东方红-新睿2号集合资产管理计划
2016年第2季度资产管理报告

计划管理人：上海东方证券资产管理有限公司
计划托管人：中国工商银行股份有限公司
报告期间：2016年4月1日—2016年6月30日

重要提示

本报告由集合资产管理计划管理人上海东方证券资产管理有限公司依据《证券公司客户资产管理业务管理办法》（以下简称《管理办法》）及《证券公司集合资产管理业务实施细则》（以下简称“《细则》”）及其他有关规定制作。

中国证监会对东方红-新睿2号集合资产管理计划以下简称“集合计划”或“本集合计划”）出具了《关于核准上海东方证券资产管理有限公司设立东方红-新睿2号集合资产管理计划的批复》（证监许可[2012]250号）。中国证监会对本集合计划作出的任何决定，均不表明中国证监会对本集合计划的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明参与本集合计划没有风险。

集合资产管理计划托管人中国工商银行股份有限公司于2016年7月19日对本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报表、投资组合报告等数据进行了复核。本报告未经审计。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

管理人保证本报告书中所载资料的真实性、准确性和完整性，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担责任。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

本报告期起止时间：2016年4月1日－2016年6月30日

一、集合计划简介

1、基本资料

集合计划名称：东方红-新睿2号集合资产管理计划

集合计划类型：非限定性集合资产管理计划

集合计划成立日：2012年5月30日

集合计划成立规模：931,132,761.34份

集合计划报告期末计划总规模：161,095,737.20份

集合计划存续期：2012年5月30日-无固定期限。

集合计划投资目标：本集合计划以追求绝对收益为目标，充分挖掘各类投资品种折价和套利的机会，将价值回归转化成组合收益。

集合计划投资理念：本计划将在积极把握宏观经济和市场发展趋势的基础上，深入挖掘各类投资品种和交易方式中的折价和套利机会，重点把握大宗交易折价、封闭式基金折价、可转换债券价格明显低估、定向增发和定向增发破发等折价套利机会，将追求价值回归作为投资的主线。管理人针对上述不同投资品种设计了相应的投资策略和量化模型，在控制风险的前提下最大化投资收益。

2、集合计划管理人

名称： 上海东方证券资产管理有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路318号31层

办公地址：上海市黄浦区中山南路318号2号楼31层

授权代表：陈光明

联系人：刘上儒
联系电话：4009200808
传真电话：021-63326981
网址：http://www.dfham.com
3、集合计划托管人
名称：中国工商银行股份有限公司
办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人：易会满
联系人：蒋松云
联系电话：010-66105799
传真：010-66105798
网址：www.icbc.com.cn
4、注册登记机构
名称：中国证券登记结算有限责任公司
办公地址：中国北京市西城区太平桥大街17号
5、会计师事务所和经办注册会计师
名称：立信会计师事务所有限公司
办公地址：上海市南京东路61号4楼
经办注册会计师：王斌
联系电话：021-63391166
传真：021-63392558

二、主要财务指标和集合资产管理计划净值表现

1、 主要财务指标：

单位：人民币元

	主要财务指标	2016年6月30日
1	期初单位集合计划资产净值	1.1931
2	期末单位集合计划资产净值	1.2248
3	期末单位集合计划累计资产净值	1.8948
4	期末集合计划资产净值	197,308,044.48
5	本期集合计划利润	4,819,691.29
6	期末集合计划可分配利润	36,212,307.28
7	单位期末集合计划可分配利润	0.2248
8	本期集合计划净值增长率	2.66%
9	集合计划累计净值增长率	101.90%

注：本期期末集合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认购或交易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、 财务指标的计算公式

