

---

# 东方红-新睿 3 号集合资产管理计划 2018 年年度报告

2018 年 12 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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

集合计划托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2019 年 3 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 集合计划简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 集合计划基本情况.....	5
2.2 集合计划产品说明.....	5
2.3 集合计划管理人和集合计划托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、集合计划净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 集合计划净值表现.....	7
3.3 过去三年集合计划的利润分配情况.....	9
<b>§4 集合计划管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 集合计划管理人及集合计划投资主办人情况.....	10
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.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内集合计划的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本集合计划的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内集合计划估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内集合计划利润分配情况的说明.....	15
4.9 报告期内管理人对本集合计划持有人数或集合计划资产净值预警情形的说明.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本集合计划托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本集合计划投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>21</b>
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（集合计划净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	26
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>56</b>
8.1 期末集合计划资产组合情况.....	56
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	56
8.3 期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	59
8.6 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.....	60
8.7 期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	60

8.8	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五名贵金属投资明细 .....	60
8.9	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 .....	60
8.10	报告期末本集合计划投资的股指期货交易情况说明 .....	60
8.11	报告期末本集合计划投资的国债期货交易情况说明 .....	61
8.12	投资组合报告附注 .....	61
<b>§9</b>	<b>集合计划份额持有人信息 .....</b>	<b>63</b>
9.1	期末集合计划份额持有人户数及持有人结构 .....	63
9.2	期末集合计划管理人的从业人员持有本集合计划的情况 .....	63
9.3	期末集合计划管理人的从业人员持有本开放式集合计划份额总量区间的情况 .....	63
<b>§10</b>	<b>开放式集合计划份额变动 .....</b>	<b>64</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示 .....</b>	<b>65</b>
11.1	集合计划管理人、集合计划托管人的专门集合计划托管部门的重大人事变动 .....	65
11.2	涉及集合计划管理人、集合计划财产、集合计划托管业务的诉讼 .....	65
11.3	集合计划投资策略的改变 .....	65
11.4	为集合计划进行审计的会计师事务所情况 .....	65
11.5	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	65
11.6	其他重大事件 .....	66
<b>§12</b>	<b>备查文件目录 .....</b>	<b>69</b>
12.1	备查文件目录 .....	69
12.2	存放地点 .....	69
12.3	查阅方式 .....	69

## § 2 集合计划简介

### 2.1 集合计划基本情况

集合计划名称	东方红-新睿 3 号集合资产管理计划
集合计划简称	东方红新睿 3 号集合
集合计划代码	910011
集合计划运作方式	契约型开放式
集合计划合同生效日	2012 年 8 月 8 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	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末集合计划份额总额	89,951,007.17 份
集合计划合同存续期	不定期

### 2.2 集合计划产品说明

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，并通过股指期货对冲部分系统性风险，力求在不同的市场环境下实现投资组合的稳健增值。
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。

### 2.3 集合计划管理人和集合计划托管人

项目		集合计划管理人	集合计划托管人
名称		上海东方证券资产管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李云亮	胡波
	联系电话	021-63325888	021-61618888
	电子邮箱	service@dfham.com	Hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		4009200808	95528
传真		021-63326981	021-63602540
注册地址		上海市黄浦区中山南路 318 号 31 层	上海市中山东一路 12 号
办公地址		上海市黄浦区中山南路 318 号 2 号楼 31 层	上海市北京东路 689 号
邮政编码		200010	200120

法定代表人	潘鑫军	高国富
-------	-----	-----

## 2.4 信息披露方式

登载集合计划年度报告正文的管理人互联网网址	www.dfham.com
集合计划年度报告备置地点	上海东方证券资产管理有限公司 上海市中山南路318号2号楼31层 上海浦东发展银行股份有限公司 上海市中山东一路12号

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	中国北京市西城区太平桥大街17号

### § 3 主要财务指标、集合计划净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	1,434,520.34	15,631,598.59	3,305,822.77
本期利润	-55,510,885.41	53,201,554.58	-5,904,949.58
加权平均集合计划份额本期利润	-0.5575	0.5714	-0.1760
本期加权平均净值利润率	-23.63%	24.24%	-9.18%
本期集合计划份额净值增长率	-23.02%	34.94%	-5.99%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	79,412,026.30	161,699,965.16	31,900,527.50
期末可供分配集合计划份额利润	0.8828	1.3461	0.9162
期末集合计划资产净值	169,363,033.47	310,625,573.15	66,720,088.34
期末集合计划份额净值	1.8828	2.5858	1.9162
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
集合计划份额累计净值增长率	133.28%	203.05%	124.57%

注：1、表中的“期末”均指报告期最后一日，即 12 月 31 日；“本期”指 2018 年 1 月 1 日集合计划- 2018 年 12 月 31 日。

2、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。

3、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。

4、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

#### 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

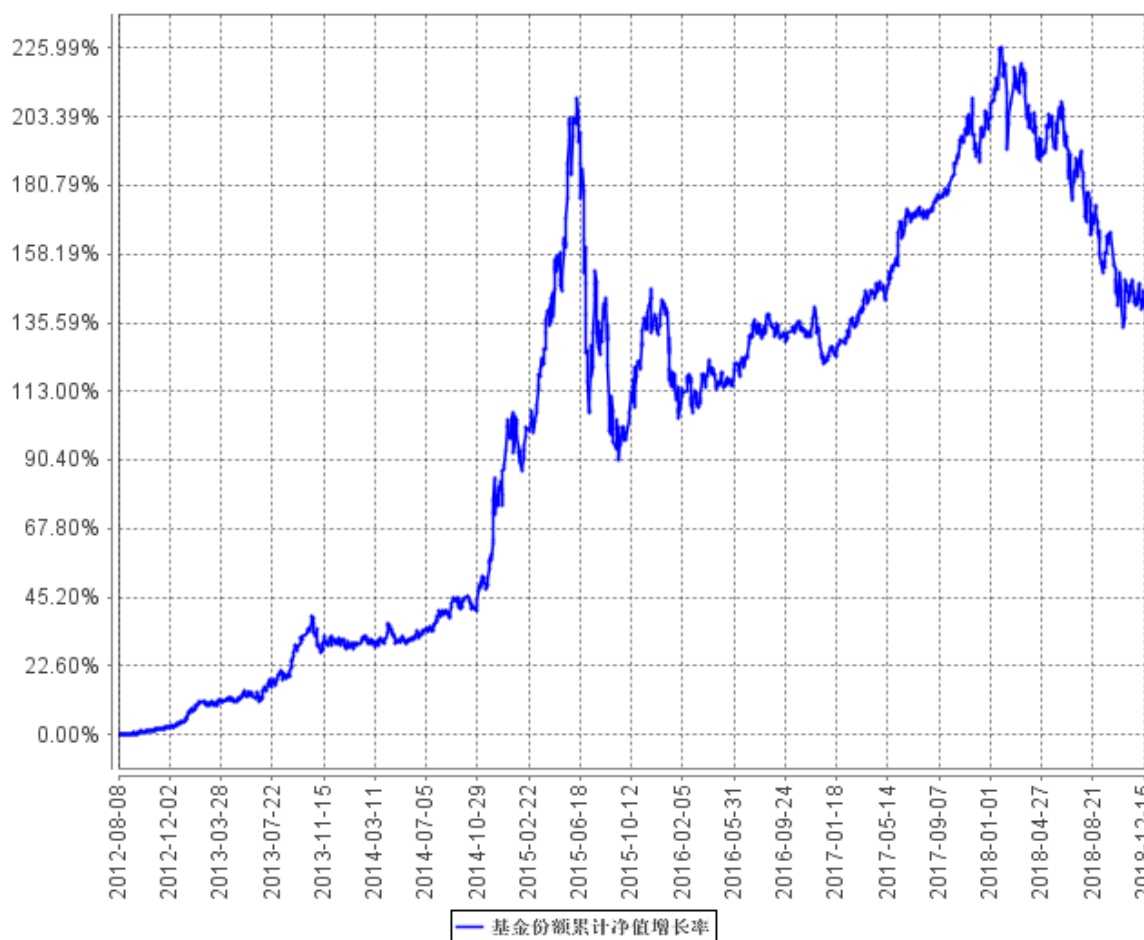
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-12.01%	1.30%	-	-	-	-

