东方红合盈6号集合资产管理计划周报

报告期末：2022年9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6号集合资产管理计划
合同生效时间：	2020年08月06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	81,572,951.22	10.71
2	债券	561,472,118.46	73.74
3	其中：转债	37,072,879.70	4.87
4	银行存款及清算备付金合计	13,832,717.74	1.82
5	买入返售金融资产	0.00	0.00
6	资产支持证券	0.00	0.00
7	定期存款	0.00	0.00
8	其他资产	104,491,989.43	13.72
9	资产总值	761,369,776.85	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	03898	时代电气	137,400	4,388,556.00	0.80
2	601208	东材科技	387,900	4,266,900.00	0.78
3	000811	冰轮环境	309,400	3,493,126.00	0.63
4	600276	恒瑞医药	96,800	3,187,624.00	0.58
5	600219	南山铝业	923,900	3,048,870.00	0.55

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

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	163763	20信投G5	400,000	40,711,923.29	7.40
2	149689	21国际P1	300,000	31,411,356.17	5.71
3	102280173	22盐田港MTN001	300,000	30,796,290.41	5.60
4	102280755	22沪电力MTN001	300,000	30,619,208.22	5.57
5	137654	22招证G4	300,000	30,192,665.75	5.49
6	102281635	22苏国信MTN004	300,000	30,179,712.33	5.49
7	137587	22西城01	300,000	30,150,953.42	5.48
8	112109296	21浦发银行CD296	300,000	29,911,826.71	5.44
9	019666	22国债01	282,000	28,654,406.30	5.21
10	210212	21国开12	250,000	25,587,157.53	4.65

上海东方证券资产管理有限公司

2022年09月28日