（1）期末单位集合计划资产净值 = 期末集合计划资产净值÷期末集合计划份额

（2）期末单位集合计划累计资产净值=期末单位集合计划资产净值+单位集合计划累计分红

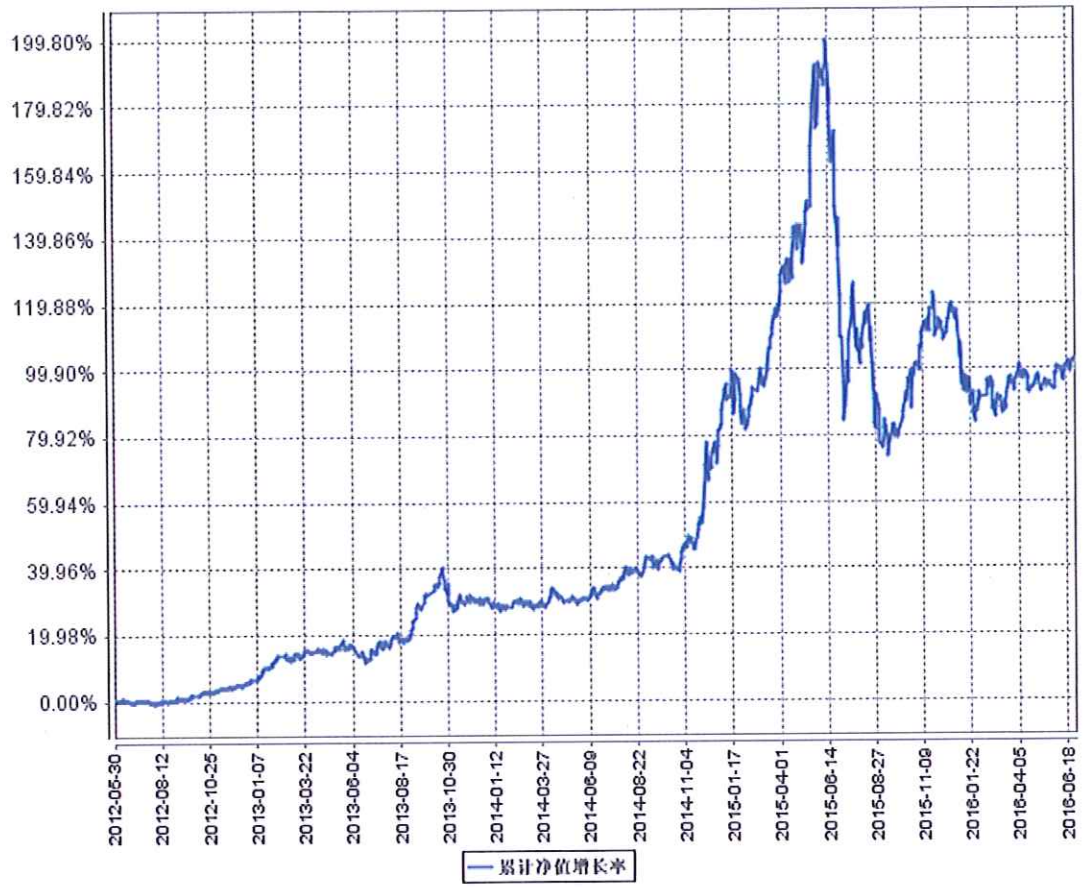
（3）本期集合计划净值增长率=(分红前一天单位净值/期初单位净值)*{期末单位净值/(分红前一天单位净值-分红金额)}-1

（4）集合计划累计净值增长率 =(第一次分红后单位集合计划资产净值增长率+1)×（第二

次分红后单位集合计划资产净值增长率+1）×…… ×（最后一次分红后单位集合计划资产净值增长率+1）－1

（5）单位期末集合计划可分配利润= 集合计划期末可分配利润÷期末集合计划份额

3、集合计划净值收益率图



4、收益分配情况

集合计划成立以来，本集合计划收益分配情况：

分配红利日期	每10份集合计划分红（至少保留2位小数）	备注
2015-03-06	5.0000元	-
2013-10-28	0.8000元	-
2013-03-28	0.4000元	-
2013-01-29	0.5000元	-
合计	6.7000元	-

5、管理人提取业绩报酬情况

根据本计划合同、说明书约定，本期管理人提取业绩报酬276,626.41元

三、集合计划管理人报告

（一） 业绩表现

截止到2016年6月30日，集合计划单位资产净值为1.2248元，本期净值增长率为2.66%，集合计划单位累计资产净值1.8948元,累计净值增长率为101.90%。

（二） 投资主办人简介

高义先生，东方证券资产管理有限公司私募权益投资部投资主办人，北京大学经济学博士，证券从业8年，历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部首席策略师、东方证券资产管理有限公司研究部宏观策略研究员，擅长于从宏观经济、行业轮动和历史规律中寻找自上而下的投资机会。

（三） 投资主办人工作报告

二季度以来，市场在经历反弹后进入震荡盘整阶段，整体看指数窄幅波动，但部分行业、主题和个股表现强势。即使在国际金融市场大幅波动的背景下，A股投资者的情绪也逐步趋于稳定，市场的赚钱效应略有显现。

展望下半年，全球经济在动荡中挣扎，不确定性有所上升：美国经济复苏持续但弱于预期，脱欧公投给欧元区温和复苏前景蒙上阴影，日本激进宽松的货币政策效力减弱。国内经济将呈现较为稳定的态势,但通胀下半年仍有上行压力，在人民币贬值和房价上涨压力下，货币政策大幅宽松概率较低。

产品管理上，二季度产品配置仍较为均衡，总体继续控制权益仓位，并精选个股品种。考虑到全球经济、金融市场不确定因素较多，下半年我们仍将保持谨慎乐观态度，继续聚焦于折价封基、定增破发、分级A及部分精选个股上，并逐步开始关注估值有所下降的可转债，力争为投资者带来长期稳定回报。

（四）内部性声明

1、集合计划运作合规性声明

本报告期内，集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》及其他法律法规的规定，本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划资产，在严格控制风险的基础上为集合计划持有人谋求最大利益，运作合法合规，无损害集合计划持有人利益的行为。

