

东方财富证券优选 1 号 FOF 集合资产管理计划

2021 年度管理报告

管理人：东方财富证券股份有限公司

托管人：海通证券股份有限公司

2022 年 2 月



一、重要提示

集合计划管理人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

集合计划托管人于 2022 年 2 月 8 日复核了本报告中的财务指标和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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本集合计划的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

二、集合计划产品概况

| | |
|----------|--|
| 集合计划名称： | 东方财富证券优选 1 号 FOF 集合资产管理计划（以下简称“本计划”或“本集合计划”） |
| 集合计划类型： | 混合类 FOF |
| 最近一次开放日： | 2021 年 12 月 22 日 |
| 成立规模： | 77,909,463.39 份 |
| 存续期： | 5 年（可展期） |
| 投资目标： | 在控制风险的前提下稳健投资，力争获取相对基准的超额收益，实现集合计划资产的长期稳定增值。 |
| 集合计划管理人： | 东方财富证券股份有限公司 |
| 集合计划托管人： | 海通证券股份有限公司 |

三、管理人履职报告

（一）投资经理简介

翟效华，男，中国人民银行金融研究所（研究生部）硕士研究生。曾任平安资产管理有限责任公司投资经理，华林证券股份有限公司投资经理、资产管理部负责人、副总裁、执行委员会委员。现任本公司副总经理、资产管理总部总监。

已取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

（二）投资经理工作报告

本集合计划成立于 2020 年 4 月 21 日，主要投资于：

（1）权益类资产：包括在国务院同意设立的交易场所交易的上市公司股票；权益类资产管理计划，包括权益类券商集合资产管理计划、基金公司及基金子公司发行的资产管理计划、期货公司发行的资产管理计划、保险资产管理计划等金融机构发行的资产管理计划；权益类证券投资私募基金、权益类公募基金（含封闭式及开放式证券投资基金、ETF、LOF 基金）；

（2）固定收益类资产：包括在国务院同意设立的交易场所交易的可以划分为均等份额、具有合理公允价值和完善流动机制的债券、债券正回购、债券逆回购、中央银行票据、短期融资券、中期票据、非金融企业债务融资工具，以及货币市场基金、同业存单、银行存款；固定收益类资产管理计划，包括固定收益类券商集合资产管理计划、基金公司及基金子公司发行的资产管理计划、期货公司发行的资产管理计划、保险资产管理计划等金融机构发行的资产管理计划；还可以投资于固定收益类证券投资私募基金、固定收益类公募基金（含封闭式及开放式证券投资基金、ETF、LOF 基金）；

（3）商品及金融衍生品类资产：包括国债期货、股指期货、商品期货、商品期权、上海证券交易所股票期权合约；商品及金融衍生品类资产管理计划，包括商品及金融衍生品类券商集合资产管理计划、基金公司及基金子公司发行的资产管理计划、期货公司发行的资产管理计划、保险资产管理计划等金融机构发行的资产管理计划；还可以投资于商品及金融衍生品类证券投资私募基金、商品及金融衍生品类公募基金（含封闭式及开放式证券投资基金、ETF、LOF 基金）；

（4）混合类资产管理产品，包括混合类券商集合资产管理计划、基金公司及基金子公司发行的资产管理计划、期货公司发行的资产管理计划、保险资产管理计划等金融机构发行的资产管理计划；还可以投资于混合类证券投资私募基金、混合类公募基金（含封闭式及开放式证券投资基金、ETF、LOF 基金）。

（三）管理人对报告期内本计划运作合规守信情况的说明

本报告期内，本计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等

有关法律法规、中国证监会和《东方财富证券优选 1 号 FOF 集合资产管理计划管理合同》的规定，本着诚实守信、审慎尽责、谨慎勤勉的原则管理和运用本计划资产，在严格控制风险的基础上，为本计划份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本计划运作整体合法合规，没有损害份额持有人利益。本计划的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及资产管理合同的规定。

（四）管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

1、公平交易制度和控制方法

本计划管理人根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》以及有关法律法规的规定，建立了公平交易制度及异常交易监控机制，公平对待所管理的不同资产，对投资交易行为进行监控、分析、评估、核查，监督投资交易的过程和结果。

2、公平交易制度的执行情况

本报告期内，本计划管理人严格执行《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》以及有关法律法规的规定，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待所管理的所有资管计划。

