

东方红明远 4 号集合资产管理计划 2021 年第 1 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：上海浦东发展银行股份有限公司太原分行

报告期间：2021 年 1 月 1 日-2021 年 3 月 31 日

报告送出日期：2021 年 04 月 22 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：	东方红明远 4 号集合资产管理计划
合同生效时间：	2017 年 8 月 11 日
管理人：	上海东方证券资产管理有限公司
托管人：	上海浦东发展银行股份有限公司太原分行

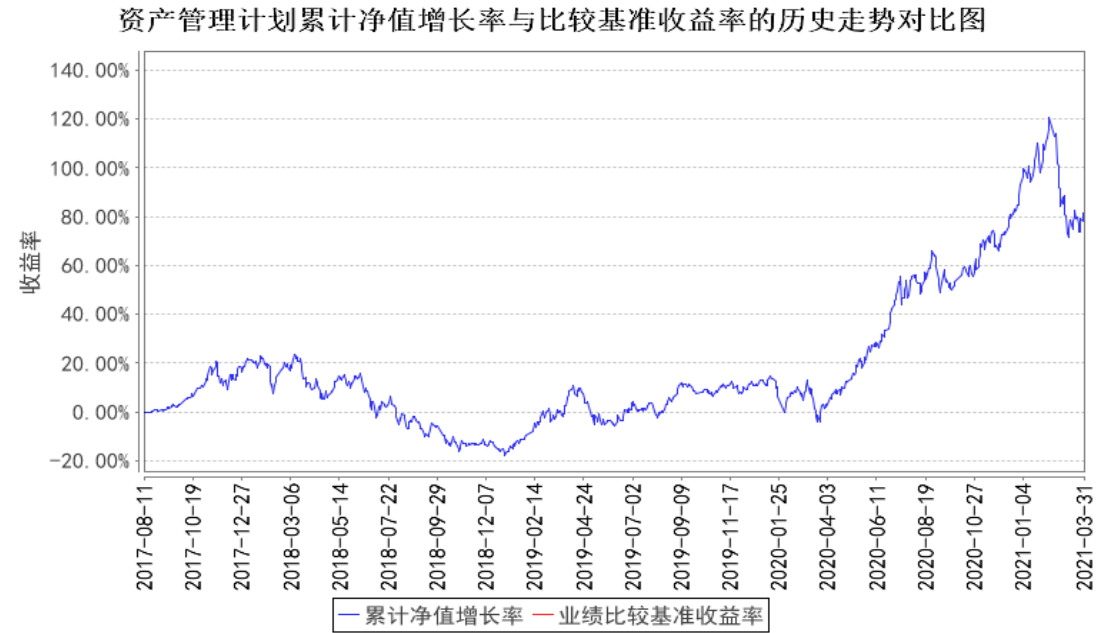
二、资产管理计划投资表现

(一) 主要财务指标

	本期末
期末资产净值(元)	94,925,537.14
本期利润(元)	-6,921,041.06
期末资产管理计划可分配利润	42,209,423.28
期末份额净值(元)	1.8007
期末份额累计净值(元)	1.8007
本期资产管理计划净值增长率	-6.80%
资产管理计划累计净值增长率	80.07%

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	85,252,094.85	88.59
	其中：境内股票	58,302,675.00	60.59
	港股投资	26,949,419.85	28.00
2	固定收益投资	1,357,588.10	1.41
	其中：债券	1,357,588.10	1.41
	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	9,600,897.35	9.98
7	其他资产	21,842.14	0.02
8	资产合计	96,232,422.44	100.00

注：“其他资产”包括“应收红利”、“应收利息”、“其他应收款”等项目。

(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(%)
01999	敏华控股	551,600.00	7,515,163.88	7.92
000786	北新建材	171,900.00	7,419,204.00	7.82
603899	晨光文具	80,600.00	6,884,046.00	7.25
000002	万科A	224,600.00	6,738,000.00	7.10
002415	海康威视	107,760.00	6,023,784.00	6.35
600036	招商银行	117,500.00	6,004,250.00	6.33
002372	伟星新材	212,460.00	5,366,739.60	5.65
02020	安踏体育	49,000.00	5,251,271.20	5.53
600519	贵州茅台	2,310.00	4,640,790.00	4.89
002557	洽洽食品	88,700.00	4,347,187.00	4.58

(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(%)
128029	太阳转债	6,770.00	1,357,588.10	1.43

(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
刘文杰	清华大学工学硕士	8 年	上海东方证券资产管理有限公司私募权益投资部投资经理，清华大学工学硕士，证券从业 8 年，曾任上海东方证券资产管理有限公司权益研究部研究员、资深研究员。
谭鹏万	复旦大学经济学博士	13 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 13 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执行董事、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