过去六个月	-19.76%	1.22%	-	-	-	-
过去一年	-23.02%	1.21%	-	-	-	-
过去三年	-2.34%	1.00%	-	-	-	-
过去五年	77.49%	1.33%	-	-	-	-
自集合计划合同生效起至今	133.28%	1.20%	-	-	-	-

注：1、本集合计划合同于2012年8月8日生效。自集合计划合同生效日起至今指2012年8月8日-2018年12月31日。

2、本集合计划无业绩比较基准。

### 3.2.2 自集合计划合同生效以来集合计划份额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

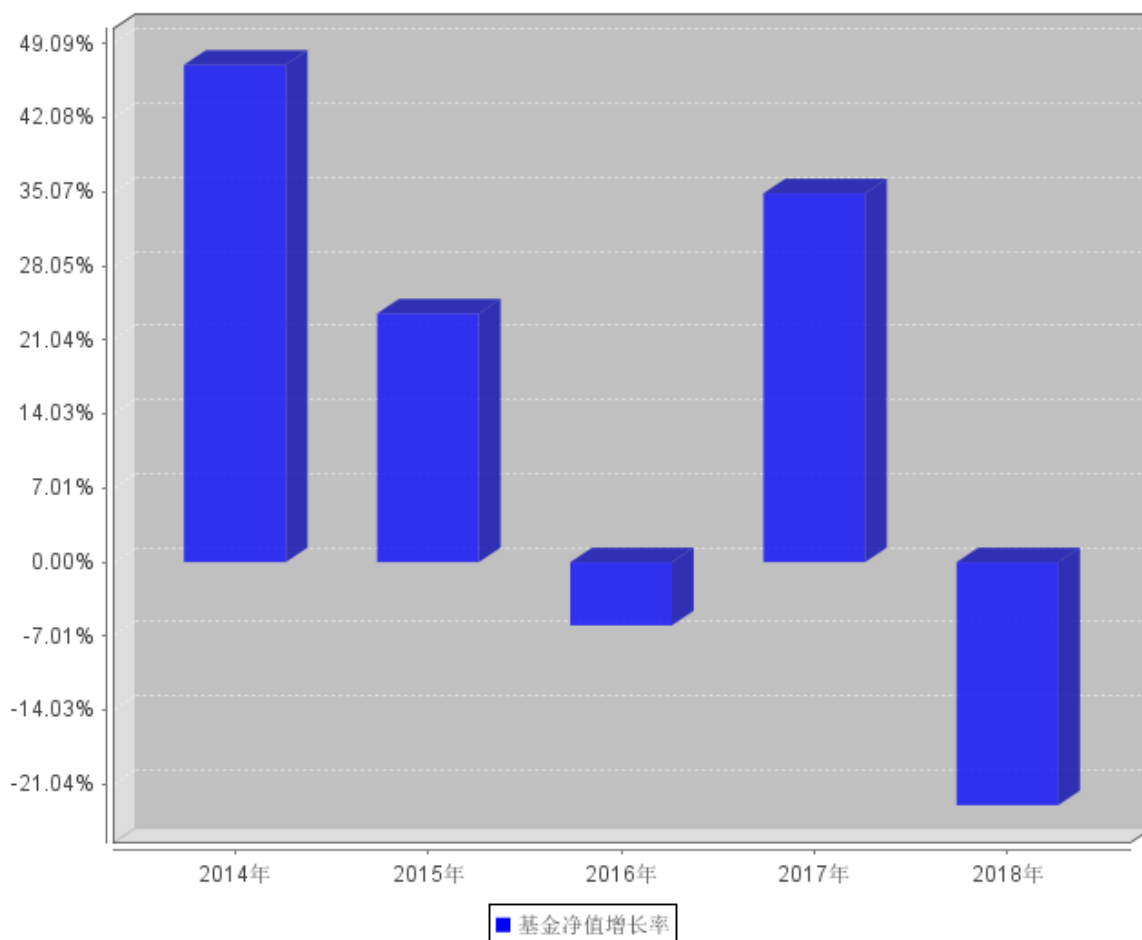


注：1、截止日期为2018年12月31日。

2、本集合计划无业绩比较基准。自集合计划合同生效以来集合计划每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较。



### 3.2.3 过去五年集合计划每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：1. 本集合计划合同生效日期为 2012 年 8 月 8 日。

2. 本集合计划无业绩比较基准。

### 3.3 过去三年集合计划的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份集合计划份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018	1.3500	8,467,345.46	3,381,249.57	11,848,595.03	
2017	-	-	-	-	
2016	-	-	-	-	
合计	1.3500	8,467,345.46	3,381,249.57	11,848,595.03	

## § 4 集合计划管理人报告

## 4.1 集合计划管理人及集合计划投资主办人情况

### 4.1.1 集合计划管理人及其管理基金与集合计划的经验

上海东方证券资产管理有限公司成立于 2010 年 7 月 28 日，是国内首家获中国证监会批准设立的券商系资产管理公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准东方证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可[2010]518 号）批准，由东方证券股份有限公司出资 3 亿元在原东方证券资产管理业务总部的基础上成立。2013 年 8 月，公司成为首家获得“公开募集证券投资基金管理业务资格”的证券公司。公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。截至 2018 年 12 月 31 日，公司共管理东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金、东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金、东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金、东方红稳健精选混合型证券投资基金、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金、东方红优势精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红纯债债券型发起式证券投资基金、东方红收益增强债券型证券投资基金、东方红信用债债券型证券投资基金、东方红睿轩沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金、东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金、东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金、东方红价值精选混合型证券投资基金、东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红益鑫纯债债券型证券投资基金、东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红货币市场基金、东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红配置精选混合型证券投资基金、东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金、东方红恒元五年定期开放灵活配置混合型证券投资基金三十五只证券投资基金，以及东方红 4 号积极成长集合资产管理计划、东方红 5 号灵活配置集合资产管理计划、东方红 6 号集合资产管理计划、东方红 7 号集合资产管理计划、东方红 8 号双向策略集合资产管理计划、东方红新睿 2 号集合资产管理计划、东方红新睿 3 号集合资产管理计划、东方红新睿 2 号二期集合资产管理计划、东方红领先趋势集合资产管理计划、东方红稳健成长集合资产管理计划、东方

红新睿5号集合资产管理计划、东方红9号消费精选集合资产管理计划、东方红基金宝集合资产管理计划、东方红新睿4号分级集合资产管理计划、东方红内需增长集合资产管理计划、东方红稳健增值集合资产管理计划、东方红增利2号集合资产管理计划、东方红增利3号集合资产管理计划、东方红增利6号集合资产管理计划、东方红增利7号集合资产管理计划二十只大集合计划。

#### 4.1.2 集合计划投资主办人简介

姓名	职务	任本集合计划的投资主办人期限		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兼任东方红新睿2号、东方红新睿3号、东方红新睿2号二期、东方红新睿5号、东方红基金宝集合资产管理计划投资主办人。	2014年4月8日	-	11年	博士，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，现任上海东方证券资产管理有限公司执行董事兼任东方红新睿2号、东方红新睿3号、东方红新睿2号二期、东方红新睿5号、东方红基金宝集合资产管理计划投资主办人。具有基金从业资格，中国国籍。

注：1、上述表格内集合计划首任集合计划投资主办人“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主办人，集合计划投资主办人的“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主办人的“职务”及“说明”仅包括其兼任本公司大集合产品投资主办人的情况。

## 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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规关于公平交易的规定，公司建立了与公平交易相关的控制制度、流程以及信息披露程序等，保证公司在投资管理活动中公平对待各投资组合，防范不同投资组合之间进行利益输送，并定期对同向交易、反向交易和异常交易行为进行监控和分析。交易部使用恒生交易系统中的公平交易模块进行交易执行和分配，合规与风险管理部对公司各投资组合及组合之间的交易行为进行事后分析，校验公平交易执行情况。对于同向交易，合规与风险管理部侧重于对公司管理的不同产品（包含了公募产品、私募产品）的整体收益率差异、投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内交易所竞价交易的所有交易记录，在不同时间窗下（日内、3日内、5日内）的同向交易价差按两两组合进行显著性检验，并根据显著性检验结果，对符合异常交易筛选条件并超过规定阈值的交易记录，通过逐笔检查或抽样分析的方法，分析相应交易行为的公平性。对同一投资人员管理的不同产品，则持续监控和跟踪其同向交易价差，如价差显著不为零，则在逐笔分析相关交易记录的基础上，对投资人员进行访谈，要求其进行相关的解释和说明，以更为审慎地判断其合理性。对于反向交易，除程序化交易外原则上禁止组合内部及组合之间的日内反向交易，如有投资策略或流动性等特殊需要的，需由投资经理提供投资依据，经投资决策委员会审慎审批后留档备查。本年度未发现公司管理的投资组合间存在违反公平交易原则的交易行为。

### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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 管理人对报告期内集合计划的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内集合计划投资策略和运作分析

受全球流动性收缩、贸易争端冲击以及估值回调等影响，2018年A股各行业和指数均下跌，尤其是下半年以来市场呈现出系统性风险特征，投资者情绪未完全稳定下来。全年看，跌幅较大的是电子、有色、传媒、综合、轻工、机械等行业，跌幅较少的是休闲服务、银行、食品饮料、农林牧渔、计算机等行业。

产品管理上，由于我们对“去杠杆”和“贸易战”对市场的影响估计不足，没有及时调整仓位和品种，使得本年度业绩表现差强人意。四季度以来，基于对流动性宽松的预期，我们适度增加了可转债的配置。

### 4.4.2 报告期内集合计划的业绩表现

截至2018年12月31日，本集合计划份额净值为1.8828元，份额累计净值为2.1978元；本报告期集合计划份额净值增长率为-23.02%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2019年，在基建、减税等政策对冲下，预计经济将逐步寻底；“宽货币”和“宽信用”政策推动下，流动性将较为宽松；悲观的市场预期也将随着经济和市场的稳定下来而有所改善。

因此，2019年影响市场最重要的三个因素——盈利预期、流动性和风险偏好都较正面，预计市场可能有较好表现。行业方面，我们依然看好竞争格局稳定，对宏观经济敏感度较低的家电、食品饮料等行业，同时我们也会自下而上积极寻找具备持续竞争优势的低估、优质龙头公司，继续优化持仓结构，与优秀企业一起成长，力争为投资者带来长期稳定回报。

## 4.6 管理人内部有关本集合计划的监察稽核工作情况

报告期内，集合计划管理人日常监察稽核工作主要由合规与风险管理部承担，2018年开展了如下主要工作：

公司日常监察稽核工作主要由合规与风险管理部承担，2018 年开展了如下主要工作：

（一）切实履行日常监察稽核各项职责，保障公司经营管理活动的持续合规。

1、顺利完成了公司 2018 年相关审查、检查工作。2、及时完成公司各类合规与风险管理报告工作。3、积极对监管政策提出建议及意见。4、完善员工执业行为管理工作。5、完成反洗钱各项工作。6、开展合规与风险管理培训与考试。

（二）以公司全面风险管理体系架构为基础，不断推进和完善风险管理工作。

1、系统建制方面，推进恒生交易系统风控模块的测试及衡泰风控系统的一期验收和二期立项实施，并进一步完善风险管理相关制度流程。

2、投资组合风控方面，合规与风险管理部配合公司业务进展，对交易对手方额度控制等各项功能进行测试并稳步推进上线。

（三）推动大集合转型

根据《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》，合规与风险管理部牵头相关部门逐条梳理，正式启动大集合产品公募化规范及转型工作，并形成《关于大集合产品规范方案的报告》向监管报送。

（四）进一步落实债券交易监管要求

截至 2018 年末，公司已进一步加强各类债券交易的统一管理，强化合规风控作用，规范债券交易业务管理和人员管理，并由合规与风险管理部牵头，协同相关部门开展落实监管要求情况自查，并形成自查整改报告提交监管部门。

（五）进一步加强了公司制度流程建设。

2018 年以来，公司根据业务发展需要制定或修订了 30 项制度规程。同时，对交易对手管理的准入管理方案及审批流程、额度管控方案、A 股和 H 股涉及 5%举牌与信息披露限额的控制口径、关联交易管理、即时通讯工具管控措施等进行了梳理和完善。

（六）根据母子公司内部控制自查与更新工作方案，完善内部控制建设。

2018 年以来在母公司的组织下，由合规与风险管理部牵头启动内部控制自查与更新项目，实施范围覆盖了公司治理、产品管理、投资管理、研究管理、交易业务、营销与销售、后台运营管理、合规与风险管理、财务管理、人力资源管理等业务及管理流程。

#### 4.7 管理人对报告期内集合计划估值程序等事项的说明

本报告期内，本集合计划管理人参考中国证监会发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和集合计划合同的约定，对集合计划所持有的投资品种进行估值，本集合计划托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。集合计划份额净值由集合计划管理人完成估值后，经集合计划托管人复核无误后由集合计划管理人对外公布。

本集合计划管理人对投资品种进行估值时原则上应保持估值程序和技术的一致性，对旗下管理的不同产品持有的具有相同特征的同一投资品种的估值调整原则、程序及技术应当一致（中国证监会规定的特殊品种除外）。为了保障集合计划能真实、准确地反映投资品种的公允价值，本集合计划管理人授权估值委员会负责建立健全估值决策体系，估值委员会成员由投资、研究、运营、合规、风控等相关业务分管领导组成，运营业务分管领导为估值委员会主任委员，运营部是估值委员会的日常办事机构，运营部的估值人员均具有专业会计学习经历，具有基金从业人员资格。对于集合计划特殊估值调整事项，由估值委员会下设的估值业务工作小组提出调整方案并提交估值委员会审议，保证集合计划估值的公平合理，保持估值政策和程序的一贯性。

#### 4.8 管理人对报告期内集合计划利润分配情况的说明

本集合计划收益分配应遵循下列原则：

- 1、收益采用现金分配或红利再投资方式，每位委托人获得的分红收益金额或再投资 份额保留小数点后两位，第三位四舍五入；
- 2、每一集合计划份额享有同等分配权；
- 3、计划收益分配基准日的单位净值减去每单位份额收益分配金额后不能低于初始面 值；
- 4、本集合计划的默认分红方式为现金分红，委托人可以选择现金分红或者红利再投 资分红方式。选择采取现金分配的，管理人向托管人发送划付指令，托管人根据指令将收 益分配款项划入注册登记机构，注册登记机构将收益分配款划入相应推广机构结算备付金 账户，由推广机构划入委托人的交易账户，现金红利扣除管理人应提业绩报酬后在 T+7 日内划转到委托人的交易账 户；选择采取红利再投资方式的，分红资金扣除管理人应提业 绩报酬后按 T 日的单位净值转成相应的集合计划单位；
- 5、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由委托人自行承担；
- 6、法律法规另有规定的从其规定。

本集合计划管理人于 2018 年 6 月 22 日发布《东方红-新睿 3 号集合资产管理计划第三次分红公告》，收益分配基准日为 2018 年 6 月 8 日，每 10 份集合计划份额派发红利 1.35 元；共计派发 2018 年度红利 11,848,595.03 元。

#### **4.9 报告期内管理人对本集合计划持有人数或集合计划资产净值预警情形的说明**

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 托管人报告

### 5.1 报告期内本集合计划托管人遵规守信情况声明

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”）在对东方红新睿 3 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、集合计划合同、托管协议的规定，不存在损害集合计划份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了集合计划托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本集合计划投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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、集合计划合同、托管协议的规定，对东方红新睿 3 号集合资产管理计划的投资运作进行了监督，对集合计划资产净值的计算、集合计划份额申购赎回价格的计算以及集合计划费用开支等方面进行了认真的复核，未发现集合计划管理人存在损害集合计划份额持有人利益的行为。该集合计划本报告期内进行了一次利润分配，分配金额为 11,848,595.03 元。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天特审字(2019)第 0268 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	东方红-新睿 3 号集合资产管理计划全体委托人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了上海东方证券资产管理有限公司(以下简称“集合计划管理人”)作为集合计划管理人的东方红-新睿 3 号集合资产管理计划(以下简称“东方红-新睿 3 号集合计划”)的财务报表,包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表,2018 年度的利润表和所有者权益(集合计划净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照财务报表附注 7.4.2 所述的编制基础编制。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于东方红-新睿 3 号集合计划,并履行了职业道德方面的其他责任。</p> <p>我们提醒财务报表的使用者关注财务报表附注 7.4.2 对编制基础的说明。集合计划管理人编制财务报表是为了按照中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)的要求向中国证监会及其派出机构、中国证券投资基金业协会、东方红-新睿 3 号集合计划委托人和托管人呈报之用,因此,财务报表可能不适用于其他用途。本报告仅就上述目的向东方红-新睿 3 号集合计划委托人出具,不得用作任何其他目的。本段内容不影响已发表的审计意见。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-

