

东方红6号集合资产管理计划 2017年第3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：2017年7月1日—2017年9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6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6号集合资产管理计划的批复》（证监许可[2010]1453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2017年10月20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：2017年7月1日—2017年9月30日

一、集合计划简介

1、基本资料

集合计划名称：东方红6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：2010年11月22日

集合计划成立规模：1,997,221,405.74份

集合计划报告期末计划总规模：330,283,464.66份

集合计划存续期：2010年11月22日-无固定期限。

集合计划投资目标：深入研究，精选个股，稳健增值，追求绝对收益。

集合计划投资理念：本集合计划将依托管理人积累的投资管理经验，通过对宏观经济的深入研究，采用自下而上的精选个股和自上而下的大类资产配置相结合的策略；主动投资于“价值”型优质证券，分享中国经济稳步增长带来的财富成果。

集合计划业绩比较基准：沪深300指数*70%+上证国债指数*30%。

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

法人代表：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: 郭明

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	2017年9月30日
1	期初单位集合计划资产净值	2.5900
2	期末单位集合计划资产净值	2.8591
3	期末单位集合计划累计资产净值	2.8591
4	期末集合计划资产净值	944,298,632.81
5	本期集合计划利润	86,528,639.49
6	期末集合计划可分配利润	533,026,822.74
7	单位期末集合计划可分配利润	1.6138
8	本期集合计划净值增长率	10.39%
9	集合计划累计净值增长率	185.91%

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

3、集合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



本集合计划的业绩比较基准是：沪深300指数*70% + 上证国债指数*30%。

4、本期每份额净值增长率与投资基准收益率的比较

期间	计划净值增长率①	投资基准收益率②	①-②
2017年7月1日-2017年9月30日	10.39%	3.30%	7.09%
2010年11月22日-2017年9月30日	185.91%	27.66%	158.25%

5、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

6、管理人提取业绩报酬情况

根据本计划说明书合同约定，本期管理人提取业绩报酬5,089,929.50元

三、集合计划管理人报告

(一) 业绩表现

截止到2017年9月30日,集合计划单位资产净值为2.8591元,本期净值增长率为10.39%,集合计划单位累计资产净值2.8591元,累计净值增长率为185.91%。

(二) 投资主办人简介

钱思佳女士,上海东方证券资产管理有限公司私募权益投资部投资主办人,上海交通大学经济学硕士,证券从业9年,历任东方证券资产管理业务总部研究员,上海东方证券资产管理有限公司研究部高级研究员、专户投资部投资主办人。

童卓先生,上海东方证券资产管理有限公司执行董事、私募权益投资部副总经理、投资主办人,中国科学技术大学工学硕士,证券从业7年,历任东方证券研究所研究员,华夏基金管理有限公司投资研究部研究员,上海东方证券资产管理有限公司研究部资深研究员、权益研究部副总监、总监。

(三) 投资主办人工作报告

第三季度,国内外的市场总体运行较为平稳,A股市场也迎来了一波上涨。特别是以原材料为代表的周期品在环保限产的条件下,价格出现了一波较大幅度的提升,带动了相关股票板块的上涨。期间,上证综指获得了4.9%左右的涨幅,我们的产品上涨了11%左右,获得了较大幅度的超额收益。

国内的宏观经济整体比较平稳,房地产调控仍然没有放松的态势,政府正在尝试各种方案,希望能够建立起房地产市场的长效调控机制。预计房地产销售的同比增速会逐个季度下降。而环保部门在全国进行一场旨在淘汰落后污染产能环保检查,执法力度不断强化,造成了上游资源品价格的短期快速上涨。然而,如果这种上涨后续缺乏需求的支撑,估计力度会逐渐减弱。但是从这些政策的出台,可以看出国家正在试图从淘汰落后产能和转换经济增长方式两个方面着手解决经济当中存在的一系列的问题,而且这些可能仅仅只是开始。

另一方面,新的增长动力仍然需要靠市场和产业自身的发展去培育。在我们的产业研究当中,可以清晰的看到在互联网、人工智能、新能源、精密制造、汽车、家电、医药等等领域,不仅仅出现了龙头企业,而且由点及面,开始出现具有世界竞争力的优势产业集群,并且这些产业集群还在快速的扩张当中。这些产业仍然存在巨大的潜在机会。也是我们重点研究和投资的重要领域。

展望下一个季度,目前大多数蓝筹股的估值仍然在合理区间以内,政府也表现了较强的维持市场稳定的态度,自下而上的寻找结构性的机会仍然是我们的主要策略。我们将继续秉承价值投资的理念,选择护城河较深,雪道够长,价格便宜的公司,买入并且长期持有,努力为持有人创造回报。

(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进行全面的监督、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

2017年9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	186,104,527.93	19.68%
交易保证金	57,457.21	0.01%
证券清算款	-	-
应收申购款	-	-
股票投资	708,140,280.05	74.89%
其中:港股投资	243,044,118.15	25.70%
债券投资	1,675,900.00	0.18%
权证投资	-	-
基金投资	2,407,819.78	0.25%
资产支持证券投资	-	-
买入返售金融资产	47,100,588.75	4.98%
其它投资	-	-
其它资产	53,391.46	0.01%
合计	945,539,965.18	100.00%

注:1、“其他资产”包括“应收红利”、“应收利息”、“其他应收款”等项目。

2、通过港股通交易机制持有的港股期末公允价值为243,044,118.15元,占集合计划资产净值比例25.74%。

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
600887	伊利股份	3,236,789	89,011,697.50	9.43%
00175	吉利汽车	3,911,794	73,121,287.58	7.74%
600066	宇通客车	2,629,040	64,674,384.00	6.85%
601012	隆基股份	1,434,295	42,268,673.65	4.48%
600612	老凤祥	958,728	39,585,879.12	4.19%
01378	中国宏桥	6,337,000	37,959,282.71	4.02%
00425	敏实集团	1,070,000	37,183,670.58	3.94%

002271	东方雨虹	803,224	30,980,349.68	3.28%
02238	广汽集团	1,925,984	29,586,682.70	3.13%
600276	恒瑞医药	440,076	26,373,754.68	2.79%

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
511990	华宝兴业现金添益	24,064.00	2,407,819.78	0.25%

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期权明细

期权代码	期权名称	数量	市值	市值占净值比
------	------	----	----	--------

6、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
128016	雨虹转债	16,759	1,675,900.00	0.18%

7、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 2017年7月1日-2017年9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
339,850,016.93	-	9,566,552.27	330,283,464.66

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、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6号集合资产管理计划说明书》
- 2、《东方红6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6号集合资产管理计划的批复》
- 4、《东方红6号集合资产管理计划托管协议》
- 5、《东方红6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6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
2017年10月27日

