

东方红6号集合资产管理计划 2018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：2018年7月1日—2018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制作。

集合资产管理计划托管人中国工商银行股份有限公司于2018年10月24日对本报告中的财务指标、净值表现、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：2018年7月1日2018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：340,587,424.42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：本集合计划将依託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

法定代表人：潘鑫军

联系人：吴比

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：010-66105798

传真：010-66105799

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：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

办公地址：上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼

经办注册会计师：薛竞、陈熹

联系电话：021-23232035

传真：021-23238800

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	2018年9月30日
1	期初单位集合计划资产净值	2.3821
2	期末单位集合计划资产净值	2.1635
3	期末单位集合计划累计资产净值	2.7265
4	期末集合计划资产净值	736,866,140.22
5	本期集合计划利润	-76,493,321.78
6	期末集合计划可分配利润	396,278,715.80
7	单位期末集合计划可分配利润	1.1635
8	本期集合计划净值增长率	-9.18%
9	集合计划累计净值增长率	166.79%

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

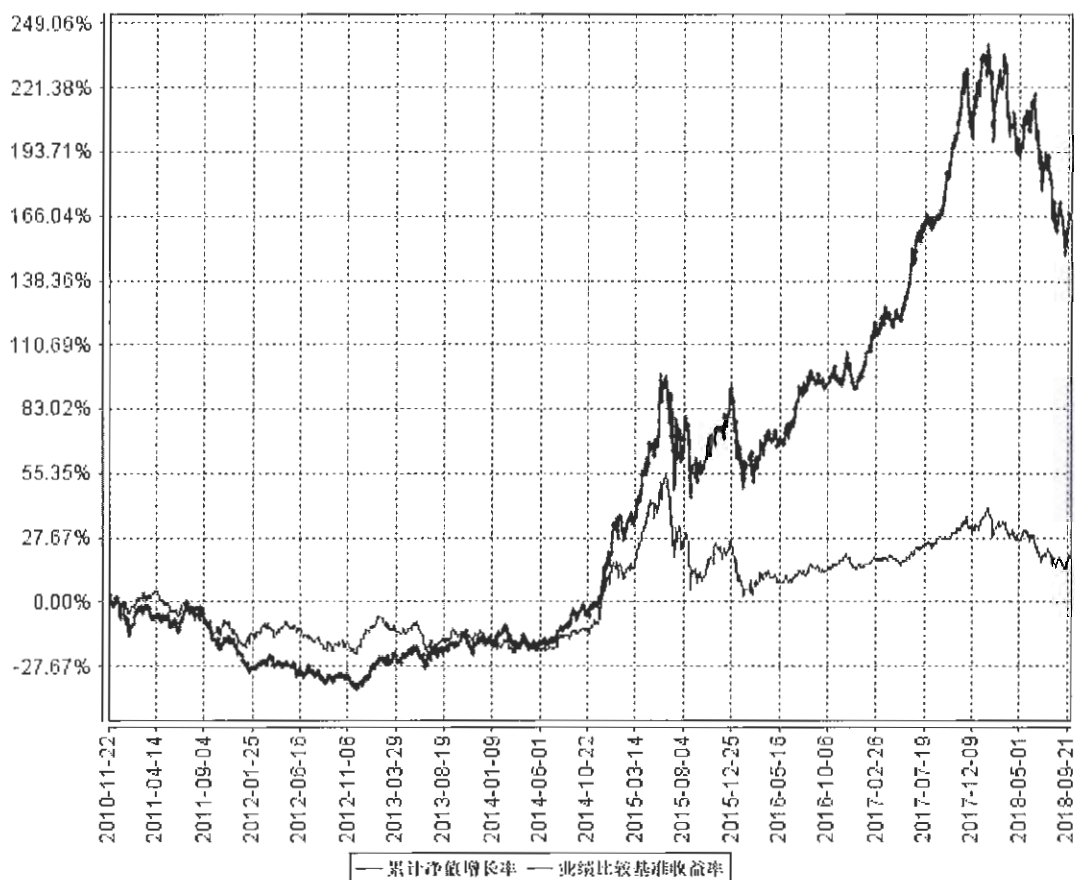
(1) 期末单位集合计划资产净值 = 期末集合计划资产净值 ÷ 期末集合计划份额