3、异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本计划存在异常交易行为。

四、托管人履职报告

本报告期内（2021 年度），本托管人在东方财富证券优选 1 号 FOF 集合资产管理计划的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《东方财富证券优选 1 号 FOF 集合资产管理计划管理合同》、《东方财富证券优选 1 号 FOF 集合资产管理计划托管协议》和其他有关规定，不存在损害委托人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

本报告期内（2021 年度），本托管人按照国家有关规定、《东方财富证券

优选 1 号 FOF 集合资产管理计划管理合同》、《东方财富证券优选 1 号 FOF 集合资产管理计划托管协议》和其他有关规定，对委托资产的投资运作方面进行了监督，未发现管理人有损害委托人利益的行为。

本报告期内（2021 年度），本集合计划未实施利润分配。

本托管人复核审查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。

五、主要财务指标和集合计划投资表现情况

下述集合计划业绩指标不包括持有人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。

主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 本期间 |
|----------------------|---------------|
| 本期利润扣除本期公允价值变动损益后的净额 | 444,561.02 |
| 本期利润 | 3,505,678.53 |
| 其中：本期公允价值变动损益 | 3,061,117.51 |
| 加权平均份额本期利润 | 0.0483 |
| 加权平均净值利润率 | 4.4588% |
| 本期单位净值增长率 | 5.0670% |
| 期末可分配利润 | 1,210,185.26 |
| 期末可供分配份额利润 | 0.0161 |
| 期末资产净值 | 82,409,586.23 |
| 期末单位资产净值 | 1.0969 |
| 单位累计净值增长率 | 9.6900% |

截止 2021 年 12 月 31 日，本集合计划单位净值为 1.0969 元。

六、集合计划投资组合报告

（一）报告期末集合计划资产组合情况

单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------|--------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 4,753,583.77 | 5.74 |
| | 其中：股票 | | |

| | | | |
|---|-------------------|---------------|--------|
| | 基金 | 4,753,583.77 | 5.74 |
| 2 | 固定收益投资 | 2,745,208.81 | 3.31 |
| | 其中：债券 | | |
| | 资产支持证券 | | |
| | 货币基金 | 2,745,208.81 | 3.31 |
| 3 | 金融衍生品投资 | | |
| 4 | 买入返售金融资产 | | |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | | |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 909,934.69 | 1.10 |
| 6 | 其他资产 | 74,448,376.86 | 89.85 |
| 7 | 合计 | 82,857,104.13 | 100.00 |

注：因四舍五入，期末市值占期末总资产比例的分项之和与合计可能有尾差。

（二）投资组合报告附注

1、报告期内集合计划投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

2、集合计划投资的前十名证券中，没有投资于超出集合计划合同规定可投资证券库之外的。

七、财务会计报告

（一）集合计划资产负债表

单位：人民币元

| 资产 | 期末余额 | 年初余额 |
|-------------|--------------|--------------|
| 资 产： | | |
| 银行存款 | 909,934.69 | 9,624,353.37 |
| 结算备付金 | 0.00 | 0.00 |
| 存出保证金 | 0.00 | 0.00 |
| 交易性金融资产 | 7,498,792.58 | 0.00 |
| 其中：股票投资 | 0.00 | 0.00 |
| 债券投资 | 0.00 | 0.00 |
| 基金投资 | 7,498,792.58 | 0.00 |
| 权证投资 | 0.00 | 0.00 |
| 资产支持证券投资 | 0.00 | 0.00 |
| 衍生金融工具 | 0.00 | 0.00 |
| 买入返售金融资产 | 0.00 | 0.00 |
| 应收证券清算款 | 0.00 | 0.00 |

| | | |
|-------------|----------------------|----------------------|
| 应收利息 | 450.51 | 1,712.56 |
| 应收股利 | 20,313.53 | 0.00 |
| 应收申购款 | 0.00 | 0.00 |
| 其他资产 | 74,427,612.82 | 72,008,297.79 |
| | | |
| | | |
| | | |
| 资产合计 | 82,857,104.13 | 81,634,363.72 |