<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>集合计划管理人负责按照财务报表附注 7.4.2 所述的编制基础编制财务报表(包括确定财务报表附注 7.4.2 所述的编制基础对于在具体情况下编制财务报表是可接受的), 并设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时, 集合计划管理人负责评估东方红-新睿 3 号集合计划的持续经营能力, 披露与持续经营相关的事项(如适用), 并运用持续经营假设, 除非集合计划管理人计划清算东方红-新睿 3 号集合计划、终止运营或别无其他现实的选择。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证, 并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证, 但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致, 如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策, 则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中, 我们运用职业判断, 并保持职业怀疑。同时, 我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险; 设计和实施审计程序以应对这些风险, 并获取充分、适当的审计证据, 作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上, 未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制, 以设计恰当的审计程序, 但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(三) 评价集合计划管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对集合计划管理人使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时, 根据获取的审计证据, 就可能对东方红-新睿 3 号集合计划持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性, 审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露; 如果披露不充分, 我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而, 未来的事项或情况可能导致东方红-新睿 3 号集合计划不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)。</p> <p>我们与集合计划管理人就计划的审计范围、时间安排和重大审计发</p>

	现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	陈熹	叶尔甸
会计师事务所的地址	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼	
审计报告日期	2019年3月26日	

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：东方红-新睿3号集合资产管理计划

报告截止日：2018年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.6.1	12,711,677.84	19,218,004.79
结算备付金		3,562,800.07	523,205.81
存出保证金		779,110.95	284,813.46
以公允价值计量且其变动 计入当期损益的金融资产	7.4.6.2	152,760,641.59	291,413,174.94
其中：股票投资		77,948,107.52	183,554,945.77
基金投资		16,214,355.13	26,257,263.04
债券投资		58,598,178.94	81,600,966.13
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.6.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.6.4	-	-
应收证券清算款		992,797.27	866,122.57
应收利息	7.4.6.5	118,922.87	166,056.62
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.6.6	-	-
资产总计		170,925,950.59	312,471,378.19
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年12月31日</b>	<b>上年度末 2017年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.6.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,174,795.95	1,119,015.79
应付退出款		-	107,235.95
应付管理人报酬		224,076.44	398,771.28
应付托管费		37,346.06	66,179.34
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.6.7	82,895.33	134,063.81

应交税费		8,803.34	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.6.8	35,000.00	20,538.87
负债合计		1,562,917.12	1,845,805.04
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.6.9	89,951,007.17	120,127,888.51
未分配利润	7.4.6.10	79,412,026.30	190,497,684.64
所有者权益合计		169,363,033.47	310,625,573.15
负债和所有者权益总计		170,925,950.59	312,471,378.19

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，集合资产管理计划份额净值 1.8828 元，集合资产管理计划份额总额 89,951,007.17 份。

## 7.2 利润表

会计主体：东方红-新睿3号集合资产管理计划

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-46,951,563.66	60,536,699.22
1. 利息收入		657,927.32	583,230.95
其中：存款利息收入	7.4.6.11	275,941.36	245,191.18
债券利息收入		321,337.08	123,502.09
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		60,648.88	214,537.68
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		9,335,914.77	22,383,512.28
其中：股票投资收益	7.4.6.12	10,301,635.88	20,592,329.00
基金投资收益	7.4.6.13	-467,238.50	-1,805,252.41
债券投资收益	7.4.6.14	-3,273,981.28	334,867.32
资产支持证券投资收益	7.4.6.14.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.6.15	-	-
衍生工具收益	7.4.6.16	1,253.33	48,037.00
股利收益	7.4.6.17	2,774,245.34	3,213,531.37
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.6.18	-56,945,405.75	37,569,955.99
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.6.19	-	-
<b>减：二、费用</b>		8,559,321.75	7,335,144.64

1. 管理人报酬	7.4.9.2.1	6,382,607.53	5,219,994.94
2. 托管费	7.4.9.2.2	588,706.73	537,700.91
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.6.20	1,550,497.70	1,557,148.79
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		2,141.88	-
7. 其他费用	7.4.6.21	35,367.91	20,300.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-55,510,885.41	53,201,554.58
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-55,510,885.41	53,201,554.58

### 7.3 所有者权益（集合计划净值）变动表

会计主体：东方红-新睿3号集合资产管理计划

本报告期：2018年1月1日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（集合计划净值）	120,127,888.51	190,497,684.64	310,625,573.15
二、本期经营活动产生的集合计划净值变动数（本期利润）	-	-55,510,885.41	-55,510,885.41
三、本期集合计划份额交易产	-30,176,881.34	-43,726,177.90	-73,903,059.24

生的集 合计划 净值变 动数 (净值 减少以 “-”号 填列)			
其中: 1. 集合计 划参与 款	1,465,774.90	1,915,474.67	3,381,249.57
2 .集合计 划退出 款	-31,642,656.24	-45,641,652.57	-77,284,308.81
四、本期 向集合 计划委 托人分 配利润 产生的 集合计 划净值 变动(净 值减少 以“-” 号填列)	-	-11,848,595.03	-11,848,595.03
五、期末 所有者 权益(集 合计划 净值)	89,951,007.17	79,412,026.30	169,363,033.47
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初 所有者 权益(集 合计划 净值)	34,819,560.84	31,900,527.50	66,720,088.34
二、本期	-	53,201,554.58	53,201,554.58



经营活动产生的集合计划净值变动数(本期利润)			
三、本期集合计划份额交易产生的集合计划净值变动数(净值减少以“-”号填列)	85,308,327.67	105,395,602.56	190,703,930.23
其中:1.集合计划参与款	140,075,012.35	180,004,675.65	320,079,688.00
2.集合计划退出款	-54,766,684.68	-74,609,073.09	-129,375,757.77
四、本期向集合计划委托人分配利润产生的集合计划净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(集合计划净值)	120,127,888.51	190,497,684.64	310,625,573.15

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>潘鑫军</u>	<u>任莉</u>	<u>詹朋</u>
集合计划管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 集合计划基本情况

东方红-新睿 3 号集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”)由上海东方证券资产管理有限公司(以下简称“东证资管”或“本集合计划管理人”)设立,并负责推广计划、开展投资管理和后续服务活动。

本集合计划不设固定存续期限,首次设立推广不包括认购资金利息共募集人民币 348,131,348.80 元,业经立信会计师事务所有限公司信会师报字(2012)第 130321 号验资报告予以验证。经本集合计划管理人公告,本集合计划于 2012 年 8 月 8 日成立,成立日的集合计划份额总额为 348,362,345.69 份,其中有效参与资金利息折合 230,996.89 份集合计划份额。本集合计划管理人为东证资管,托管人为上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“浦发银行”)。

根据《东方红-新睿 3 号集合资产管理合同》的有关规定,本集合计划的投资范围为中国证券监督管理委员会允许集合计划投资的品种。主要包括:国内依法发行的权益类资产、固定收益类资产、现金类资产、衍生金融工具及法律法规允许集合计划投资的其他金融工具。集合计划可以参与融资融券交易,也可以将其持有的股票作为融券标的证券出借给证券金融公司。本集合计划可以参与股票质押式回购业务,集合资产管理计划为融出方的,在股票质押回购中质权人登记为管理人。

### 7.4.2 特殊目的财务报表的编制基础

本集合计划的财务报表按照《东方红-新睿 3 号集合资产管理合同》及《东方红-新睿 3 号集合资产管理计划说明书》约定的资产估值、会计核算方法及财务报表附注 7.4.3 所述的重要会计政策和会计估计编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.3.1 会计年度

