

东方红合盈 4 号集合资产管理计划周报

报告期末：2021 年 4 月 23 日

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：中国农业银行股份有限公司

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。

本报告中数据未经审计。

一、基本信息

资产管理计划名称:	东方红合盈4号集合资产管理计划
合同生效时间:	2020年4月21日
管理人:	上海东方证券资产管理有限公司
托管人:	中国农业银行股份有限公司

二、投资组合情况

序号	资产类别	期末市值(元)	占期末总资产的比例(%)
1	股票	114,280,161.00	14.53
2	债券	637,526,402.00	81.07
3	其中: 转债	1,190,440.40	0.15
4	银行存款及清算备付金合计	14,600,318.74	1.86
5	买入反售金融资产	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	定期存款	-	-
8	其他资产	19,983,787.61	2.54
9	资产总值	786,390,669.35	100.00

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股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	资产净值占比(%)
1	688390	固德威	34,540	7,546,990.00	1.03
2	601689	拓普集团	171,000	6,232,950.00	0.85
3	002179	中航光电	78,800	5,894,240.00	0.80
4	00916	龙源电力	528,000	5,290,560.00	0.72
5	00981	中芯国际	240,000	5,160,000.00	0.70

注: A+H股按照不同股票分别披露,并按各自的市值分别计算公允价值参与排序。

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债券明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	资产净值占比(%)
1	200016	20付息国债16	400,000	40,340,000.00	5.50

2	019649	21 国债 01	340,000	34,006,800.00	4.64
3	112882	19 魏桥 01	333,000	33,210,090.00	4.53
4	102001813	20 金融街 MTN001B	300,000	30,318,000.00	4.13
5	101800880	18 鲁宏桥 MTN007	300,000	30,021,000.00	4.09
6	012004246	20 威高 SCP003	300,000	29,937,000.00	4.08
7	155333	19 西股 01	300,000	29,871,000.00	4.07
8	108604	国开 1805	296,160	29,767,041.60	4.06
9	163377	20 融创 02	300,000	29,253,000.00	3.99
10	149235	20 碧水 G1	220,000	21,868,000.00	2.98

上海东方证券资产管理有限公司
2021 年 4 月 28 日