

东方红 5 号灵活配置集合资产管理计划 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

集合计划托管人中国工商银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2021 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 集合计划简介	5
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	5
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和集合计划净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 集合计划净值表现	6
§ 4 管理人报告	8
4.1 集合计划管理人及集合计划投资经理情况	8
4.2 本集合计划管理人对报告期内本集合计划运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内集合计划估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内集合计划利润分配情况的说明	12
4.8 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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本集合计划托管人合规守信情况声明	12
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（集合计划净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末集合计划资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
7.6 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	40

7.7 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资产支持证券投资明细	40
7.8 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	40
7.9 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	40
7.10 报告期末本集合计划投资的股指期货交易情况说明	40
7.11 报告期末本集合计划投资的国债期货交易情况说明	41
7.12 投资组合报告附注	41
§ 8 集合计划份额持有人信息	42
8.1 期末集合计划份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末集合计划管理人的从业人员持有本集合计划的情况	42
8.3 期末集合计划管理人的从业人员持有本集合计划份额总量区间情况	42
§ 9 集合计划份额变动	42
§ 10 重大事件揭示	43
10.1 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	43
10.2 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	43
10.3 集合计划投资策略的改变	43
10.4 为集合计划进行审计的会计师事务所情况	43
10.5 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	43
10.6 其他重大事件	43
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	44
11.1 报告期内单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过 20%的情况	44
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	44
§ 12 备查文件目录	44
12.1 备查文件目录	44
12.2 存放地点	44
12.3 查阅方式	44

§ 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 5 号灵活配置集合资产管理计划
集合计划简称	东方红 5 号集合
集合计划主代码	910005
集合计划运作方式	契约型开放式
集合计划合同生效日	2010 年 2 月 5 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	中国工商银行股份有限公司
报告期末集合计划份额总额	145,436,016.19 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	把握行业景气度变化和市场运行的脉搏，精选发展前景良好或周期复苏行业中的领先企业。在控制风险的前提下，积极把握资本市场波动所带来的获利机会，追求资产的长期稳定增值。
投资理念	通过宏观经济深入研究，采取自上而下的资产配置策略，灵活运用多种投资策略，投资各类金融产品，以有效捕捉中国资本市场结构变动和产品创新产生的投资机会。在中国股市的波动特征下，把握宏观经济周期和行业生命周期的发展变化趋势，通过对重点行业中的优势企业进行深入挖掘，获取长期稳定的资本增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数*70% + 上证国债指数*30%

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李云亮
	联系电话	021-53952828
	电子邮箱	service@dfham.com
客户服务电话	4009200808	95588
传真	021-63326381	010-66105798
注册地址	上海市黄浦区中山南路 109 号 7 层-11 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	上海市黄浦区外马路 108 号 7 层-11 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200010	100140
法定代表人	宋雪枫	陈四清

2.4 信息披露方式

登载集合计划中期报告正文的管理人互联网网址	www.dfham.com
集合计划中期报告备置地点	上海市黄浦区外马路 108 号 7 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和集合计划净值表现

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	报告期(2021年1月1日-2021年6月30日)
本期已实现收益	258,094,679.22
本期利润	195,722,979.27
加权平均集合计划份额本期利润	1.3424
本期加权平均净值利润率	19.07%
本期集合计划份额净值增长率	20.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	804,399,876.95
期末可供分配集合计划份额利润	5.5310
期末集合计划资产净值	1,157,169,388.25
期末集合计划份额净值	7.9566
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
集合计划份额累计净值增长率	944.15%

注：1、上述集合计划业绩指标不包括持有人参与或退出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、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（不含暂估附加税）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扣除相关暂估附加税。

3、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 值增长	份额净值 增长率标	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差	①—③	②—④
----	-------------	--------------	----------------	------------------	-----	-----

	率①	准差②		④		
过去一个月	1.90%	1.44%	-1.37%	0.57%	3.27%	0.87%
过去三个月	24.47%	1.66%	2.75%	0.68%	21.72%	0.98%
过去六个月	20.82%	2.11%	0.89%	0.92%	19.93%	1.19%
过去一年	77.63%	1.81%	18.59%	0.93%	59.04%	0.88%
过去三年	101.65%	1.49%	38.99%	0.95%	62.66%	0.54%
自集合计划合同生效起至今	944.15%	1.39%	69.31%	1.01%	874.84%	0.38%

注：根据集合计划说明书的有关规定，本集合计划的业绩比较基准=沪深 300 指数收益率*70%+上证国债指数收益率*30%。本集合计划股票投资部分的业绩比较基准采用沪深 300 指数，债券投资部分的业绩比较基准采用上证国债指数。

