东方红-先锋 2 号（展期）集合资产管理计划
2021 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：交通银行股份有限公司

报告期间：2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日

报告送出日期：2021 年 10 月 27 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 2 号（展期）集合资产管理计划
合同生效时间：	2010 年 2 月 24 日
管理人：	上海东方证券资产管理有限公司
托管人：	交通银行股份有限公司

二、资产管理计划投资表现

(一)主要财务指标

	本期末
期末资产净值(元)	289,429,667.44
本期利润(元)	-57,648,825.34
期末资产管理计划可分配利润	104,884,921.92
期末份额净值(元)	2.1605
期末份额累计净值(元)	2.3315
本期资产管理计划净值增长率	-16.48%
资产管理计划累计净值增长率	145.90%

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认购或交易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	277,570,632.42	94.67
	其中：境内股票	277,570,632.42	94.67
	港股投资	-	-
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	15,596,001.74	5.32
7	其他资产	35,031.18	0.01
8	资产合计	293,201,665.34	100.00

注：“其他资产”包括“应收红利”、“应收利息”、“其他应收款”等项目。

（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(%)
000568	泸州老窖	130,400.00	28,894,032.00	9.98
600519	贵州茅台	13,501.00	24,706,830.00	8.54
000858	五粮液	104,000.00	22,816,560.00	7.88
002304	洋河股份	114,800.00	19,065,984.00	6.59
002821	凯莱英	39,500.00	17,613,050.00	6.09
601888	中国中免	60,270.00	15,670,200.00	5.41
300760	迈瑞医疗	39,900.00	15,378,258.00	5.31
000799	酒鬼酒	61,200.00	15,161,076.00	5.24
300015	爱尔眼科	274,097.00	14,636,779.80	5.06
600132	重庆啤酒	101,910.00	13,373,649.30	4.62

（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

本资产管理计划本报告期末未持有债券。

（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	14 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 14 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

三季度是一个相对艰难的季度，供应链压力，不断上升的 PPI，严重损害了中下游企业的盈利能力，疫情所带来的不确定性也对消费造成了较大的负面影响，除了上游等少数板块外，其他板块都出现了较大的回调。但供应链紧张，PPI 上升带来压力终将逝去，而推动中国持续成长的科学家红利，工程师红利和管理红利将继续发挥作用，共同富裕，公平与效率并重会给中国带来一个更稳定的未来，从而提高中国的整体估值。管理人认为消费、医药、制造业和科技是中国最值得投资的领域，暂时的调整不改变未来的长期投资价值，管理人将继续加大这些领域的研究和投资，寻找优秀的公司，分享成长。三季度，管理人对管理产品的消费和医药个股做了一些调整，但投资的方向和行业权重并没有做大的调整，同时增加了部分制造业个股的持仓，希望通过这些调整，能为明年打下比较好的业绩基础。

（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 2021 年 7 月 1 日至 2021 年 9 月 30 日	上季度可比期间 2021 年 4 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的资产管理计划应支付的管理费	593,404.88	704,895.75

注：本资产管理计划管理费按前一日资产管理计划资产净值的 0.8%年费率计提，计算方法如下：

G＝E×0.8%÷当年天数

G 为每日应计提的资产管理计划管理费

E 为前一日资产管理计划资产净值

资产管理计划管理费每日计提，按月支付。

（二）资产管理计划托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 7 月 1 日至 2021 年 9 月 30 日	上季度可比期间 2021 年 4 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的资产管理计划应支付的托管费	185,439.04	220,280.00

注：本资产管理计划托管费按前一日资产管理计划资产净值的 0.25%年费率计提，计算方法如下：

T＝E×0.25%÷当年天数

T 为每日应计提的资产管理计划托管费

E 为前一日资产管理计划资产净值

资产管理计划托管费每日计提，按月支付。

（三）业绩报酬

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 7 月 1 日至 2021 年 9 月 30 日	上季度可比期间 2021 年 4 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

当期计提的业绩报酬	1,325,150.58	3,847,339.86

注：(1)业绩报酬计提日为本资产管理计划分红日、委托人退出日或本资产管理计划终止日。以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日(如上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日不存在，则为参与当日）至本次业绩报酬计提日期间的年化收益率 R，作为计提业绩报酬的基准。

R=（A-B)/C*360/D*100%

A 为业绩报酬计提日的累计单位净值；

B 为上一个业绩报酬计提日的累计单位净值；

C 为上一个业绩报酬计提日的单位净值；

D 为上一业绩报酬计提日与本次业绩报酬计提日间隔天数；

年化收益率（R），计提比例，业绩报酬（H）计算方法

R≤8%，0，H=0

R>8%，20%，H=(R-8%)*20%*C*F*D/360

F 为提取业绩报酬的份额。

七、本报告期资产管理计划投资收益分配情况

本报告期内，本资产管理计划未进行收益分配。

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

本资产管理计划本报告期投资经理未发生变更。

（二）公司关联人员持有情况

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

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
2021 年 10 月 27 日