

# 东方红添裕4号集合资产管理计划周报

报告期末：2024年3月22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04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	002179	中航光电	35,410	1,306,629.00	1.13
2	000682	东方电子	119,400	1,122,360.00	0.97
3	600131	国网信通	49,200	979,080.00	0.85
4	000811	冰轮环境	65,700	833,076.00	0.72
5	000063	中兴通讯	27,300	761,124.00	0.66
6	600879	航天电子	104,200	757,534.00	0.66
7	002920	德赛西威	6,700	747,519.00	0.65
8	300604	长川科技	21,200	731,400.00	0.64
9	300666	江丰电子	14,500	714,850.00	0.62
10	300286	安科瑞	31,900	712,965.00	0.62
11	600765	中航重机	43,800	706,494.00	0.61
12	600487	亨通光电	52,000	684,320.00	0.59
13	002465	海格通信	61,500	673,425.00	0.58
14	002594	比亚迪	2,800	607,460.00	0.53
15	603197	保隆科技	12,300	605,652.00	0.53
16	300036	超图软件	32,300	593,351.00	0.52
17	300627	华测导航	23,100	587,895.00	0.51
18	603596	伯特利	9,900	578,754.00	0.50
19	300687	赛意信息	28,300	549,020.00	0.48
20	300748	金力永磁	34,500	548,550.00	0.48
21	300395	菲利华	17,300	535,435.00	0.46
22	603191	望变电气	29,900	535,210.00	0.46
23	002050	三花智控	21,700	532,518.00	0.46
24	300634	彩讯股份	24,300	518,805.00	0.45
25	002025	航天电器	11,800	490,762.00	0.43
26	000938	紫光股份	20,100	458,883.00	0.40
27	600183	生益科技	24,800	451,112.00	0.39
28	600456	宝钛股份	15,700	436,303.00	0.38
29	600893	航发动力	9,900	341,550.00	0.30
30	600862	中航高科	15,500	328,600.00	0.29

31	300360	炬华科技	19,700	324,065.00	0.28
32	600760	中航沈飞	8,100	303,183.00	0.26
33	300034	钢研高纳	14,500	236,205.00	0.21
34	002908	德生科技	3,260	34,067.00	0.03
35	300525	博思软件	1,900	27,018.00	0.02

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	188374	21浦集02	200,000	101.45	2.40	20,480,646.58	17.78
2	149485	21光大Y2	100,000	102.14	3.20	10,611,739.73	9.21
3	2028024	20中信银行二级	100,000	101.97	2.95	10,425,737.70	9.05
4	2128025	21建设银行二级01	100,000	101.09	3.09	10,424,032.79	9.05
5	230026	23付息国债26	100,000	101.49	2.50	10,378,288.46	9.01
6	102100639	21相城城建 MTN002	100,000	100.15	2.39	10,370,303.28	9.00
7	102100683	21吴中经发 MTN001	100,000	100.17	2.38	10,363,183.06	9.00
8	188808	21沪盛02	100,000	99.42	3.26	10,180,068.49	8.84
9	230202	23国开02	100,000	100.79	2.15	10,131,950.82	8.80
10	2028006	20邮储银行永续债	100,000	101.30	2.96	10,127,054.79	8.79
11	113052	兴业转债	50,000	103.99	-	5,217,280.82	4.53
12	019728	23国债25	32,000	100.75	2.10	3,252,740.38	2.82
13	019723	23国债20	20,000	100.27	2.03	2,029,574.25	1.76

上海东方证券资产管理有限公司

2024年03月26日