

东方红添裕 5 号集合资产管理计划周报

报告期末：2021 年 2 月 26 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5号集合资产管理计划
合同生效时间:	2019年6月11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	600176	中国巨石	27,700	621,865.00	1.62
2	002385	大北农	58,100	580,419.00	1.51
3	00868	信义玻璃	22,000	398,385.53	1.04
4	601636	旗滨集团	26,500	390,875.00	1.02
5	601919	中远海控	28,100	355,184.00	0.93
6	002459	晶澳科技	10,600	352,874.00	0.92
7	600703	三安光电	11,700	350,298.00	0.91
8	600216	浙江医药	23,400	347,256.00	0.90
9	00981	中芯国际	16,500	344,915.58	0.90
10	601615	明阳智能	16,800	344,568.00	0.90
11	00941	中国移动	7,500	336,090.85	0.88
12	002179	中航光电	4,600	316,618.00	0.83
13	603260	合盛硅业	6,500	302,900.00	0.79
14	002008	大族激光	7,000	301,770.00	0.79
15	600456	宝钛股份	6,000	264,420.00	0.69
16	300347	泰格医药	1,700	238,986.00	0.62
17	000807	云铝股份	23,900	228,245.00	0.59
18	300122	智飞生物	1,300	226,824.00	0.59
19	002080	中材科技	9,900	225,522.00	0.59
20	01810	小米集团 -W	9,000	190,013.37	0.50
21	01072	东方电气	23,600	135,494.47	0.35

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。

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	132009	17 中油 EB	50,000	100.39	-	5,079,500.00	13.24
2	132015	18 中油 EB	43,000	99.90	-	4,328,380.00	11.28
3	155304	19 禹洲 01	31,190	100.22	6.40	3,123,054.70	8.14
4	112660	18 恒逸 01	31,000	100.05	5.26	3,099,380.00	8.08
5	112681	18 恒逸 02	30,760	99.57	5.90	3,070,770.80	8.00
6	112457	16 魏桥 05	32,020	92.67	7.06	3,050,545.40	7.95
7	112653	18 恒逸 R1	30,000	100.39	5.00	2,999,700.00	7.82
8	136624	16 融创 07	25,100	98.80	4.51	2,479,880.00	6.46
9	136264	16 隆基 01	15,000	100.34	4.03	1,500,750.00	3.91
10	136750	16 荣盛 01	14,000	101.30	4.37	1,409,380.00	3.67
11	124558	14 宏桥 01	13,020	100.00	8.09	1,299,916.80	3.39
12	110059	浦发转债	8,000	106.56	-	812,640.00	2.12
13	110048	福能转债	6,000	114.61	-	665,940.00	1.74
14	113603	东缆转债	5,000	120.47	-	584,850.00	1.52
15	112343	16 魏桥 01	5,420	98.46	8.00	541,837.40	1.41
16	128021	兄弟转债	1,000	119.06	-	110,450.00	0.29

上海东方证券资产管理有限公司
2021年3月2日