取相应股票组合的超额收益或获取低风险套利收益。另外，管理人在控制风险的前提下也会进行少量的投机交易，以更好地提高产品收益。

## 5.11 报告期末本集合计划投资的国债期货交易情况说明

### 5.11.1 本期国债期货投资政策

本集合计划参与国债期货的主要目的是套期保值和套利，在控制风险的前提下也会进行少量的投机交易，以更好地提高产品收益。管理人将根据不同的市场行情动态管理国债期货合约数量，在控制风险的前提下萃取收益。

### 5.11.2 报告期末本集合计划投资的国债期货持仓和损益明细

注：本集合计划本报告期末未进行国债期货投资。

### 5.11.3 本期国债期货投资评价

本集合计划本报告期末未进行国债期货投资。

## 5.12 投资组合报告附注

### 5.12.1 本集合计划投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本集合计划投资的腾讯控股（代码：00700）的发行主体腾讯控股有限公司因未依法申报违法实施的经营者集中行为于 2021 年 3 月 12 日被市场监管总局罚款 50 万元人民币。

本集合计划对上述证券的投资决策程序符合集合计划合同及公司制度的相关规定，本集合计

划管理人会对上述证券继续保持跟踪研究。

本集合计划持有的前十名证券中其余证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 5.12.2 集合计划投资的前十名股票是否超出集合计划合同规定的备选股票库

本集合计划投资的前十名股票未超出集合计划合同规定的备选股票库。

### 5.12.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 17,911.80  |
| 2  | 应收证券清算款 | 215,741.60 |
| 3  | 应收股利    | —          |
| 4  | 应收利息    | 957.49     |
| 5  | 应收申购款   | —          |
| 6  | 其他应收款   | —          |
| 7  | 待摊费用    | —          |
| 8  | 其他      | —          |
| 9  | 合计      | 234,610.89 |

### 5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本集合计划本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本集合计划本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 5.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 6 集合计划份额变动

单位：份

|                  |               |
|------------------|---------------|
| 报告期期初集合计划份额总额    | 22,793,650.52 |
| 报告期期间集合计划总申购份额   | 1,098,874.17  |
| 减：报告期期间集合计划总赎回份额 | 1,318,347.86  |

|                             |               |
|-----------------------------|---------------|
| 报告期期间集合计划拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -             |
| 报告期期末集合计划份额总额               | 22,574,176.83 |

## § 7 集合计划管理人运用固有资金投资本集合计划情况

### 7.1 集合计划管理人持有本集合计划份额变动情况

注：本报告期，本集合计划管理人未持有本集合计划份额。

### 7.2 集合计划管理人运用固有资金投资本集合计划交易明细

注：本报告期，本集合计划管理人不存在申购、赎回、或交易本集合计划的情况。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过 20%的情况

注：本集合计划本报告期单一投资者持有集合计划份额比例无达到或超过 20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、《东方红-基金宝集合资产管理计划说明书》
- 2、《东方红-基金宝集合资产管理合同》
- 3、中国证监会《关于核准东方证券股份有限公司设立东方红-基金宝集合资产管理计划的批复》
- 4、《东方红-基金宝集合资产管理计划托管协议》
- 5、《东方红-基金宝集合资产管理计划验资报告》
- 6、管理人业务资格批件、营业执照
- 7、《东方红-基金宝集合资产管理计划年度审计报告【正本】》

### 9.2 存放地点

备查文件存放于集合计划管理人的办公场所：上海市黄浦区外马路 108 号 7 层。

### 9.3 查阅方式

投资者可到集合计划管理人的办公场所免费查阅备查文件，亦可通过公司网站查阅，公司网址为：[www.dfham.com](http://www.dfham.com)。

上海东方证券资产管理有限公司

2021 年 4 月 22 日