本集合计划会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.3.2 记账本位币

本集合计划的记账本位币为人民币。

#### 7.4.3.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本集合计划对金融资产的持有意图和持有能力。本集合计划现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本集合计划目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。其中，衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示。

本集合计划持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本集合计划目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本集合计划持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.3.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本集合计划成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本集合计划将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本集合计划既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.3.5 金融资产和金融负债的估值原则

本集合计划持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具投资等金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，集合计划管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.3.6 金融资产和金融负债的抵销

本集合计划持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本集合计划 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.3.7 实收基金

实收基金为对外发行集合计划份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于参与和退出引起的实收基金变动分别于集合计划参与确认日及集合计划退出确认日认列。

#### 7.4.3.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在参与或退出集合计划时，参与或退出款项中包含的按累计未分配的已实现损益占集合计划净值比例计算的金额。未实现平准金指在参与或退出集合计划时，参与或退出款项中包含的按累计未实现损益占集合计划净值比例计算的金额。损益平准金于集合计划参与确认日或集合计划退出确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.3.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由本集合计划管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本

金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由本集合计划管理人缴纳的增值税后确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由本集合计划管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.3.10 费用的确认和计量**

本集合计划的管理人报酬(包括管理费和业绩报酬)和托管费在费用涵盖期间按集合计划合同约定的费率和计算方法进行确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.3.11 集合计划的收益分配政策**

每一集合计划份额享有同等分配权。本集合计划收益分配基准日的份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于初始面值。本集合计划默认分红方式为现金分红，委托人可以选择现金分红或将现金分红按分红除权日的集合计划份额净值自动转为集合计划份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括集合计划经营活动产生的未实现损益以及集合计划份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配集合计划收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.3.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.3.13 分部报告

本集合计划以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本集合计划内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本集合计划管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本集合计划能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本集合计划目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.3.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本集合计划的估值原则和中国证监会允许的行业估值实务操作，本集合计划确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本集合计划参考中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，参考中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于

发布《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,参考中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本集合计划持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本集合计划持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### **7.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **7.4.4.1 会计政策变更的说明**

本集合计划本报告期未发生会计政策变更。

##### **7.4.4.2 会计估计变更的说明**

本集合计划本报告期未发生会计估计变更。

##### **7.4.4.3 差错更正的说明**

本集合计划在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### **7.4.5 税项**

集合计划目前比照证券投资基金所依据的相关财税法规和实务操作及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款,主要税项列示如下:

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产



品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2)对集合计划从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，从基金分配中取得的收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税。

(3)集合计划卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。集合计划通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(4)本集合计划的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 7.4.6 重要财务报表项目的说明

### 7.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	12,711,677.84	19,218,004.79
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	12,711,677.84	19,218,004.79

7.4.6.2 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	88,113,612.75	77,948,107.52	-10,165,505.23	
贵金属 投资 - 金交所 黄金合 约	-	-	-	
债券	交易所 市场	65,342,505.70	58,598,178.94	-6,744,326.76
	银行 间市 场	-	-	-
	合计	65,342,505.70	58,598,178.94	-6,744,326.76
资产支 持证 券	-	-	-	
基金	20,046,193.74	16,214,355.13	-3,831,838.61	
其他	-	-	-	
合计	173,502,312.19	152,760,641.59	-20,741,670.60	
项目	上年度末 2017年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	143,604,199.94	183,554,945.77	39,950,745.83	
贵金属 投资 - 金交所 黄金合 约	-	-	-	
债券	交易所 市场	85,546,724.16	81,600,966.13	-3,945,758.03

银行间市场	-	-	-
合计	85,546,724.16	81,600,966.13	-3,945,758.03
资产支持证券	-	-	-
基金	26,280,849.02	26,257,263.04	-23,585.98
其他	-	-	-
合计	255,431,773.12	291,413,174.94	35,981,401.82

### 7.4.6.3 衍生金融资产/负债

本集合计划本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.6.4 买入返售金融资产

#### 7.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本集合计划本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本集合计划本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应收活期存款利息	5,659.20	8,465.87
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	919.16	235.40
应收债券利息	112,291.41	157,227.15
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-

应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	53.10	128.20
合计	118,922.87	166,056.62

#### 7.4.6.6 其他资产

本集合计划本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2018年12月31日	2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	82,895.33	134,063.81
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	82,895.33	134,063.81

#### 7.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2018年12月31日	2017年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	538.87
预提费用	35,000.00	20,000.00
合计	35,000.00	20,538.87

#### 7.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2018年1月1日至2018年12月31日	
	集合计划份额（份）	账面金额
上年度末	120,127,888.51	120,127,888.51
本期参与	1,465,774.90	1,465,774.90
本期退出（以“-”号填列）	-31,642,656.24	-31,642,656.24
本期末	89,951,007.17	89,951,007.17

### 7.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	161,699,965.16	28,797,719.48	190,497,684.64
本期利润	1,434,520.34	-56,945,405.75	-55,510,885.41
本期集合计划份额交易产生的变动数	-39,941,158.50	-3,785,019.40	-43,726,177.90
其中：集合计划参与款	1,939,073.79	-23,599.12	1,915,474.67
合计计划退出款	-41,880,232.29	-3,761,420.28	-45,641,652.57
本期已分配利润	-11,848,595.03	-	-11,848,595.03
本期末	111,344,731.97	-31,932,705.67	79,412,026.30

### 7.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
活期存款利息收入	264,077.85	218,190.72
定期存款利息收入	-	-

其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	9,543.78	25,033.69
其他	2,319.73	1,966.77
合计	275,941.36	245,191.18

#### 7.4.6.12 股票投资收益

##### 7.4.6.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至 2018年12月31日	2017年1月1日至 2017年12月31日
卖出股票成交总额	329,791,274.86	247,394,664.59
减：卖出股票成本总额	319,489,638.98	226,802,335.59
买卖股票差价收入	10,301,635.88	20,592,329.00

#### 7.4.6.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至 2018年12月31日	2017年1月1日至 2017年12月31日
卖出/赎回基金成交金额	5,768,016.78	226,679,863.86
减：卖出/赎回基金成本总额	6,235,255.28	228,485,116.27
基金差价收入	-467,238.50	-1,805,252.41

#### 7.4.6.14 债券投资收益

##### 7.4.6.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-3,273,981.28	334,867.32
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-3,273,981.28	334,867.32

#### 7.4.6.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至 2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	112,231,877.32	32,218,106.96
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	115,222,442.44	31,756,511.51
减：应收利息总额	283,416.16	126,728.13
买卖债券差价收入	-3,273,981.28	334,867.32

#### 7.4.6.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益-赎回差价收入。

#### 7.4.6.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益-申购差价收入。

#### 7.4.6.14.5 资产支持证券投资收益

本集合计划本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.6.15 贵金属投资收益

##### 7.4.6.15.1 贵金属投资收益项目构成

本集合计划本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.6.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本集合计划本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

#### 7.4.6.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益-赎回差价收入。

#### 7.4.6.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益-申购差价收入。

#### 7.4.6.16 衍生工具收益

##### 7.4.6.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本集合计划本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 7.4.6.16.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月 31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
国债期货-投资收益	-	-
股指期货-投资收益	1,253.33	48,037.00
合计	1,253.33	48,037.00

##### 7.4.6.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12 月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
股票投资产生的股利收益	2,201,673.35	1,801,494.14
基金投资产生的股利收益	572,571.99	1,412,037.23
合计	2,774,245.34	3,213,531.37



### 7.4.6.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
1. 交易性金融资产	-56,723,072.42	37,569,955.99
——股票投资	-50,116,251.06	38,803,178.78
——债券投资	-2,798,568.73	-3,852,265.56
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-3,808,252.63	2,619,042.77
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-222,333.33	-
——权证投资	-222,333.33	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	-56,945,405.75	37,569,955.99

### 7.4.6.19 其他收入

本集合计划本报告期内及上年度可比期间无其他收入。

### 7.4.6.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至 2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年12月31日
交易所市场交易费用	1,549,966.56	1,555,817.43
银行间市场交易费用	-	-
期货交易费用	531.14	1,331.36
合计	1,550,497.70	1,557,148.79