一季度市场跌宕起伏，各组合净值经历了较大的波动。尽管如此，组合的整体配置方向没有发生变化，依然以消费、医药、科技和制造业为主。

我们认为中国经济长期向好的基本面没有发生变化。工程师红利，科学家红利和管理红利，将把中国和中国企业带上新的高度。消费、医药、科技和制造业依然是未来几年最幸运的行业。

我们将秉持东方红长久坚持的价值观，自上而下优选幸运的行业，自下而上精选优秀的公司，努力为持有人带来较好的投资回报。

（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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对东方红明远4号集合资产管理计划的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、资产管理计划合同、托管协议的规定，不存在损害资产份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了资产托管人应尽的义务。

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、资产管理计划合同、托管协议的规定，对东方红明远4号集合资产管理计划的投资运作进行了监督，对资产管理计划资产净值的计算、资产管理计划份额申购赎回价格的计算以及资产管理计划费用开支等方面进行了认真的复核，未发现资产管理人存在损害资产份额持有人利益的行为。

本报告期内，由上海东方证券资产管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的主要财务指标、资产管理计划投资组合报告、当期发生的资产管理计划应支付的管理费、当期发生的资产管理计划应支付的托管费、资产管理计划投资收益分配情况财务数据真实、准确、完整。

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 2021年1月1日至2021年3月31日	上季度可比期间 2020年10月1日至2020年12月31日
当期发生的资产管理计划应支付的管理费	380,976.59	363,225.25

注：本资产管理计划的管理费按前一日资产管理计划的资产净值计提，管理费的年费率为1.5%。计算方法如下：

$$G=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

G为每日应计提的资产管理计划管理费

E为前一日资产管理计划资产净值

资产管理计划管理费每日计提，按月支付。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于次月首日起5个工作日内从资产管理计划资产中一次性支付给管理人。

（二）资产管理计划托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年3月31日	上季度可比期间 2020年10月1日至2020年12月31日
当期发生的资产管理计划应支付的托管费	50,796.85	48,430.02

注：本资产管理计划托管人托管费按前一日资产管理计划资产净值的0.2%年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的托管费；

E为前一日资产管理计划资产净值。

资产管理计划托管费每日计提，按月支付。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于次月首日起5个工作日内从资产管理计划资产中一次性支付给托管人。

（三）业绩报酬

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年3月31日	上季度可比期间 2020年10月1日至2020年12月31日
当期计提的业绩报酬	-	1,218,697.82

注：业绩报酬计提日为本资产管理计划分红日、委托人退出日或本资产管理计划终止日。每份资产管理计划份额的业绩报酬以该笔份额参与日（推广期参与的为本资产管理计划成立日，存续期参与的为参与当日）至本次业绩报酬计提日期间的年化收益率R，作为计提业绩报酬的基准。

$$R = \frac{A-B}{C} \times \frac{360}{D} \times 100\%$$

A为本次业绩报酬计提日的累计单位净值；

B为该笔份额参与日的累计单位净值；

C为该笔份额参与日的单位净值；

D为该笔份额参与日与本次业绩报酬计提日间隔天数。

（1）分红日提取业绩报酬

分红日提取业绩报酬的，按该笔资产管理计划份额的年化收益率计算，可提取的业绩报酬如下：

年化收益率（R）	计提比例	业绩报酬（H _i ）计算方法
R≤5%	0	$H_i = 0$
R>5%	20%	$H_i = \min(H_t, H_s)$ 其中：

		$H_t = \text{Div} \times F \times 20\%$ Div 为本次分红日每份分红金额; $H_s = \max \left(0, (R - 5\%) \times 20\% \times C \times F \times \frac{D}{360} - \sum_1^{i-1} H_i \right)$ $\sum_1^{i-1} H_i$ 为该笔份额参与日至本次业绩报酬计提日期间累计计提的业绩报酬总额; F 为该笔提取业绩报酬的份额。
--	--	--

(2) 委托人退出日或资产管理计划终止日提取业绩报酬

退出日或资产管理计划终止日提取业绩报酬的,退出日或资产管理计划终止日为业绩报酬计提日,该笔资产管理计划份额提取的业绩报酬如下:

年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (Hi) 计算方法
$R \leq 5\%$	0	$H_i = 0$
$R > 5\%$	20%	$H_i = \max \left(0, (R - 5\%) \times 20\% \times C \times F \times \frac{D}{360} - \sum_1^{i-1} H_i \right)$ 其中: $\sum_1^{i-1} H_i$ 为该笔份额参与日至本次业绩报酬计提日期间累计计提的业绩报酬总额; F 为该笔提取业绩报酬的份额。

由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令,托管人于 5 个工作日内将业绩报酬划拨给登记结算机构,由登记结算机构将业绩报酬支付给管理人。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

管理人的业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成。

七、本报告期资产管理计划投资收益分配情况

本报告期内,本资产管理计划未发生收益分配。

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) 公司关联人员的持有情况

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

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
2021 年 04 月 22 日