

东方红-先锋7号集合资产管理计划 2022年第3季度报告

资产管理计划管理人：上海东方证券资产管理有限公司

资产管理计划托管人：中国工商银行股份有限公司上海市分行

报告期间：2022年7月1日-2022年9月30日

报告送出日期：2022年10月31日

重要提示

本资产管理计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本资产管理计划资产，但不保证本资产管理计划一定盈利。

本资产管理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资产管理计划合同及说明书。

本报告中财务资料未经审计。

一、基本信息

| | |
|-----------|-------------------|
| 资产管理计划名称： | 东方红-先锋7号集合资产管理计划 |
| 合同生效时间： | 2011年8月3日 |
| 管理人： | 上海东方证券资产管理有限公司 |
| 托管人： | 中国工商银行股份有限公司上海市分行 |

二、资产管理计划投资表现

(一) 主要财务指标

| 主要财务指标 | 报告期(2022年7月1日至2022年9月30日) |
|---------------|---------------------------|
| 期末资产净值(元) | 55,303,282.30 |
| 本期利润(元) | -10,069,082.62 |
| 期末资产管理计划可分配利润 | 37,357,690.38 |
| 期末份额净值(元) | 3.0817 |
| 期末份额累计净值(元) | 3.4482 |
| 本期资产管理计划净值增长率 | -14.62% |
| 资产管理计划累计净值增长率 | 277.56% |

注：本期期末资产管理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参与或退出资产管理计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(二) 资产管理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



注：本资产管理计划无业绩比较基准。

三、资产管理计划投资组合报告

(一) 资产组合情况

| 序号 | 资产类别 | 期末市值（元） | 占期末总资产的比例（%） |
|----|------------|---------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 55,299,208.31 | 98.40 |
| | 其中：境内股票 | 49,328,407.46 | 87.78 |
| | 港股投资 | 5,970,800.85 | 10.62 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,779.07 | 0.00 |
| | 其中：债券 | 1,779.07 | 0.00 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 基金投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款及清算备付金 | 882,642.74 | 1.57 |
| 7 | 其他资产 | 14,267.87 | 0.03 |
| 8 | 资产合计 | 56,197,897.99 | 100.00 |

(二) 报告期末按市值占资产管理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 | 持仓数量(股) | 市值(元) | 市值占委托资产净值比例(%) |
|------|------|---------|-------|----------------|
|------|------|---------|-------|----------------|

| | | | | |
|--------|--------|-----------|--------------|-------|
| 600600 | 青岛啤酒 | 58,200.00 | 6,180,840.00 | 11.18 |
| 00168 | 青岛啤酒股份 | 10,000.00 | 673,355.58 | 1.22 |
| 000568 | 泸州老窖 | 28,700.00 | 6,619,942.00 | 11.97 |
| 600519 | 贵州茅台 | 2,974.00 | 5,568,815.00 | 10.07 |
| 000858 | 五粮液 | 29,200.00 | 4,941,516.00 | 8.94 |
| 002304 | 洋河股份 | 30,100.00 | 4,760,315.00 | 8.61 |
| 600132 | 重庆啤酒 | 25,900.00 | 2,905,980.00 | 5.25 |
| 300595 | 欧普康视 | 55,900.00 | 2,308,670.00 | 4.17 |
| 02331 | 李宁 | 38,500.00 | 2,092,738.49 | 3.78 |
| 600809 | 山西汾酒 | 6,460.00 | 1,956,669.40 | 3.54 |
| 601888 | 中国中免 | 9,000.00 | 1,784,250.00 | 3.23 |

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

(三) 报告期末按市值占资产管理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 | 持仓数量(张) | 市值(元) | 市值占委托资产净值比例(%) |
|--------|------|---------|----------|----------------|
| 128136 | 立讯转债 | 16.00 | 1,779.07 | 0.00 |