集合计划资产负债表（续）

单位：人民币元

| 负债与持有人权益 | 期末余额 | 年初余额 |
|-------------------|----------------------|----------------------|
| 负 债： | | |
| 短期借款 | 0.00 | 0.00 |
| 交易性金融负债 | 0.00 | 0.00 |
| 衍生金融负债 | 0.00 | 0.00 |
| 卖出回购金融资产款 | 0.00 | 0.00 |
| 应付证券清算款 | 0.00 | 0.00 |
| 应付赎回款 | 0.00 | 0.00 |
| 应付管理人报酬 | 418,419.55 | 274,701.02 |
| 应付托管费 | 23,598.35 | 16,482.13 |
| 应付销售服务费 | 0.00 | 0.00 |
| 应付交易费用 | 0.00 | 0.00 |
| 应交税费 | 0.00 | 0.00 |
| 应付利息 | 0.00 | 0.00 |
| 应付利润 | 0.00 | 0.00 |
| 其他负债 | 5,500.00 | 3,500.00 |
| 负债合计 | 447,517.90 | 294,683.15 |
| | | |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 75,132,546.65 | 77,909,463.39 |
| 未分配利润 | 7,277,039.58 | 3,430,217.18 |
| 所有者权益合计 | 82,409,586.23 | 81,339,680.57 |
| 负债和所有者权益总计 | 82,857,104.13 | 81,634,363.72 |

（二）集合计划经营业绩表

单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 本期数 | 上年同期数 |
|----|--------|--------------|--------------|
| 1 | 一、收入 | 3,957,523.36 | 3,729,213.93 |
| 2 | 1、利息收入 | 25,922.40 | 14,175.78 |

| | | | |
|----|----------------|--------------|--------------|
| 3 | 其中：存款利息收入 | 25,922.40 | 14,175.78 |
| 4 | 债券利息收入 | 0.00 | 0.00 |
| 5 | 资产支持证券利息收入 | 0.00 | 0.00 |
| 6 | 买入返售证券收入 | 0.00 | 0.00 |
| 7 | 信托理财产品利息收入 | 0.00 | 0.00 |
| 8 | 利息收入-增值税贷款服务抵减 | 0.00 | 0.00 |
| 9 | 2、投资收益 | 187,090.40 | 856,920.15 |
| 10 | 其中：股票投资收益 | 0.00 | 0.00 |
| 11 | 债券投资收益 | 0.00 | 0.00 |
| 12 | 基金投资收益 | -32,255.25 | 0.00 |
| 13 | 权证投资收益 | 0.00 | 0.00 |
| 14 | 资产支持证券投资收益 | 0.00 | 0.00 |
| 15 | 衍生工具收益 | 0.00 | 0.00 |
| 16 | 股利收益 | 0.00 | 0.00 |
| 17 | 基金红利收益 | 99,890.56 | 89,747.38 |
| 18 | 证券理财产品收入 | 119,455.09 | 767,172.77 |
| 19 | 投资收益-差价收入增值税抵减 | 0.00 | 0.00 |
| 20 | 3、公允价值变动收益 | 3,061,117.51 | 2,725,265.23 |
| 21 | 4、其他收入 | 683,393.05 | 132,852.77 |
| 22 | 二、费用 | 451,844.83 | 298,996.75 |
| 23 | 1、管理人报酬 | 418,419.55 | 274,701.02 |
| 24 | 2、托管费 | 23,598.35 | 16,482.13 |
| 25 | 3、销售服务费 | 0.00 | 0.00 |
| 26 | 4、交易费用 | 1,499.10 | 0.00 |
| 27 | 5、利息支出 | 0.00 | 0.00 |
| 28 | 其中：卖出回购金融资产支出 | 0.00 | 0.00 |
| 29 | 6、其他费用 | 8,327.83 | 7,813.60 |
| 30 | 7、增值税金及附加税 | 0.00 | 0.00 |
| 31 | 三、利润总和 | 3,505,678.53 | 3,430,217.18 |

八、投资收益分配情况

本报告期内，未发生投资收益分配情况。

九、投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项的说明

(一) 投资经理变更情况

本报告期内，投资经理于 2021 年 8 月 20 日由蒋迪新变更为翟效华。。

（二）重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项说明

截止本报告期末，自有资金参与本计划比例为 14.02%，符合东方财富证券优选 1 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同约定的自有资金参与比例要求。

截止本报告期末，有 1 名投资者为本计划投资经理，其有效参与份额占本计划总份额的 1.23%；有 1 名投资者为本计划管理人关联方，其有效参与份额占本计划总份额的 54.57%。

十、备查文件目录

（一）备查文件目录

- 1、备案确认函；
- 2、《东方财富证券优选 1 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《东方财富证券优选 1 号 FOF 集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《东方财富证券优选 1 号 FOF 集合资产管理计划说明书》；
- 5、合规审查意见；
- 6、集合计划管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、集合计划托管人业务资格批件、营业执照。

（二）存放地点

文件存放地点：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座

信息披露网址：<http://www.18.cn/>

信息披露电话：95357

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人东方财富证券股份有限公司。