(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
2018年7月1日-2018年9月30日	-9.18%	-1.06%	-8.12%
2010年11月22日-2018年9月30日	166.79%	20.01%	146.78%

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
2018-06-27	1.4000元	-
2017-10-20	4.2300元	-
合计	5.6300元	-

6、管理人提取业绩报酬情况

根据本计划说明书及合同约定，本期管理人提取业绩报酬913,206.94元

三、集合计划管理人报告

(一) 业绩表现

截止到2018年9月30日,集合计划单位资产净值为2.1635元,本期净值增长率为-9.18%,集合计划单位累计资产净值2.7265元,累计净值增长率为166.79%。

(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总经理助理、投资主办人,上海交通大学经济学硕士,证券从业10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。

郭乃幸先生,东方证券资产管理有限公司私募权益投资部投资主办人,上海交通大学经济学博士,证券从业5年,历任东方证券资产管理有限公司研究部研究员、权益研究部资深研究员。

(三) 投资主办人工作报告

三季度以来,市场延续了调整走势,整个期间,上证指数下跌0.92%,深圳成指下跌10.43%,创业板指下跌12.16%。分行业看,金融、采掘、钢铁等行业表现相对较好,家电、生物医药、纺织等行业下跌幅度较大。

当前我国面临的宏观环境面临较大不确定性,内部来看,去杠杆环境下,社会融资规模持续下降,固定资产投资增速下滑,房地产销售和价格的压力显现;外部风险逐步放大,美国对中国的贸易战持续升温、反复,带来了较大不确定性,除此之外,美国试图抛弃日前的多边贸易体系规则,推出符合其利益方向的贸易体系,对中国进一步改革开放和发展都构成一定的威胁。这些宏观环境,使得整体经济的出口、投资、消费均面临压力,反映到资本市场上有了剧烈的波动。

站在目前时点,市场充满了悲观情绪,很多行业的数据也逐步表现出放缓压力,市场的整体估值不断下行,估值已经处于历史低点。当前,经济社会各行业的人们,都有不同程度的悲观情绪,回顾历史上的股市底部,每一次也都有类似的信心危机以及对未来的各种担忧。当前和未来中国发展所面临的外部环境可能要比从前更加严峻,面临更多的挑战,但中国当前自身的产业链更加完善,中国本身的竞争力在逐步提升,企业的竞争力更加强大。在最困难的时刻,我们仍然将用积极心态去看待未来的市场,积极布局越来越便宜的优秀公司,努力为客户创造超额收益。

(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

2018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	71,713,406.77	9.66%
交易保证金	88,255.98	0.01%
证券清算款	-	-
应收申购款	-	-
股票投资	511,811,470.76	68.92%
其中：港股投资	186,196,106.94	25.07%
债券投资	1,483,828.29	0.20%
权证投资	-	-
基金投资	2,497,447.23	0.34%
资产支持证券投资	-	-
买入返售金融资产	155,000,387.50	20.87%
其它投资	-	-
其它资产	-13,688.46	-
合计	742,581,108.07	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
00175	吉利汽车	4,457,794	61,193,118.95	8.30%
600887	伊利股份	2,223,783	57,106,747.44	7.75%
00425	敏实集团	1,630,000	46,328,487.55	6.29%
300124	汇川技术	1,666,304	45,731,620.80	6.21%
000418	小天鹅A	845,688	41,066,609.28	5.57%
600612	老凤祥	810,628	30,836,289.12	4.18%
600486	扬农化工	571,456	26,492,700.16	3.60%
00291	华润啤酒	890,000	24,630,240.48	3.34%
002008	大族激光	482,770	20,454,964.90	2.78%
600066	宇通客车	1,214,651	17,818,930.17	2.42%

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	24,958.00	2,497,447.23	0.34%

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
128035	大族转债	14,217	1,483,828.29	0.20%

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 2018年7月1日-2018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
346,170,077.66	-	5,582,653.24	340,587,424.42

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
2018年10月26日