(四) 报告期末按市值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细

本资产管理计划本报告期末未持有资产支持证券。

(五) 报告期末按市值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前五名基金明细

本资产管理计划本报告期末未持有基金。

(六) 报告期末按市值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前十名期权明细

本资产管理计划本报告期末未持有期权。

(七) 报告期末期货投资情况

本资产管理计划本报告期末未持有期货。

(八) 报告期末按市值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前十名权证明细

本资产管理计划本报告期末未持有权证。

(九) 资产管理计划运用杠杆情况

本资产管理计划本报告期末，无因从事证券交易所、银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

四、管理人履职报告

(一) 投资经理情况

| 投资经理姓名 | 学历 | 证券从业年限 | 主要工作经历 |
|--------|-----------|--------|---|
| 谭鹏万 | 复旦大学经济学博士 | 15年 | 上海东方证券资产管理有限公司私募权益投资部总经理、投资经理，复旦大学经济学博士，证券从业15年，曾任华宝信托研究员，信诚基金投资部基金经理，中民投国际投资部投研总监，上海东方证券资产管理有限公司投资主办人，私募权益投资部副总经理（主持工作），拥有丰富的证券投资经验。 |

(二) 投资策略回顾与展望

全球经济在第三季度陷入更加不稳定的状态，美欧通胀形势进一步恶化，全球资本市场呈现单边下行的走势。中国经济依然没有明显改善的迹象，预计出口是下一个压力较大的领域。尽管如此，我们对于第四季度和明年的中国市场持谨慎乐观的态度。这既源于当前较低的整体估值，也源于我们对明年中国经济显著改善的判断。

第三季度，本人管理的各组合增加了医药的持仓，我坚信随着经济的复苏和一系列政策的落地，市场将迎来较大的机会，内需主导的消费，医药，制造业将是投资的重点。

(三) 公平交易专项说明

1、公平交易制度的执行情况的专项说明

本资产管理计划管理人一贯公平对待旗下管理的所有计划和组合，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《上海东方证券资产管理有限公司公平交易制度》等规定。

2、异常交易行为的专项说明

本资产管理计划的投资决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合法规规定的要求；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。

五、托管人履职报告

托管人履职报告详见《托管报告》。

六、管理费、托管费、业绩报酬的计提基准、计提方式和支付方式

（一）资产管理计划管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年7月1日至2022年9 月30日 | 上季度可比期间 2022年4月1日至2022 年6月30日 |
|--------------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的资产管理计划应支付的管理费 | 302,059.87 | 315,803.86 |

注：管理费计提基准：按前一日计划资产净值；费率：2.00%/年；计提方式：每日计提；支付方式：每月支付。

（二）资产管理计划托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年7月1日至2022年9 月30日 | 上季度可比期间 2022年4月1日至2022 年6月30日 |
|--------------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的资产管理计划应支付的托管费 | 37,757.48 | 39,475.50 |

注：托管费计提基准：按前一日计划资产净值；费率：0.25%/年；计提方式：每日计提；支付方式：每月支付。

（三）业绩报酬

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年7月1日至2022年9 月30日 | 上季度可比期间 2022年4月1日至2022 年6月30日 |
|-----------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期计提的业绩报酬 | 197,433.54 | 15,208.89 |

注：业绩报酬计提基准：6.00%；计提方式：区间年化收益率6%以上计提20%；支付方式：本计划分红日、投资者退出日或本计划终止日一次性计提并支付。

七、本报告期资产管理计划投资收益分配情况

单位：人民币元

| 报告期 | 每 10 份资产管理计划分红 | 收益分配合计 | 备注 |
|---------------------------------|----------------|--------|----|
| 2022 年 7 月 1 日至 2022 年 9 月 30 日 | - | - | - |

八、本报告期涉及投资者权益的重大事项及其他需要说明的情况

（一）投资经理变更

本报告期内本资产管理计划投资经理没有发生变更。

（二）公司关联人员及自有资金的持有情况

| 项目 | 持有计划份额总量的数量区间（万份） |
|---------------------------|-------------------|
| 管理人董事、监事、从业人员及其配偶参与本计划的情况 | 0 |
| 控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本计划的情况 | 0 |
| 管理人自有资金参与本计划的情况 | 0 |

注：数量区间：0、0~50、50~100、100~500、500~1000、1000~2000、>2000

（三）重大关联交易情况

本报告期内本资产管理计划未发生重大关联交易。

（四）其他

本报告期内本资产管理计划无需要说明的其他情况。

上海东方证券资产管理有限公司
2022 年 10 月 31 日