

东方红建信 2 号集合资产管理计划托管报告 (2020 年)

根据上海东方证券资产管理有限公司（资产管理人）、中国建设银行股份有限公司深圳市分行（资产托管人）签订的《东方红建信 1 号集合资产管理计划资产管理合同》，本托管人以诚实信用、勤勉尽责的原则认真办理资产管理计划资金托管事项，履行托管人职责。现根据管理合同，出具 2020 年年度托管人报告。

在本报告期间，本托管人及时准确地执行了管理人的投资和清算指令，办理了资产管理计划名下的资金往来。

在本报告期间，本托管人对管理人的投资运作行为按管理合同约定进行了监督。

在本报告期间，本托管人对报告期内资产净值的计算、费用开支方面进行了复核，未发现管理人存在损害本计划利益的行为。

本托管人复核了本计划 2020 年年度报告中的有关财务数据部分，内容真实、准确和完整。

附件：

1. 《资产负债表》（2020 年 12 月 31 日）
2. 《利润表》（2020 年）

中国建设银行深圳市分行资产托管业务部

2021 年 03 月 03 日

资产负债表

东方红建信2号集合资产管理计划

2020-12-31

资产	年初余额	期末余额	负债及所有者权益	年初余额	期末余额
资产：			负债：		
银行存款	-	716,250.06	短期借款	-	-
结算备付金	-	177,910,444.03	交易性金融负债	-	-
存出保证金	-	328,595.37	衍生金融负债	-	-
股票投资	-	291,104,115.78	卖出回购金融资产款	-	1,530,000,000.00
债券投资	-	3,684,487,919.20	应付证券清算款	-	562,015.82
资产支持证券投资	-	-	应付赎回款	-	-
基金投资	-	-	应付管理人报酬	-	1,525,405.48
商业银行理财产品	-	-	应付托管费	-	211,966.75
信托产品	-	-	应付受托费	-	-
基础设施债权投资计划	-	-	应付交易费用	-	292,034.86
特定资产管理计划	-	-	应交税费	-	2,215,460.13
养老金产品	-	-	应付利息	-	-395,693.94
保险资产	-	-	应付利润	-	-
其他投资	-	-	其他负债	-	60,000.00
衍生金融资产	-	-	负债合计	-	1,534,471,189.10
买入返售金融资产	-	10,847,487.71	所有者权益：		
应收证券清算款	-	72,142,021.26	实收基金	-	2,513,565,318.22
应收利息	-	-	未分配利润	-	189,500,326.09
应收股利	-	-	所有者权益合计	-	2,703,065,644.31
应收申购款	-	-			
其他资产	-	-			
资产总计：	-	4,237,536,833.41	负债和所有者权益总计：	-	4,237,536,833.41

报表

复核：

利润表

东方红建信2号集合资产管理计划

2020-12-31

项 目	累计金额
一、收入	286,223,598.15
1、利息收入	143,517,771.00
其中：存款利息收入	1,979,892.26
债券利息收入	142,680,520.68
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	2,593,245.67
商业银行理财产品利息收入	-
信托产品利息收入	-
基础设施债权投资计划利息收入	-
特定资产管理计划利息收入	-
其他利息收入	-3,735,887.61
2、投资收益（损失以“-”号填列）	99,991,789.39
其中：股票投资收益	77,455,855.39
债券投资收益	-6,852,427.50
资产支持证券投资收益	-
衍生工具收益	-
股指期货投资收益	-248,430.00
商品期货投资收益	-
股利收益	10,874,449.54
基金投资收益	20,810,221.00
商业银行理财产品投资收益	-
信托产品投资收益	-
基础设施债权投资计划投资收益	-
特定资产管理计划投资收益	-
养老金产品投资收益	-
保险资产投资收益	-
其他投资收益	-2,047,879.04
3、公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	42,714,037.76
4、其他收入（损失以“-”号填列）	-
二、费用	33,822,292.49
1、管理人报酬	9,832,460.46
2、托管费	743,675.44
3、销售服务费	-
4、交易费用	2,932,032.57
5、利息支出	19,405,250.68
其中：卖出回购金融资产支出	19,405,250.68
6、其他费用	61,050.80
7、税金	847,822.54
三、利润总额	252,401,305.66

制表：

复核：