
东方红添裕 4 号集合资产管理计划周报

报告期末：2021 年 5 月 21 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：中国工商银行股份有限公司北京市分行

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：	东方红添裕4号集合资产管理计划
合同生效时间：	2019年4月16日
管理人：	上海东方证券资产管理有限公司
托管人：	中国工商银行股份有限公司北京市分行

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四十名股票明细

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	300769	德方纳米	32,500	5,784,025.00	1.15
2	300724	捷佳伟创	49,800	4,794,246.00	0.95
3	300014	亿纬锂能	45,700	4,602,904.00	0.91
4	600584	长电科技	137,800	4,388,930.00	0.87
5	300122	智飞生物	21,900	4,337,295.00	0.86
6	002179	中航光电	60,000	4,322,400.00	0.86
7	601012	隆基股份	41,600	4,100,512.00	0.81
8	603986	DR 兆易创	31,920	3,887,856.00	0.77
9	600110	诺德股份	519,300	3,827,241.00	0.76
10	601689	拓普集团	109,000	3,420,420.00	0.68
11	300059	东方财富	99,100	3,417,959.00	0.68
12	002007	华兰生物	78,900	3,044,751.00	0.60
13	00175	吉利汽车	185,000	2,942,263.68	0.58
14	01810	小米集团 — W	127,400	2,896,812.66	0.57
15	600406	国电南瑞	98,700	2,866,248.00	0.57
16	002129	中环股份	102,900	2,835,924.00	0.56
17	300274	阳光电源	30,700	2,737,212.00	0.54
18	002459	晶澳科技	88,900	2,691,892.00	0.53
19	600516	方大炭素	309,600	2,634,696.00	0.52
20	600703	三安光电	105,700	2,518,831.00	0.50
21	300373	扬杰科技	60,900	2,436,609.00	0.48
22	03898	中车时代 电气	79,300	2,417,294.93	0.48

23	02020	安踏体育	17,000	2,092,552.51	0.41
24	00981	中芯国际	106,000	1,966,810.50	0.39
25	000830	鲁西化工	126,200	1,905,620.00	0.38
26	000998	隆平高科	107,700	1,840,593.00	0.36

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四十名债券明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	百元成本价格(元)	买入成本收益率(%)	公允价值(元)	资产净值占比(%)
1	112104027	21 中国银行 CD027	1,000,000	97.13	-	97,190,000.00	19.25
2	163376	20 融创 01	400,000	98.66	5.28	39,592,000.00	7.84
3	143580	18 穗发 01	300,000	100.91	3.27	30,351,000.00	6.01
4	163848	20 红狮 S1	300,000	100.60	3.27	30,189,000.00	5.98
5	136101	15 合景 01	266,000	99.44	7.70	26,405,820.00	5.23
6	149087	20 荣盛 G1	250,000	100.73	4.50	25,177,500.00	4.99
7	112427	16 滨房 01	200,000	100.45	3.49	20,080,000.00	3.98
8	143849	S18 红狮 2	200,000	100.33	3.14	20,070,000.00	3.97
9	135693	16 合景 02	200,000	100.16	5.98	20,032,200.00	3.97
10	101800847	18 威高 MTN001	200,000	100.29	5.49	20,016,000.00	3.96
11	155333	19 西股 01	200,000	99.57	5.95	19,942,000.00	3.95
12	112457	16 魏桥 05	153,860	97.08	5.21	15,324,456.00	3.03
13	136753	16 大华 02	100,000	100.14	5.53	10,056,000.00	1.99
14	136690	16 恒安 01	60,000	99.82	3.59	6,001,800.00	1.19
15	132015	18 中油 EB	50,000	99.91	-	5,103,000.00	1.01
16	149235	20 碧水 G1	50,000	99.07	5.78	4,980,000.00	0.99
17	136624	16 融创 07	47,000	98.80	4.51	4,688,720.00	0.93
18	136750	16 荣盛 01	40,000	100.80	4.35	4,032,000.00	0.80
19	143027	17 荣盛 01	37,270	100.45	4.80	3,774,332.90	0.75
20	124781	PR 渝江 02	100,000	20.23	3.57	2,020,000.00	0.40
21	132009	17 中油 EB	16,150	100.54	-	1,656,990.00	0.33
22	113621	彤程转债	13,000	116.13	-	1,502,150.00	0.30
23	127030	盛虹转债	10,000	129.80	-	1,399,700.00	0.28
24	123090	三诺转债	10,004	119.08	-	1,164,265.52	0.23
25	113622	杭叉转债	5,000	115.37	-	587,450.00	0.12
26	113603	东缆转债	4,000	112.43	-	453,760.00	0.09
27	128021	兄弟转债	4,000	119.37	-	424,720.00	0.08
28	110079	杭银转债	390	100.00	-	45,719.70	0.01

上海东方证券资产管理有限公司
2021 年 5 月 25 日