### 7.4.6.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12 月31日

审计费用	35,000.00	20,000.00
信息披露费	-	-
银行费用	367.91	300.00
合计	35,367.91	20,300.00

## 7.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本集合计划并无须作披露的或有事项。

### 7.4.7.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本集合计划并无须作披露的资产负债表日后事项。

## 7.4.8 关联方关系

关联方名称	与本集合计划的关系
上海东方证券资产管理有限公司（“东证资管”）	集合计划管理人、集合计划销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	集合计划托管人、集合计划销售机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	集合计划管理人的股东、集合计划销售机构
上海东证期货有限公司（“东证期货”）	受东方证券控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
东方证券	591,550,635.20	100.00%	575,560,190.75	100.00%

### 7.4.9.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例
东方证券	204,445,450.43	100.00%	135,021,371.17	100.00%

### 7.4.9.1.3 回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
东方证券	482,300,000.00	100.00%	1,285,400,000.00	100.00%

### 7.4.9.1.4 基金交易

本集合计划本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的基金交易。

### 7.4.9.1.5 权证交易

本集合计划本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

## 7.4.9.2 关联方报酬

### 7.4.9.2.1 集合计划管理人报酬

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12 月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31 日
当期发生的集合计划应 支付的管理人报酬	6,382,607.53	5,219,994.94

注：

1. 本集合计划本期共发生应支付的管理费 3,532,240.11 元(2017 年度：3,226,205.96 元)。本集合计划管理费按前一日集合计划累计单位净值(X)分档收取。当 X 大于或等于 0.95 且小于或等于 1.20 时，当日管理费按前一日集合计划资产净值的 1.00%的年费率计提；当 X 大于 1.20 时，当日管理费按前一日集合计划资产净值的 1.50%的年费率计提；当 X 小于 0.95 时，当日不收取管理费。逐日累计至每月末，按月支付。

2. 本集合计划本期共发生应支付的业绩报酬 2,850,367.42 元(2017 年度：1,993,788.98 元)。在本集合计划分红日、委托人退出日或本集合计划终止日，本集合计划对每份集合计划份额 X 日至本次业绩报酬计提日期间的年化收益率超过 5.0%的部分计提 20%的集合计划管理人业绩报酬。其计算公式为：

当年化收益率>5.0%时，业绩报酬 = MAX [ 0 , (年化收益率 - 5.0%) × 20% × X 日计划单位净值 × 提取业绩报酬的份额 × X 日与本次业绩报酬计提日间隔天数 / 360 - 该笔份额 X 日后已计提的业绩报酬总额 ]

对于 2014 年 5 月 4 日之前(含 2014 年 5 月 4 日)参与的份额，X 日为 2014 年 5 月 4 日前该份额最近一个发生业绩报酬计提的业绩报酬提取日，如该日不存在，则推广日参与的为本集合计划成立日，存续期参与的为参与当日。

对于 2014 年 5 月 4 日之后(不含 2014 年 5 月 4 日)参与的份额，X 日为份额参与日。

若管理人在分红日提取业绩报酬，不应超过该笔份额本次分红金额的 20%。

#### 7.4.9.2.2 集合计划托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的集合计划应支付的托管费	588,706.73	537,700.91

注：本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

### 7.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本集合计划本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 7.4.9.4 各关联方投资本集合计划的情况

#### 7.4.9.4.1 报告期内集合计划管理人运用固有资金投资本集合计划的情况

本集合计划本报告期内及上年度可比期间集合计划管理人未运用固有资金投资本集合计划。

#### 7.4.9.4.2 报告期末除集合计划管理人之外的其他关联方投资本集合计划的情况

本集合计划本报告期末及上年度末除集合计划管理人以外的其他关联方未投资本集合计划。

### 7.4.9.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至 2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浦东发展银行	12,711,677.84	264,077.85	19,218,004.79	218,190.72

注：本集合计划的银行存款由本集合计划托管人浦发银行保管，按银行同业利率计息。

### 7.4.9.6 本集合计划在承销期内参与关联方承销证券的情况

本集合计划本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

### 7.4.9.7 其他关联交易事项的说明

本集合计划支付给东证期货的股指期货交易手续费参考市场价格经本集合计划的管理人与对

方协商确定，以包括中国金融期货交易所收取的上交手续费的全额列示。于 2018 年 12 月 31 日，本集合计划无应付交易手续费余额(2017 年 12 月 31 日：同)。于 2018 年度，本集合计划当期交易手续费支出 531.14 元(2017 年度：1331.36 元)。

本集合计划用于期货交易结算的资金分别存放于东证期货的结算账户和保证金账户中，结算备付金按银行同业利率计息，存出保证金不计息。于 2018 年 12 月 31 日，本集合计划的结算备付金余额为 2,719,082.61 元，存出保证金余额为 660,960.00 元(2017 年 12 月 31 日：结算备付金 0.52 元，无存出保证金余额)。于 2018 年度，本集合计划当期结算备付金利息收入 2,192.79 元(2017 年度：8,233.02 元)。

#### 7.4.10 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份集合计划份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润发放合计	备注
1	2018-06-27	2018-06-27	1.35	8,467,345.46	3,381,249.57	-11,848,595.03	-
合计			1.35	8,467,345.46	3,381,249.57	-11,848,595.03	-

#### 7.4.11 期末（2018 年 12 月 31 日）本集合计划持有的流通受限证券

##### 7.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本集合计划本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本集合计划本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 7.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

本集合计划本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

本集合计划本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 7.4.12 金融工具风险及管理

#### 7.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在经营层面设立风险控制委员会，负责在董事会授权范围内的重大经营项目和创新业务的风险评估；在业务操作层面风险管理职责主要由合规与风险管理部和风险管理人員负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

#### 7.4.12.2 信用风险

信用风险是指集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者集合计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。

本集合计划管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本集合计划的银行存款存放在本集合计划托管人浦发银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本集合计划在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本集合计划管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

#### 7.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本集合计划本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

#### 7.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.12.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

#### 7.4.12.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
AAA	23,789,629.00	49,623,381.70
AAA以下	34,808,549.94	31,977,584.43
未评级	-	-
合计	58,598,178.94	81,600,966.13

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 7.4.12.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.12.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指集合计划资产不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于集合计划委托人参与或退出集合计划，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出



现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对由于参与资金建仓而可能产生的流动性风险，本集合计划的管理人通过灵活的交易模型，使集合计划的建仓对市场的人为影响减少到最小；针对由于集合计划委托人退出造成的流动性风险，本集合计划的管理人采取了一系列管理措施，如规定在开放期内方可办理退出、保持一定比例的现金、在极端情况下启用暂停退出的机制等。本集合计划的管理人在集合计划合同中设计了巨额退出条款，约定在非常情况下退出申请的处理方式，控制因开放参与退出模式带来的流动性风险，有效保障集合计划委托人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本集合计划的管理人通过独立的合规与风险管理部对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本集合计划投资于一家公司发行的证券不得超过资产净值的 10%；本集合计划与本集合计划的管理人管理的其他集合计划资产投资于一家公司发行的证券不超过该证券发行总量的 10%。且本集合计划所持证券均在证券交易所上市，因此除附注八中列示的部分集合计划资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。

于 2018 年 12 月 31 日，本集合计划所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可退出集合计划份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### **7.4.12.4 市场风险**

市场风险是指集合计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **7.4.12.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本集合计划持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资等，其余金融资产及金融负债不计息。本集合计划的管理人定期对本集合计划面临的利率敏感性缺口进行监控，以对该风险进行管理。

#### 7.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年12月 31日	1个月以 内	1-3 个月	3个月-1 年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	12,711,677.84	-	-	-	-	-	12,711,677.84
结算备付金	3,562,800.07	-	-	-	-	-	3,562,800.07
存出保证金	118,150.95	-	-	-	-	660,960.00	779,110.95
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	-	-	-	45,095,535.24	13,502,643.70	94,162,462.65	152,760,641.59
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	992,797.27	992,797.27
应收利息	-	-	-	-	-	118,922.87	118,922.87
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	16,392,628.86	-	-	45,095,535.24	13,502,643.70	95,935,142.79	170,925,950.59
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,174,795.95	1,174,795.95
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	224,076.44	224,076.44
应付托管费	-	-	-	-	-	37,346.06	37,346.06
应付交易费用	-	-	-	-	-	82,895.33	82,895.33
应交税费	-	-	-	-	-	8,803.34	8,803.34
其他负债	-	-	-	-	-	35,000	35,000
负债总计	-	-	-	-	-	1,562,917.77	1,562,917.77