本集合计划每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，t 日收益率（benchmark_t）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_t = 70\% * [\text{t 日沪深 300 指数} / (\text{t-1 日沪深 300 指数}) - 1] + 30\% * [\text{t 日上证国债指数} / (\text{t-1 日上证国债指数}) - 1];$$

其中，t=1, 2, 3, . . . T, T 表示时间截至日；

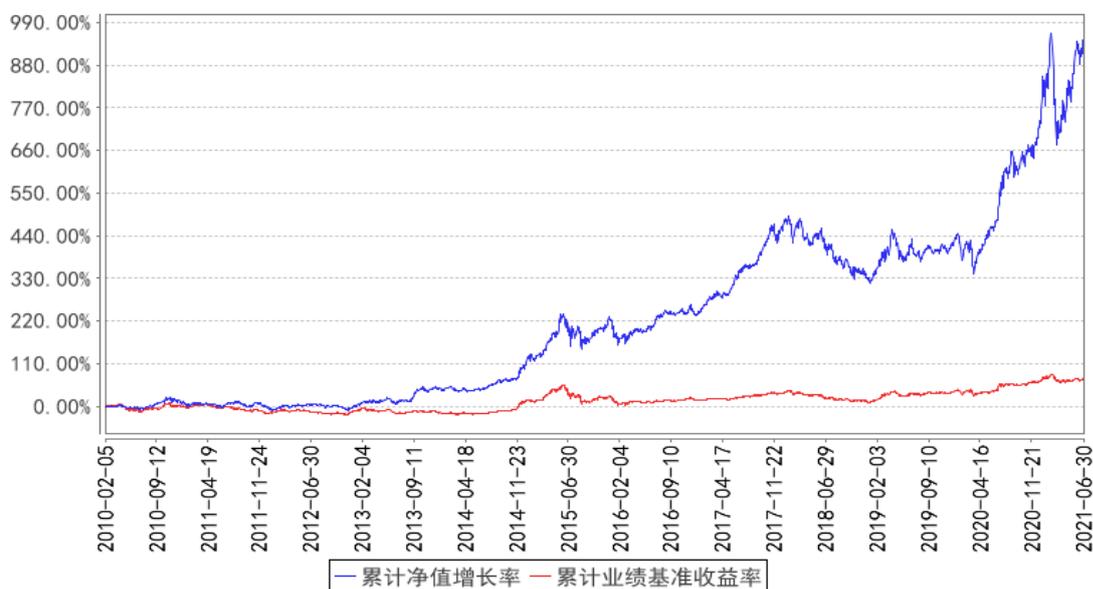
t 日至 T 日的期间收益率（benchmark_T）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_{Tt} = [\prod_{t=T}^t (1 + \text{benchmark}_t)] - 1$$

其中，T=2, 3, 4, . . . ; $\prod_{t=T}^t (1 + \text{benchmark}_t)$ 表示 t 日至 T 日的 $(1 + \text{benchmark}_t)$ 数学连乘。

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

东方红5号集合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 集合计划管理人及集合计划投资经理情况

4.1.1 集合计划管理人及其管理集合计划的经验

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“公开募集证券投资集合计划管理业务资格”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 2021 年 6 月 30 日，本集合计划管理人共管理东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、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（LOF）、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、东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金、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、东方红信用债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、东方红汇阳债券型证券投资

资基金、东方红汇利债券型证券投资基金、东方红新动力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）、东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、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 6 个月定期开放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、东方红睿轩三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红货币市场基金、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、东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金、东方红聚利债券型证券投资基金、东方红启元三年持有期混合型证券投资基金、东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红安鑫甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红鑫裕两年定期开放信用债券型证券投资基金、东方红恒阳五年定期开放混合型证券投资基金、东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红启东三年持有期混合型证券投资基金、东方红颐和积极养老目标五年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红颐和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红颐和稳健养老目标两年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红智远三年持有期混合型证券投资基金、东方红益丰纯债债券型证券投资基金、东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金、东方红招盈甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红鑫安 39 个月定期开放债券型证券投资基金、东方红明鉴优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红鼎元 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红启航三年持有期混合型证券投资基金、东方红锦丰优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红多元策略混合型证券投资基金、东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红创新趋势混合型证券投资基金、东方红远见价值混合型证券投资基金、东方红启阳三年持有期混合型证券投资基金、东方红启瑞三年持有期混合型证券投资基金、东方红启程三年持有期混合型证券投资基金、东方红启盛三年持有期混合型证券投资基金、东方红锦和甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金、东方红启恒三年持有期混合型证券投资基金、东方红启华三年持有期混合型证券投资基金、东方红内需增长混合型证券投资基金共计 70 只公开募集证券投资基金，以及东方红 5 号灵活配置集合资产管理计划、东方红-

