

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29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	32,110	1,104,905.10	0.97
2	000682	东方电子	100,200	913,824.00	0.80
3	600131	国网信通	39,400	742,690.00	0.65
4	600765	中航重机	43,800	673,206.00	0.59
5	000811	冰轮环境	52,600	623,310.00	0.54
6	000063	中兴通讯	21,900	612,981.00	0.54
7	600879	航天电子	83,400	595,476.00	0.52
8	300604	长川科技	17,000	571,200.00	0.50
9	300286	安科瑞	25,600	561,920.00	0.49
10	603596	伯特利	9,900	552,420.00	0.48
11	002465	海格通信	49,200	548,580.00	0.48
12	300627	华测导航	18,500	520,220.00	0.45
13	300666	江丰电子	11,600	517,592.00	0.45
14	600487	亨通光电	41,600	513,760.00	0.45
15	002920	德赛西威	4,000	498,040.00	0.44
16	300036	超图软件	25,900	481,740.00	0.42
17	002594	比亚迪	2,300	467,038.00	0.41
18	603197	保隆科技	9,900	451,044.00	0.39
19	300748	金力永磁	27,600	424,488.00	0.37
20	300687	赛意信息	22,700	417,680.00	0.36
21	002050	三花智控	17,400	412,902.00	0.36
22	300395	菲利华	13,900	411,440.00	0.36
23	300634	彩讯股份	19,500	365,430.00	0.32
24	002025	航天电器	9,500	359,670.00	0.31
25	000938	紫光股份	16,100	349,531.00	0.31
26	600456	宝钛股份	12,600	348,138.00	0.30
27	600183	生益科技	19,900	342,877.00	0.30
28	600893	航发动力	8,000	271,680.00	0.24
29	300360	炬华科技	15,800	262,596.00	0.23
30	600862	中航高科	12,400	242,544.00	0.21

31	600760	中航沈飞	6,500	236,535.00	0.21
32	300034	钢研高纳	11,600	177,480.00	0.16
33	002908	德生科技	2,660	28,196.00	0.02
34	300525	博思软件	1,600	20,944.00	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	20,484,843.84	17.89
2	149485	21光大Y2	100,000	102.14	3.20	10,612,315.07	9.27
3	2128025	21建设银行二级01	100,000	101.09	3.09	10,438,631.15	9.12
4	2028024	20中信银行二级	100,000	101.97	2.95	10,437,139.34	9.12
5	102100639	21相城城建 MTN002	100,000	100.15	2.39	10,374,590.16	9.06
6	102100683	21吴中经发 MTN001	100,000	100.17	2.38	10,368,431.69	9.06
7	2028006	20邮储银行永续债	100,000	101.30	2.96	10,134,131.51	8.85
8	019728	23国债25	32,000	100.75	2.10	3,257,407.12	2.85
9	019723	23国债20	20,000	100.27	2.03	2,032,625.75	1.78

上海东方证券资产管理有限公司
2024年04月02日