						12	.12
利率敏感度缺口	16,392,628.86	-	-	45,095,535.24	13,502,643.70	94,372,225.67	169,363,033.47
上年度末 2017年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	19,218,004.79	-	-	-	-	-	19,218,004.79
结算备付金	523,205.81	-	-	-	-	-	523,205.81
存出保证金	284,813.46	-	-	-	-	-	284,813.46
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	-	-	4,464,094.20	30,997,435.78	46,139,436.15	209,812,208.81	291,413,174.94
应收证券清算款	-	-	-	-	-	866,122.57	866,122.57
应收利息	-	-	-	-	-	166,056.62	166,056.62
资产总计	20,026,024.06	-	4,464,094.20	30,997,435.78	46,139,436.15	210,844,388.00	312,471,378.19
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,119,015.79	1,119,015.79
应付赎回款	-	-	-	-	-	107,235.95	107,235.95
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	398,771.28	398,771.28
应付托管费	-	-	-	-	-	66,179.34	66,179.34
应付交易费用	-	-	-	-	-	134,063.81	134,063.81
其他负债	-	-	-	-	-	20,538.87	20,538.87
负债总计	-	-	-	-	-	1,845,805.04	1,845,805.04
利率敏感度缺口	20,026,024.06	-	4,464,094.20	30,997,435.78	46,139,436.15	208,998,582.96	310,625,573.15

注：表中所示为本集合计划资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日集合计划资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
	1. 市场利率下降25个基点	564,914.02	919,048.50
2. 市场利率上升25个基点	-557,548.50	-905,541.91	

#### 7.4.12.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本集合计划的所有资产及负债以人民币计价,因此无重大外汇风险。

#### 7.4.12.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指集合计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的其他价格因素变动而发生波动的风险。本集合计划主要投资于证券交易所上市的股票、基金和债券,所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响,也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本集合计划管理人在构建和管理投资组合的过程中,通过对宏观经济情况及政策的分析,结合证券市场运行情况,做出资产配置及组合构建的决定;通过对单个证券的定性分析及定量分析,选择符合集合计划合同约定范围的投资品种进行投资。本集合计划管理人定期结合宏观及微观环境的变化,对投资策略、资产配置、投资组合进行修正,来主动应对可能发生的其他价格风险。

本集合计划通过投资组合的分散化降低其他价格风险,并且本集合计划管理人每日对本集合计划所持有的证券价格实施监控,通过组合估值、行业配置分析等进行其他价格风险管理。

##### 7.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日

	公允价值	占集合计划资产净值比例 (%)	公允价值	占集合计划资产净值比例 (%)
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产—股票投资	77,948,107.52	46.02	183,554,945.77	59.09
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产—基金投资	16,214,355.13	9.57	26,257,263.04	8.45
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产—债券投资	-	-	-	-
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	94,162,462.65	55.59	209,812,208.81	67.54

#### 7.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深300指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日集合计划资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
	1. 沪深300指数上升5%	6,238,715.71	9,990,867.10
2. 沪深300指数下降5%	-6,238,715.71	-9,990,867.10	

注：本集合计划管理人运用资产-资本定价模型(CAPM)对本集合计划的其他价格风险进行分析。上表为其 他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，股票市场指数（沪深300）价格发生合理、可能的变动时，将对集合计划净值产生的影响。

#### 7.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2018年12月31日，本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币140,554,380.49元，属于第二层次的余额为人民币12,206,261.10元，无属于第三层次的余额(2017年12月31日：第一层次人民币233,424,516.54元，第二层次人民币57,988,658.40元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本集合计划不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年12月31日，本集合计划未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本集合计划无需要说明的其他重要事项。



## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末集合计划资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占集合计划总资产的比例 (%)
1	权益投资	77,948,107.52	45.60
	其中：股票	77,948,107.52	45.60
2	基金投资	16,214,355.13	9.49
3	固定收益投资	58,598,178.94	34.28
	其中：债券	58,598,178.94	34.28
	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	16,274,477.91	9.52
8	其他各项资产	1,890,831.09	1.11
9	合计	170,925,950.59	100.00

注：本集合计划本报告期末未持有通过沪港通交易机制投资的港股。

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	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	47,814,671.98	28.23
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	6,298,361.56	3.72



K	房地产业	10,389,324.78	6.13
L	租赁和商务服务业	13,069,989.20	7.72
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	375,760.00	0.22
S	综合	-	-
	合计	77,948,107.52	46.02

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有通过沪港通交易机制投资的港股。

### 8.3 期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占集合计划资产净值比例（%）
1	600887	伊利股份	686,122	15,698,471.36	9.27
2	002027	分众传媒	1,834,830	9,614,509.20	5.68
3	000651	格力电器	191,662	6,840,416.78	4.04
4	000002	万科A	223,029	5,312,550.78	3.14
5	002415	海康威视	198,439	5,111,788.64	3.02
6	600048	保利地产	430,600	5,076,774.00	3.00
7	601318	中国平安	87,700	4,919,970.00	2.90
8	300124	汇川技术	242,000	4,873,880.00	2.88
9	601888	中国国旅	57,400	3,455,480.00	2.04
10	600745	闻泰科技	130,000	2,746,900.00	1.62
11	000333	美的集团	69,723	2,569,989.78	1.52
12	603288	海天味业	34,800	2,394,240.00	1.41
13	600066	宇通客车	151,000	1,789,350.00	1.06
14	600176	中国巨石	151,100	1,461,137.00	0.86
15	601939	建设银行	216,388	1,378,391.56	0.81
16	002311	海大集团	52,586	1,218,417.62	0.72
17	600519	贵州茅台	1,490	879,114.90	0.52
18	600276	恒瑞医药	16,200	854,550.00	0.50
19	002475	立讯精密	38,800	545,528.00	0.32

20	002292	奥飞娱乐	86,015	486,844.90	0.29
21	300144	宋城演艺	17,600	375,760.00	0.22
22	600104	上汽集团	12,900	344,043.00	0.20

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初集合计划资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初集合计划资产净值比例 (%)
1	002027	分众传媒	15,555,934.60	5.01
2	000002	万科A	13,401,404.61	4.31
3	601939	建设银行	13,361,213.00	4.30
4	600887	伊利股份	12,305,584.00	3.96
5	601318	中国平安	8,611,660.10	2.77
6	600519	贵州茅台	8,138,984.00	2.62
7	600048	保利地产	7,908,295.00	2.55
8	002415	海康威视	7,763,460.90	2.50
9	000651	格力电器	7,685,305.45	2.47
10	600585	海螺水泥	7,550,497.96	2.43
11	600115	东方航空	7,408,119.00	2.38
12	601888	中国国旅	7,302,913.18	2.35
13	000418	小天鹅A	6,785,278.00	2.18
14	300017	网宿科技	6,319,222.91	2.03
15	603288	海天味业	6,288,906.00	2.02
16	300747	锐科激光	6,104,890.00	1.97
17	300144	宋城演艺	5,849,140.34	1.88
18	601088	中国神华	5,681,458.97	1.83
19	000063	中兴通讯	5,631,862.00	1.81
20	000333	美的集团	5,300,105.73	1.71

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.2 累计卖出金额超期初集合计划资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初集合计划资产净值比例 (%)
1	002027	分众传媒	25,510,273.29	8.21
2	601939	建设银行	21,156,160.56	6.81
3	601318	中国平安	17,570,144.59	5.66
4	000333	美的集团	16,731,101.77	5.39
5	002008	大族激光	16,193,548.65	5.21
6	600519	贵州茅台	11,383,291.65	3.66
7	000418	小天鹅A	11,112,091.99	3.58
8	002415	海康威视	9,934,934.22	3.20
9	300124	汇川技术	9,523,038.79	3.07
10	002078	太阳纸业	8,050,341.70	2.59
11	000002	万科A	7,696,250.38	2.48
12	600585	海螺水泥	7,676,091.44	2.47
13	600887	伊利股份	7,600,602.36	2.45
14	600115	东方航空	7,134,770.00	2.30
15	002311	海大集团	6,661,876.22	2.14
16	300017	网宿科技	6,560,649.66	2.11
17	300747	锐科激光	5,714,787.08	1.84
18	601888	中国国旅	5,493,563.05	1.77
19	000063	中兴通讯	5,449,426.00	1.75
20	300144	宋城演艺	5,351,618.48	1.72