新睿 2 号集合资产管理计划、东方红-新睿 5 号集合资产管理计划、东方红增利 2 号集合资产管理计划、东方红增利 6 号集合资产管理计划、东方红基金宝集合资产管理计划共计 6 只大集合产品。

4.1.2 集合计划投资经理简介

姓名	职务	任本集合计划投资经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨仁眉	本集合资产管理计划投资经理。	2021 年 2 月 5 日	-	8 年	西南财经大学金融学博士。曾任西南证券股份有限公司研究员，金信集合计划管理有限公司基金经理。具备证券投资基金从业资格
张锋	上海东方证券资产管理有限公司副总经理、首席投资官兼任公募权益投资部总经理、基金经理兼任投资经理	2018 年 6 月 14 日	-	21 年	上海东方证券资产管理有限公司副总经理、首席投资官，兼任公募权益投资部总经理，基金经理兼任投资经理。复旦大学经济学硕士。曾任上海财政证券公司研究员，兴业证券股份有限公司研究员，上海融昌资产管理有限公司研究员，信诚集合计划管理有限公司股票投资副总监、基金经理，上海东方证券资产管理有限公司基金投资部总监、私募权益投资部总经理、公募集合权益投资部总经理、执行董事、董事总经理。具备证券投资基金从业资格。

注：1、上述表格内集合计划首任集合计划投资经理“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经理，集合计划投资经理的“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。

4.2 本集合计划管理人对报告期内本集合计划运作遵规守信情况的说明

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。

4.3.2 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

“新冠”疫情在全球范围内多次反复，一波还未平息，一波又要兴起。全球各国政府及机构均在为控制疫情推出各种有效政策，全力以赴从而降低疫情对各个地区发展的影响。同样的，中国也在为疫情控制提供各种政策致力于将损失降低到最低程度，稳固中国所具有的“有事可做，有人做事，有钱做事”社会发展环境以及中国经济进入转型期的商业环境，激发企业潜力。中国政府为此做出了巨大努力，也为全球经济发展做出了巨大贡献。

中国优质企业也在疫情中得到认可，为中国企业赢得了时间，赢得了信任。同时，中国国产替代也在悄无声息地快速发展，疫情为中国国产替代战略提供了得天独厚的条件，降低了企业的信任成本。疫情发生后不仅让中国优质企业在全世界范围内得以认可，也让中国产业链的发展与完整进一步提供了机会，且中国企业在全世界产业链中的地位得以快速提升，改变了中国企业在国际市场上的形象。中国的产业、中国的企业，全球经济产业链也在为中国政府的应对点赞，中国企业也因中国政府的治理能力获得了奖励。疫情着实让世界看到了“治大国，若烹小鲜”的战略方针政策，中国经济在未来很长时间内将逐步实现以品质增长为目标。

“世界普物，中国造；世界新物，中国造，世界好物，中国造”，中国制造业的制造能力跻身全球一流水平，中国也因此成为名副其实的世界工厂。全球范围内 made in china 可能俯首皆是，但 design in china 并非触手可达。正是这样的发展阶段，品质发展成为中国企业未来发展的方向，社会的发展质量成为中国全社会追求的目标，追求的轨迹。中国经济发展也处于逐步由数量发展阶段转型到质量发展阶段，政策等为品质发展提供支持。

4.4.2 报告期内集合计划的业绩表现

截至本报告期末，本集合计划份额净值为 7.9566 元，份额累计净值为 8.9486 元；本报告期集合计划份额净值增长率为 20.82%，业绩比较基准收益率为 0.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

“世界普物，中国造；世界新物，中国造，世界好物，中国造”，中国制造业的制造能力跻

身全球一流水平，中国也因此成为名副其实的世界工厂。全球范围内 made in china 可能俯首皆是，但 design in china 并非触手可及。正是这样的发展阶段，品质发展成为中国企业未来发展的方向，社会的发展质量成为中国全社会追求的目标，追求的轨迹。中国经济发展也处于逐步由数量发展阶段转型到质量发展阶段，政策等为品质发展提供支持。

4.6 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照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会发布的《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，估值委员会成员的任命和调整由总经理办公会审议决定。运营部是估值委员会的日常办事机构，负责关注相关投资品种的动态，确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种，并提交估值委员会审议。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。

4.7 管理人对报告期内集合计划利润分配情况的说明

本集合计划本报告期内未进行利润分配。

4.8 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，本集合计划托管人在对东方红 5 号-灵活配置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》及其他法律法规和集合计划合同的有关规定，不存在任何损害集合计划委托人利益的行为，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，东方红 5 号-灵活配置集合资产管理计划的管理人——上海东方证券资产管理有限公司在东方红 5 号-灵活配置集合资产管理计划的投资运作、集合计划资产净值计算、集合计划份额参与退出价格计算、集合计划费用开支等问题上，不存在任何损害集合计划委托人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照集合计划合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对上海东方证券资产管理有限公司编制和披露的东方红 5 号-灵活配置集合资产管理计划 2021 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东方红 5 号灵活配置集合资产管理计划

