
东方红添鑫 8 号集合资产管理计划 2022 年第 2 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：华夏银行股份有限公司

报告期间：2022 年 4 月 1 日-2022 年 6 月 30 日

报告送出日期：2022 年 07 月 29 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：	东方红添鑫 8 号集合资产管理计划
合同生效时间：	2021 年 7 月 14 日
管理人：	上海东方证券资产管理有限公司
托管人：	华夏银行股份有限公司

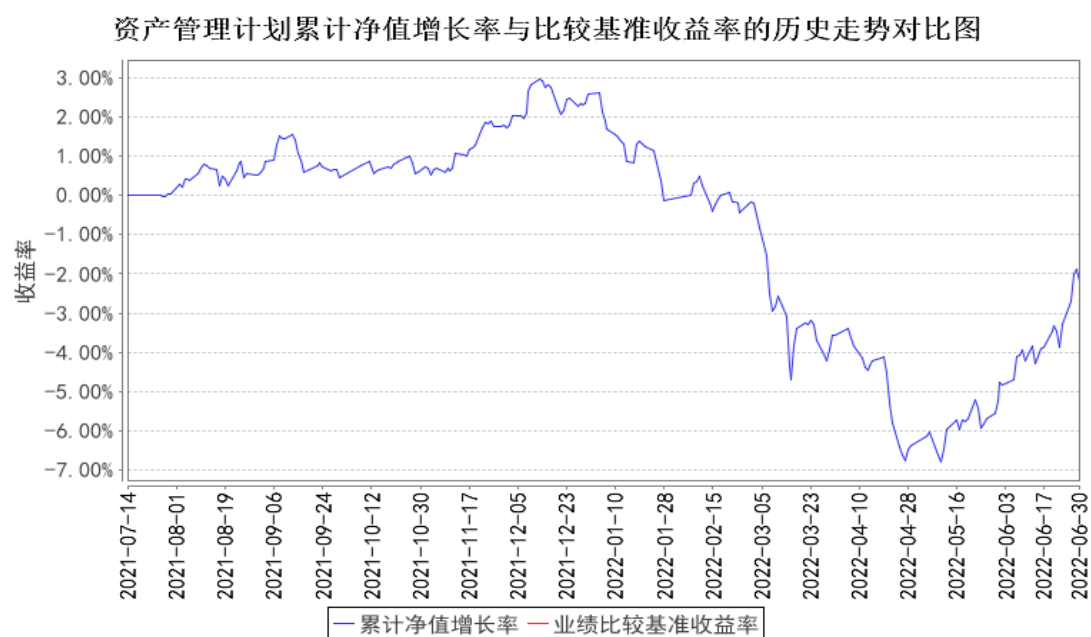
二、资产管理计划投资表现

(一) 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2022 年 4 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日)
期末资产净值(元)	29,422,602.53
本期利润(元)	-11,017,971.57
期末资产管理计划可分配利润	-3,519,286.44
期末份额净值(元)	0.9782
期末份额累计净值(元)	0.9782
本期资产管理计划净值增长率	1.43%
资产管理计划累计净值增长率	-2.18%

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	302,555.64	1.02
	其中：境内股票	302,555.64	1.02
	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	29,001,830.67	98.06
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	163,492.30	0.55
7	其他资产	107,006.88	0.36
8	资产合计	29,574,885.49	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(%)
------	------	---------	-------	----------------

301206	三元生物	531.00	24,261.39	0.08
301236	软通动力	705.00	22,122.90	0.08
301177	迪阿股份	235.00	17,437.00	0.06
301207	华兰疫苗	308.00	17,377.36	0.06
301201	诚达药业	228.00	16,311.12	0.06
301123	奕东电子	594.00	15,081.66	0.05
301096	百诚医药	179.00	14,141.00	0.05
301215	中汽股份	2,188.00	13,981.32	0.05
301219	腾远钴业	147.00	12,909.54	0.04
301117	佳缘科技	185.00	10,071.40	0.03

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

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

基金代码	基金名称	持仓数量(份)	市值(元)	市值占委托资产净值比例(%)
009015	泓德睿享一年持有期混合 A	24,682,409.08	29,001,830.67	98.57

（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

项目	交易所市场	银行间市场
从事正回购交易而形成的卖出回购证券款余额（元）	-	-

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
桑柳玉	上海财经大学经济学硕士	10 年	上海东方证券资产管理有限公司投资经理，上海财经大学经济学硕士，证券从业 10 年，曾任海通证券研究所研究员、凯石财富研究部首席分析师、凯石基金管理有限公司 FOF 投资部负责人。

(二) 投资策略回顾与展望

二季度市场在外部因素冲击下呈现震荡模式，以俄乌危机为核心的地缘政治冲突成为市场主线，俄罗斯和乌克兰作为全球能源和农业大国，其冲突引发大宗商品价格快速上行。同时，美联储加息脚步逼近、中概股暴跌及国内疫情多地散发等多重因素叠加的影响，悲观情绪蔓延，市场出现非理性下杀。组合结构上维持了偏防御的思路，由于打新收益逐步负贡献，因此清仓了底仓股票，仅保留了量少偏稳健的偏债混合基金。

(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4月1日至2022年6 月30日	上季度可比期间 2022年1月1日至2022 年3月31日
当期发生的资产管理计划应支付的管理费	89,908.67	362,116.87

注：管理费计提基准：按前一日计划资产净值扣除所持有本计划管理人管理的公开募集证券投资基金的基金份额的资产净值后的余额（若为负数，则取0）；费率：0.2%/年；计提方式：每日计提；支付方式：每季度支付。

（二）资产管理计划托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年4月1日至2022年6 月30日	上季度可比期间 2022年1月1日至2022 年3月31日
当期发生的资产管理计划应支付的托管费	9,671.02	39,831.54

注：托管费计提基准：按前一日计划资产净值；费率：0.02%/年；计提方式：每日计提；支付方式：每季度支付。

（三）业绩报酬

单位：人民币元

项目	本期 2022年4月1日至2022年6 月30日	上季度可比期间 2022年1月1日至2022 年3月31日
当期计提的业绩报酬	-	-

注：业绩报酬计提基准： r_i 为第 i 个运作期内集合计划的年化业绩报酬计提基准（每年按365天计），首个运作期的 r_1 为6%，管理人将在每个运作期开始前至少提前1个工作日公布下一个运作期的年化业绩报酬计提基准 r_i ，管理人未公布的，则 $r_i=r_{i-1}$ 。每笔份额的绝对业绩报酬计提基准 R_x 为自其上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日起至本次业绩报酬计提日期间不同运作期 r_i 换算的绝对业绩报酬计提基准的加总；计提方式：区间绝对收

益率 R 大于 Rx 的部分计提 10%；支付方式：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 4 月 1 日至 2022 年 6 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	50~100

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 07 月 29 日