2、风险控制报告

集合计划管理人设立合规与风险管理部作为独立风险监督管理部门,通过系统监控和现场检查，对集合资产管理计划运作过程中的各类风险行全面的监督、检查和评价。在交易系统中设置各类合规性指标进行限制，实现交易事前控制，确保集合资产管理计划运作的合法合规。对于每日风险监控中发现的可能出现的风险状况，及时提醒投资主办人或责任部门采取相应措施，尽可能规避风险事件发生。

集合计划管理人在实行严格的内部风险控制的同时，也接受托管银行、上级监管机构、中介审计机构以及委托人的监督。

在本报告期内，本集合计划管理人对集合计划的管理始终都能按照有关法律法规、公司相关制度和本集合计划说明书的要求进行。本集合计划的投资决策、投资交易程序、投资权

限等各方面均符合规定的要求；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；相关的信息披露和财务数据皆真实、完整、准确、及时。

四、集合计划投资组合报告

2016年6月30日

单位：元

1、资产组合情况：

项　　目	期末市值	占期末总资产比例
银行存款和清算备付金	12,038,053.73	6.02%
交易保证金	131,005.24	0.07%
证券清算款	1,959,871.73	0.98%
应收申购款	-	-
股票投资	106,234,320.89	53.14%
债券投资	382,671.60	0.19%
权证投资	-	-
基金投资	79,165,333.27	39.60%
资产支持证券投资	-	-
买入返售金融资产	-	-
其它投资	-	-
其它资产	3,436.49	-
合计	199,914,692.95	100.00%

“其他资产”包括“应收红利”、“应收利息”、“其他应收款”等项目。

2、报告期末按市值占集合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	数　量	市　值	市值占净值比
600066	宇通客车	915,640	18,129,672.00	9.19%
002415	海康威视	703,797	15,103,483.62	7.65%
600519	贵州茅台	33,100	9,662,552.00	4.90%
300017	网宿科技	117,616	7,903,795.20	4.01%
002074	国轩高科	175,600	6,930,932.00	3.51%
000651	格力电器	276,800	6,108,976.00	3.10%
000568	泸州老窖	173,110	5,141,367.00	2.61%
601012	隆基股份	290,800	3,794,940.00	1.92%
600208	新湖中宝	861,100	3,642,453.00	1.85%
000001	平安银行	343,160	2,985,492.00	1.51%

3、报告期末按市值占集合计划资产净值比例大小排序的基金明细

基金代码	基金名称	数　量	市　值	市值占净值比
500056	基金科瑞	17,565,253.00	15,773,597.19	7.99%
500058	基金银丰	13,976,356.00	14,325,764.90	7.26%
150194	互联网A	7,997,700.00	7,989,702.30	4.05%

150200	券商A	7,961,803.00	7,945,879.39	4.03%
150181	军工A	6,994,802.00	7,001,796.80	3.55%
150171	证券A	7,035,513.00	6,979,228.90	3.54%
184721	基金丰和	4,978,659.00	5,132,997.43	2.60%
184728	基金鸿阳	4,110,265.00	4,126,706.06	2.09%
150175	H股A	4,401,062.00	3,934,549.43	1.99%
150205	国防A	3,919,600.00	3,927,439.20	1.99%
184722	基金久嘉	2,143,413.00	2,027,668.70	1.03%
163113	申万证券	1.00	1.11	-
160633	鹏华证券分级	1.00	0.97	-
165521	信诚金融	1.00	0.89	-

4、报告期末按市值占集合计划资产净值比例大小排序的权证明细

权证代码	权证名称	数　　量	市　　值	市值占净值比

5、报告期末按市值占集合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	数　　量	市　　值	市值占净值比
110031	航信转债	3,470	382,671.60	0.19%

6、报告期末期货投资情况

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
总额合计				-
减：可抵销期货暂收款				-
股指期货投资净额				0.00

五、集合计划份额变动情况

本期 2016年4月1日-2016年6月30日 本计划份额变动情况：

期初总份额	本期参与份额	本期退出份额	期末总份额
166,856,144.83	469,090.43	6,229,498.06	161,095,737.20

六、重要事项揭示

（一）在本报告期内本集合计划托管人的董事长更改为易会满先生、行长没有发生变更。

（二）在本报告期内本集合计划管理人的董事长、总经理没有发生变更。

七、备查文件目录

（一） 本集合计划备查文件目录

1、《东方红-新睿2号集合资产管理计划说明书》

2、《东方红-新睿2号集合资产管理合同》

3、 中国证监会《关于核准上海东方证券资产管理有限公司设立东方红-新睿2号、东方红-新睿3号集合资产管理计划的批复》

4、《东方红-新睿2号集合资产管理计划托管协议》

5、《东方红-新睿2号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-新睿2号集合资产管理计划年度审计报告【正本】》

（二） 查阅方式

投资者可在工作时间到管理人办公地址或登录管理人网站查阅。如有疑问，可通过以下途径向管理人上海东方证券资产管理有限公司咨询：

网址：www.dfham.com，客户服务热线：4009200808

上海东方证券资产管理有限公司

2016年7月21日