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	77,662,227.02	63,512,817.00
结算备付金		2,104,141.69	1,730,800.80
存出保证金		207,338.88	81,185.19
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	6.4.7.2	1,086,763,566.00	916,513,393.63
其中：股票投资		1,086,763,566.00	916,513,393.63
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,387,405.80	6,776,289.22
应收利息	6.4.7.5	7,092.23	7,593.49
应收股利		-	-
应收申购款		218,670.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,168,350,441.62	988,622,079.33

负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		15.17	6,201,693.11
应付赎回款		66,017.07	375,121.97
应付管理人报酬		12,681.93	66,551.63
应付托管费		232,679.73	188,825.52
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	322,112.55	279,189.04
应交税费		10,430,867.22	12,665,509.70
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	116,679.70	78,000.00
负债合计		11,181,053.37	19,854,890.97
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	145,436,016.19	147,100,749.50
未分配利润	6.4.7.10	1,011,733,372.06	821,666,438.86
所有者权益合计		1,157,169,388.25	968,767,188.36
负债和所有者权益总计		1,168,350,441.62	988,622,079.33

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，集合资产管理计划份额净值 7.9566 元，集合资产管理计划份额总额 145,436,016.19 份。

6.2 利润表

会计主体：东方红 5 号灵活配置集合资产管理计划

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		203,905,570.49	69,027,323.86
1. 利息收入		163,036.58	177,356.49
其中：存款利息收入	6.4.7.11	163,036.58	176,487.37
债券利息收入		-	869.12
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收		-	-

入			
证券出借利息收入			-
其他利息收入			-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		266,334,845.41	-538,781.85
其中：股票投资收益	6.4.7.12	264,363,518.50	-6,001,460.25
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	652,065.72
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,971,326.91	4,810,612.68
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-62,592,311.50	69,388,749.22
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）			-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18		-
减：二、费用		8,182,591.22	15,506,603.24
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,838,065.70	12,692,833.86
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,280,143.62	853,806.31
3. 销售服务费	-	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,298,914.94	1,385,931.85
5. 利息支出			-
其中：卖出回购金融资产支出			-
6. 税金及附加		726,376.34	535,021.20
7. 其他费用	6.4.7.20	39,090.62	39,010.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		195,722,979.27	53,520,720.62
减：所得税费用			-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		195,722,979.27	53,520,720.62

6.3 所有者权益（集合计划净值）变动表

会计主体：东方红5号灵活配置集合资产管理计划

本报告期：2021年1月1日至2021年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30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）	147,100,749.50	821,666,438.86	968,767,188.36
二、本期经营活动产生的集合计划净值变动数（本期利润）	-	195,722,979.27	195,722,979.27
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）	-1,664,733.31	-5,656,046.07	-7,320,779.38
其中：1. 集合计划申购款	2,198,089.27	14,055,881.64	16,253,970.91
2. 集合计划赎回款	-3,862,822.58	-19,711,927.71	-23,574,750.29
四、本期向集合计划份额持有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）	145,436,016.19	1,011,733,372.06	1,157,169,388.25
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30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）	188,730,005.16	575,786,235.50	764,516,240.66
二、本期经营活动产生的集合计划净值变动数（本期利润）	-	53,520,720.62	53,520,720.62
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）	-29,420,841.05	-75,016,665.24	-104,437,506.29
其中：1. 集合计划申购款	-	-	-

2. 集合计划赎回款	-29,420,841.05	-75,016,665.24	-104,437,506.29
四、本期向集合计划份额持有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）	159,309,164.11	554,290,290.88	713,599,454.99

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张锋

汤琳

陈培

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

6.4 报表附注

6.4.1 集合计划基本情况

东方红 5 号-灵活配置集合资产管理计划(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“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。

本集合计划无固定存续期限,首次设立推广不包括认购资金利息共募集人民币 1,596,588,633.50 元,业经立信会计师事务所有限公司信会师报字(2010)第 20351 号验资报告予以验证。经管理人公告,本集合计划于 2010 年 2 月 5 日成立,设立日的份额总额为 1,596,695,594.09 份,其中有效参与资金利息折合 106,960.59 份集合计划份额。本集合计划的管理人为东证资管,托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

根据《东方红 5 号-灵活配置集合资产管理合同》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:中国境内依法发行的股票、沪港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券、证券投资基金、央行票据、短期融资券、资产支持证券、中期票据、国债期货、股指期货等金融衍生品、保证收益及保本浮动收益商业银行理财计划、证券回购以及中国证监会认可的其他投资品种。本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。在深港股票市场交易互联互通机制试点推出