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	263,989,668.93
卖出股票收入（成交）总额	329,791,274.86

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占集合计划资产净值比例 (%)
----	------	------	-----------------

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	58,598,178.94	34.60
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	58,598,178.94	34.60

### 8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占集合计划资产净值比例（%）
1	132013	17 宝武 EB	115,530	11,474,439.60	6.78
2	128035	大族转债	110,055	10,743,569.10	6.34
3	128016	两虹转债	92,854	9,189,760.38	5.43
4	128029	太阳转债	87,114	8,536,300.86	5.04
5	113011	光大转债	56,680	5,953,667.20	3.52

### 8.7 期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 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五名贵金属投资明细

本集合计划本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 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

本集合计划本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本集合计划投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本集合计划投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC1901	IC1901	5	4,131,000.00	-222,333.33	-

公允价值变动总额合计（元）	-222,333.33
股指期货投资本期收益（元）	1,253.33
股指期货投资本期公允价值变动（元）	-222,333.33

### 8.10.2 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以套期保值为目的，以回避市场风险。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。

### 8.11 报告期末本集合计划投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 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。

#### 8.11.2 报告期末本集合计划投资的国债期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末未进行国债期货投资。

#### 8.11.3 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。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1

本集合计划持有的前十名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。

#### 8.12.2

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。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	779,110.95
2	应收证券清算款	992,797.27
3	应收股利	-
4	应收利息	118,922.87
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,890,831.09

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占集合计划资产净值比例（%）
1	132013	17 宝武 EB	11,474,439.60	6.78
2	128035	大族转债	10,743,569.10	6.34
3	128016	雨虹转债	9,189,760.38	5.43
4	128029	太阳转债	8,536,300.86	5.04
5	113011	光大转债	5,953,667.20	3.52
6	110031	航信转债	4,840,202.40	2.86
7	123006	东财转债	4,369,343.30	2.58
8	127005	长证转债	1,521,319.80	0.90
9	132012	17 巨化 EB	731,821.50	0.43

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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。

### 8.12.6 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。

## § 9 集合计划份额持有人信息

### 9.1 期末集合计划份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 集合计划份 额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
741	121, 391. 37	0.00	0.00%	89, 951, 007. 17	100.00%

### 9.2 期末集合计划管理人的从业人员持有本集合计划的情况

项目	持有份额总数（份）	占集合计划总份额比例
集合计划管理人所有从业 人员持有本集合计划	219, 312. 47	0. 2438%

### 9.3 期末集合计划管理人的从业人员持有本开放式集合计划份额总量区间的情况

项目	持有集合计划份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、集合计划投资和研 究部门负责人持有本集合计划	10~50
本集合计划投资主办人持有本集合计划	0

**§ 10 开放式集合计划份额变动**

单位：份

集合计划合同生效日（2012年8月8日）集合计划份额总额	348,362,345.69
本报告期期初集合计划份额总额	120,127,888.51
本报告期集合计划总申购份额	1,465,774.90
减:本报告期集合计划总赎回份额	31,642,656.24
本报告期集合计划拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末集合计划份额总额	89,951,007.17



## § 11 重大事件揭示

### 11.1 集合计划管理人、集合计划托管人的专门集合计划托管部门的重大人事变动

本集合计划管理人于 2018 年 3 月 8 日发布公告，陈光明同志辞去公司董事长职务，由潘鑫军同志担任公司董事长；于 2018 年 5 月 11 日发布公告，同意林鹏同志担任公司副总经理；于 2018 年 11 月 14 日发布公告，同意汤琳同志担任公司副总经理。

本集合计划管理人于 2018 年 7 月 21 日发布公告，唐涵颖同志离任公司督察长职务，由任莉同志代为履行公司督察长职务，于 2018 年 12 月 12 日发布公告，同意李云亮同志担任公司督察长，公司总经理任莉不再代行督察长职务。

本报告期，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“公司”）根据工作需要，任命孔建先生担任公司资产托管部总经理，主持资产托管部相关工作。孔建先生的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。

### 11.2 涉及集合计划管理人、集合计划财产、集合计划托管业务的诉讼

报告期内未发生集合计划管理人、集合计划财产、集合计划托管业务的诉讼。

### 11.3 集合计划投资策略的改变

本集合计划本报告期内投资策略无改变。

### 11.4 为集合计划进行审计的会计师事务所情况

为本集合计划进行审计的会计师事务所是普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。该会计师事务所自 2017 年度起为本集合计划提供审计服务至今。本集合计划本报告期应支付给该事务所审计报酬为 3.5 万元人民币。

### 11.5 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内集合计划管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.6 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	上海东方证券资产管理有限公司旗下集合计划2017年12月31日集合计划资产净值和集合计划份额净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站	2018年1月2日
2	东方红-新睿3号集合资产管理计划2017年第4季度资产管理报告	公司网站	2018年1月22日
3	东方红-新睿3号集合资产管理计划2017年第4季度托管报告	公司网站	2018年1月22日
4	上海东方证券资产管理有限公司关于董事长变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站	2018年3月8日
5	东方红-新睿3号集合资产管理计划2017年年度资产管理报告	公司网站	2018年3月30日
6	东方红-新睿3号集合资产管理计划2017年年度托管报告	公司网站	2018年3月30日
7	东方红-新睿3号集合资产管理计划2017年年度审计报告	公司网站	2018年3月30日
8	东方红-新睿3号集合资产管理计划2018年第1季度资产管理报告	公司网站	2018年4月23日
9	东方红-新睿3号集合资产管理计划2018年第1季度托管报告	公司网站	2018年4月23日
10	上海东方证券资产管理有限公司关于新增集合计划高级管理人员的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站	2018年5月11日
11	上海东方证券资产管理有限公司	中国证券报、上海证	2018年6月20日

	关于旗下部分集合计划调整停牌股票估值方法的公告	券报、证券时报、证券日报和公司网站	
12	东方红-新睿3号集合资产管理计划第三次分红公告	公司网站	2018年6月22日
13	上海东方证券资产管理有限公司旗下集合计划2018年6月30日集合计划资产净值和集合计划份额净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站	2018年7月2日
14	东方红-新睿3号集合资产管理计划2018年第2季度托管报告	公司网站	2018年7月20日
15	东方红-新睿3号集合资产管理计划2018年第2季度资产管理报告	公司网站	2018年7月20日
16	上海东方证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站	2018年7月21日
17	上海东方证券资产管理有限公司关于在网上直销开通汇款交易业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站	2018年8月16日
18	上海东方证券资产管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站	2018年8月29日
19	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分集合计划调整停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站 (日报仅见于电子版)	2018年9月25日
20	上海东方证券资产管理有限公司关于调整旗下全部证券投资集合	中国证券报、上海证券报、证券时报、证	2018年10月18日

	计划在直销柜台首次认/申购、追加认/申购最低金额的公告	券日报和公司网站	
21	东方红-新睿3号集合资产管理计划2018年第3季度托管报告	公司网站	2018年10月26日
22	东方红-新睿3号集合资产管理计划2018年第3季度资产管理报告	公司网站	2018年10月26日
23	上海东方证券资产管理有限公司关于新增集合计划高级管理人员的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站	2018年11月14日
24	上海东方证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站	2018年12月12日
25	关于提请非自然人客户及时登记受益所有人信息的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站	2018年12月21日

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《东方红-新睿3号集合资产管理计划说明书》
- 2、《东方红-新睿3号集合资产管理计划合同》
- 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3号集合资产管理计划的批复》
- 4、《东方红-新睿3号集合资产管理计划托管协议》
- 5、《东方红-新睿3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3号集合资产管理计划年度审计报告【正本】》

### 12.2 存放地点

备查文件存放于集合计划管理人办公场所：上海市中山南路318号2号楼31层。

### 12.3 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

2019年3月29日