后，本集合计划可投资深港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票。在未来法律法规允许的情况下，本集合计划可投资在美国上市的中国公司股票，其中中国公司指满足如下两个条件之一的上市公司，1)上市公司中最少百分之五十之营业额、盈利、资产或制造活动来自中国大陆；2)控股公司，其子公司的注册办公室在中国大陆，且主要业务活动亦在中国大陆。本集合计划如需投资商业银行理财计划、国债期货、沪深港通的股票，需与托管人就账户开立、资金划付及保管、估值核算等事项协商并达成一致意见后方可投资。

6.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划的财务报表按照《东方红 5 号-灵活配置集合资产管理合同》及《东方红 5 号-灵活配置集合资产管理计划说明书》约定的资产估值、会计核算方法及其他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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划 2021 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和集合计划净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本集合计划本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

集合计划目前比照公开募集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财税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 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	77,662,227.02
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	77,662,227.02

6.4.7.2 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 2021 年 6 月 30 日
----	------------------------

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	783,045,528.41	1,086,763,566.00	303,718,037.59
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	783,045,528.41	1,086,763,566.00	303,718,037.59

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本集合计划本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本集合计划本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本集合计划本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	6,403.62
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	604.64
应收债券利息	-
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	-
应收出借证券利息	-
其他	83.97
合计	7,092.23

6.4.7.6 其他资产

注：本集合计划本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	322,112.55
银行间市场应付交易费用	-
合计	322,112.55

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	116,679.70
合计	116,679.70

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	集合计划份额（份）	账面金额
上年度末	147,100,749.50	147,100,749.50
本期申购	2,198,089.27	2,198,089.27
本期赎回（以“-”号填列）	-3,862,822.58	-3,862,822.58
- 集合计划拆分/份额折算前	-	-
集合计划拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	145,436,016.19	145,436,016.19

6.4.7.10 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	549,941,670.64	271,724,768.22	821,666,438.86
本期利润	258,094,679.22	-62,371,699.95	195,722,979.27
本期集合计划份额交易产生的变动数	-3,636,472.91	-2,019,573.16	-5,656,046.07
其中：集合计划申购款	11,176,064.57	2,879,817.07	14,055,881.64
集合计划赎回款	-14,812,537.48	-4,899,390.23	-19,711,927.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	804,399,876.95	207,333,495.11	1,011,733,372.06

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	145,086.68
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	15,945.68
其他	2,004.22
合计	163,036.58

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	264,363,518.50
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	264,363,518.50

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	849,881,525.77
减：卖出股票成本总额	585,518,007.27
买卖股票差价收入	264,363,518.50

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本集合计划本报告期无股票投资收益-证券出借差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本集合计划本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本集合计划本报告期无债券投资收益-买卖债券差价收入。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本集合计划本报告期无债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本集合计划本报告期无债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本集合计划本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本集合计划本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本集合计划本报告期内无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本集合计划本报告期内无贵金属投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本集合计划本报告期内无贵金属投资收益-申购差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本集合计划本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本集合计划本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,971,326.91
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,971,326.91

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-64,430,741.00
股票投资	-64,430,741.00
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-1,838,429.50
合计	-62,592,311.50

6.4.7.18 其他收入

注：本集合计划本报告期内无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	2,298,914.94
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	2,298,914.94

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	38,679.70
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	410.92
合计	39,090.62

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本集合计划存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与集合计划发生关联交易的各关联方

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	集合计划托管人、集合计划销售机构
上海东证期货有限公司（“东证期货”）	集合计划管理人的股东的子公司
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

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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	-	-	252,993,425.72	26.51

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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	-	-	1,701,400.00	41.95

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：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债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 集合计划管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的集合计划应支付的管理费	3,838,065.70	12,692,833.86

注：本集合计划本期共发生应支付的业绩报酬 3,838,065.70 元 (2020 年度可比期间：12,692,833.86 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参与日（推广期参与的为本集合计划成立日，存续期参与的为参与当日）至本次业绩报酬计提日的期间年化收益率超过 5.00% 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 = (年化收益率 - 5.0%) × 20% × 该笔份额参与日的计划单位净值 × 提取业绩报酬的份额 × 该笔份额参与日到本次业绩报酬计提日间隔天数 / 360 - 该笔份额存续期间已计提的业绩报酬总额

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%。

6.4.10.2.2 集合计划托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的集合计划应支付的托管费	1,280,143.62	853,806.31

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。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：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。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：集合计划本报告期内及上年度可比期间未有与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本集合计划本报告期内及上年度可比期间未有与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本集合计划的情况

6.4.10.5.1 报告期内集合计划管理人运用自有资金投资本集合计划的情况

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间集合计划管理人未运用自有资金投资本集合计划。

6.4.10.5.2 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

注：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。

6.4.10.6 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	77,662,227.02	145,086.68	53,922,854.17	163,961.55

注：本集合计划的银行存款由本集合计划托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本集合计划在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

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2021年06月30日，本集合计划的结算备付金余额为1,099,459.06元，无存出保证金余额(2020年12月31日：结算备付金1,095,468.29元，无存出保证金余额)。于2021年1月1日至2021年06月30日，本集合计划当期结算备付金利息收入3,969.58元(2020年1月1日至2020年6月30日：3,962.26元)。

6.4.11 利润分配情况

注：本集合计划本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2021年6月30日)本集合计划持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本集合计划本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本集合计划本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本集合计划本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本集合计划管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。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，负责督促各职能部门在日常工作中识别各项业务所涉及各类重大风险，组织对重大事件、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，就相关解决方案进行评审；督促各职能部门识别和评估新产品、新业务的风险，就相关控制措施进行评审；督促各职能部门重点关注内控机制薄弱环节和可能给公司带来重大损失的事件，审议并决定相应的控制措施和解决方案等。

6.4.13.2 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中国工商银行，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。于 2021 年 6 月 30 日，本集合计划无债券投资。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：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。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：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。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：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。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：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债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：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。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：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。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指集合计划在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于集合计划委托人于约定开放日要求退出集合计划，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。

针对投资品种变现的流动性风险，本集合计划管理人通过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。且本集合计划所持证券均在证券交易所上市，因此均能及时变现。

于 2021 年 06 月 30 日，本集合计划所承担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，可赎回集合计划份额净值(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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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。

本集合计划持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本集合计划的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30 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	77,662,227.02	-	-	-	-	-	77,662,227.02
结算备付金	2,104,141.69	-	-	-	-	-	2,104,141.69
存出保证金	207,338.88	-	-	-	-	-	207,338.88
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,086,763,566.00	1,086,763,566.00
应收利息	-	-	-	-	-	7,092.23	7,092.23
应收申购款	218,670.00	-	-	-	-	-	218,670.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,387,405.80	1,387,405.80
资产总计	80,192,377.59	-	-	-	-	1,088,158,064.03	1,168,350,441.62
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	66,017.07	66,017.07
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	12,681.93	12,681.93
应付托管费	-	-	-	-	-	232,679.73	232,679.73
应付证券清算款	-	-	-	-	-	15.17	15.17

应付交易费用	-	-	-	-	-	322,112.55	322,112.55
应交税费	-	-	-	-	-	10,430,867.22	10,430,867.22
其他负债	-	-	-	-	-	116,679.70	116,679.70
负债总计	-	-	-	-	-	11,181,053.37	11,181,053.37
利率敏感度缺口	80,192,377.59	-	-	-	-	1,076,977,010.66	1,157,169,388.25
上年度末 2020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	63,512,817.00	-	-	-	-	-	63,512,817.00
结算备付金	1,730,800.80	-	-	-	-	-	1,730,800.80
存出保证金	81,185.19	-	-	-	-	-	81,185.19
交易性金融资产	-	-	-	-	-	916,513,393.63	916,513,393.63
应收利息	-	-	-	-	-	7,593.49	7,593.49
应收证券清算款	-	-	-	-	-	6,776,289.22	6,776,289.22
资产总计	65,324,802.99	-	-	-	-	923,297,276.34	988,622,079.33
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	375,121.97	375,121.97
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	66,551.63	66,551.63
应付托管费	-	-	-	-	-	188,825.52	188,825.52
应付证券清算款	-	-	-	-	-	6,201,693.11	6,201,693.11
应付交易费用	-	-	-	-	-	279,189.04	279,189.04
应交税费	-	-	-	-	-	12,665,509.70	12,665,509.70
其他负债	-	-	-	-	-	78,000.00	78,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	19,854,890.97	19,854,890.97
利率敏感度缺口	65,324,802.99	-	-	-	-	903,442,385.37	968,767,188.36

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2021 年 6 月 30 日，本集合计划未持有交易性债券投资 (2020 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本集合计划资产净值无重大影响 (2020 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 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。本集合计划持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	68,543,422.08	-	68,543,422.08
资产合计	-	68,543,422.08	-	68,543,422.08
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净 额	-	68,543,422.08	-	68,543,422.08
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	92,405,675.54	-	92,405,675.54
资产合计	-	92,405,675.54	-	92,405,675.54

以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	92,405,675.54	-	92,405,675.54

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他市场变量保持不变		
	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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	1、港币相对人民币升值 5%	3,427,171.10	4,620,283.78
	2、港币相对人民币贬值 5%	-3,427,171.10	-4,620,283.78

6.4.13.4.3 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。

本集合计划的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。本集合计划的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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	1,086,763,566.00	93.92	916,513,393.63	94.61
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	-	-	-	-
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	1,086,763,566.00	93.92	916,513,393.63	94.61

6.4.13.4.3.2 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		
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 (2021 年 6 月 30 日)	上年度末 (2020 年 12 月 31 日)	
分析	1. 沪深 300 指数上升 5%	77,178,875.93	52,096,811.31
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-77,178,875.93	-52,096,811.31

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。

6.4.14 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 2021 年 6 月 30 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 1,086,763,566.00 元，无属于第二层次的余额，无第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次为 916,513,393.63 元，无属于第二层次的余额，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 2021 年 6 月 30 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(2020 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。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	1,086,763,566.00	93.02
	其中：股票	1,086,763,566.00	93.02
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	79,766,368.71	6.83
8	其他各项资产	1,820,506.91	0.16
9	合计	1,168,350,441.62	100.00

注：1、本集合计划本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 68,543,422.08 元人民币，占期末集合计划资产净值比例为 5.92%。

2、本集合计划本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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（元）	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	631,967,030.50	54.61
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	41,726,300.00	3.61
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	344,526,813.42	29.77
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,018,220,143.92	87.99

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占集合计划资产净值比例（%）
00 能源	-	-
01 原材料	-	-
02 工业	-	-
03 可选消费	33,462,929.28	2.89
04 主要消费	-	-
05 医药卫生	-	-
06 金融地产	-	-
07 信息技术	35,080,492.80	3.03
08 电信业务	-	-
09 公用事业	-	-
合计	68,543,422.08	5.92

注：以上分类采用中证行业分类标准。

7.3 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（元）	占集合计划资产净值比例（%）
1	300015	爱尔眼科	1,599,779	113,552,313.42	9.81
2	300750	宁德时代	211,300	113,003,240.00	9.77
3	300760	迈瑞医疗	231,524	111,143,096.20	9.60
4	600763	通策医疗	267,000	109,737,000.00	9.48
5	000568	泸州老窖	461,900	108,980,686.00	9.42
6	600519	贵州茅台	52,000	106,948,400.00	9.24
7	000858	五粮液	350,470	104,401,508.30	9.02
8	300347	泰格医药	345,000	66,688,500.00	5.76
9	000516	国际医学	2,900,000	54,549,000.00	4.71
10	600036	招商银行	770,000	41,726,300.00	3.61
11	600600	青岛啤酒	350,000	40,477,500.00	3.50
12	00268	金蝶国际	1,600,000	35,080,492.80	3.03
13	02020	安踏体育	220,000	33,462,929.28	2.89
14	300119	瑞普生物	980,000	33,143,600.00	2.86
15	002371	北方华创	50,000	13,869,000.00	1.20

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。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600763	通策医疗	110,561,200.54	11.41
2	300760	迈瑞医疗	89,926,984.62	9.28
3	300015	爱尔眼科	85,116,015.43	8.79
4	000568	泸州老窖	52,110,122.30	5.38
5	300347	泰格医药	48,068,496.00	4.96
6	600036	招商银行	45,112,915.00	4.66
7	300119	瑞普生物	37,026,629.00	3.82
8	600600	青岛啤酒	36,389,729.00	3.76
9	00268	金蝶国际	35,862,288.43	3.70
10	000516	国际医学	32,657,824.50	3.37
11	603259	药明康德	30,872,256.49	3.19
12	300750	宁德时代	27,633,218.14	2.85
13	300122	智飞生物	25,555,652.00	2.64
14	02020	安踏体育	24,741,527.97	2.55
15	000338	潍柴动力	21,977,947.00	2.27
16	000858	五粮液	21,455,454.62	2.21
17	600132	重庆啤酒	18,176,658.12	1.88
18	600519	贵州茅台	17,788,591.30	1.84
19	03808	中国重汽	14,894,142.04	1.54
20	002371	北方华创	13,795,056.56	1.42

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。

7.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初集合计划资产净值比例 (%)
1	603517	绝味食品	100,747,333.70	10.40
2	601012	隆基股份	99,645,848.41	10.29
3	002311	海大集团	94,853,662.92	9.79
4	300122	智飞生物	56,119,007.79	5.79
5	00700	腾讯控股	45,086,624.48	4.65
6	002304	洋河股份	42,467,713.87	4.38
7	600031	三一重工	41,474,686.00	4.28
8	600763	通策医疗	37,572,015.50	3.88
9	000333	美的集团	36,779,594.70	3.80
10	603259	药明康德	32,570,070.20	3.36
11	300750	宁德时代	30,768,422.46	3.18
12	01579	颐海国际	29,131,686.99	3.01

13	603882	金域医学	28,618,782.00	2.95
14	000338	潍柴动力	25,799,864.00	2.66
15	600486	扬农化工	22,562,515.90	2.33
16	600132	重庆啤酒	19,240,898.65	1.99
17	600305	恒顺醋业	18,440,312.97	1.90
18	300015	爱尔眼科	17,907,097.16	1.85
19	00291	华润啤酒	15,549,261.50	1.61
20	03808	中国重汽	14,300,749.08	1.48

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。

7.4.3 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	812,307,354.94
卖出股票收入（成交）总额	849,881,525.77

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本集合计划本报告期末未持有债券。

7.6 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

注：本集合计划本报告期末未持有债券。

7.7 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资产支持证券投资明细

注：本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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

注：本集合计划本报告期末未持有贵金属。

7.9 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

注：本集合计划本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本集合计划投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本集合计划投资的股指期货持仓和损益明细

注：本集合计划本报告期末未进行股指期货投资。

7.10.2 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的主要目的是回避市场风险和实施套利策略。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或获取低风险套利收益。另外，管理人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。

7.11 报告期末本集合计划投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 报告期末本集合计划投资的国债期货持仓和损益明细

注：本集合计划本报告期末进行国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本集合计划本报告期末进行国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 集合计划投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本集合计划持有的招商银行（代码：600036）的发行主体招商银行股份有限公司因为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产等行于 2021 年 5 月 17 日被中国银行保险监督管理委员会处以罚款 7170 万元。

本集合计划对上述证券的投资决策程序符合集合计划合同及公司制度的相关规定，本集合计划管理人会对上述证券继续保持跟踪研究。

本集合计划持有的前十名证券中其余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。

7.12.2 集合计划投资的前十名股票是否超出集合计划合同规定的备选股票库

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。

7.12.3 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	207,338.88
2	应收证券清算款	1,387,405.80
3	应收股利	-
4	应收利息	7,092.23
5	应收申购款	218,670.00
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,820,506.91

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本集合计划本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：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。

7.12.6 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。

§ 8 集合计划份额持有人信息

8.1 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 (%)
961	151,338.21	18.33	0.00	145,435,997.86	100.00

8.2 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	145,006.42	0.10

8.3 期末集合计划管理人的从业人员持有本集合计划份额总量区间情况

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
本集合计划投资经理持有本集合计划	0

§ 9 集合计划份额变动

单位：份

集合计划合同生效日 (2010 年 2 月 5 日) 集合计划份额总额	1,596,695,594.09
本报告期期初集合计划份额总额	147,100,749.50
本报告期集合计划总申购份额	2,198,089.27
减：本报告期集合计划总赎回份额	3,862,822.58

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	145,436,016.19

§ 10 重大事件揭示

10.1 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

自 2021 年 3 月 12 日起，饶刚不再担任本集合计划管理人副总经理职务。

报告期内，中国工商银行股份有限公司根据工作需要，任命刘彤女士担任资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士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。李勇先生不再担任中国工商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

10.2 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

报告期内无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。

10.3 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。

10.4 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）。报告期内本集合计划未发生改聘会计师事务所的情形。

10.5 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

10.6 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	东方红 5 号-灵活配置集合资产管理计划 2020 年第 4 季度托管报告	公司网站 (www.dfham.com)	2021-01-22
2	东方红 5 号-灵活配置集合资产管理计划 2020 年第 4 季度报告	公司网站 (www.dfham.com)	2021-01-22
3	关于东方红 5 号-灵活配置集合资产管理计划增聘投资经理的公告	公司网站 (www.dfham.com)	2021-02-05
4	东方红 5 号-灵活配置集合资产管理计划 2020 年年度报告	公司网站 (www.dfham.com)	2021-03-31
5	东方红 5 号-灵活配置集合资产管理计划 2020 年年度审计报告	公司网站 (www.dfham.com)	2021-03-31
6	东方红 5 号-灵活配置集合资产管理计划 2020 年年度托管报告	公司网站 (www.dfham.com)	2021-03-31
7	东方红 5 号-灵活配置集合资产管理计划 2021 年第 1 季度托管报告	公司网站 (www.dfham.com)	2021-04-22

8	东方红 5 号-灵活配置集合资产管理计划 2021 年第 1 季度报告	公司网站 (www.dfham.com)	2021-04-22
---	-------------------------------------	-------------------------	------------

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过 20%的情况

注：本集合计划本报告期内未发生单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《东方红 5 号-灵活配置集合资产管理计划说明书》
- 2、《东方红 5 号-灵活配置集合资产管理合同》
- 3、《东方红 5 号-灵活配置集合资产管理计划托管协议》
- 4、《东方红 5 号-灵活配置集合资产管理计划验资报告》
- 5、管理人业务资格批件、营业执照
- 6、《东方红 5 号-灵活配置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：上海市黄浦区外马路 108 号 7 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。

上海东方证券资产管理有限公司

2021 年 8 月 31 日