东方红合盈 5 号集合资产管理计划周报

报告期末：2021 年 4 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 5 号集合资产管理计划
合同生效时间：	2020 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	41,082,470.00	13.49
2	债券	234,657,885.50	77.04
3	其中：转债	2,215,665.50	0.73
4	银行存款及清算备付金合计	21,600,167.60	7.09
5	买入反售金融资产	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	定期存款	-	-
8	其他资产	7,257,441.83	2.38
9	资产总值	304,597,964.93	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	00916	龙源电力	258,000	2,585,160.00	0.85
2	00175	吉利汽车	139,000	2,581,230.00	0.85
3	600584	长电科技	64,000	2,360,320.00	0.78
4	601689	拓普集团	63,600	2,318,220.00	0.76
5	002179	中航光电	27,600	2,064,480.00	0.68

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。

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	200016	20 附息国债 16	200,000	20,170,000.00	6.63
2	163774	20 中证 15	200,000	20,110,000.00	6.61

3	012002990	20 恒逸 SCP005	200,000	19,982,000.00	6.56
4	019640	20 国债 10	125,000	12,502,500.00	4.11
5	101801044	18 双流兴城 MTN001	100,000	10,396,000.00	3.42
6	112882	19 魏桥 01	104,000	10,371,920.00	3.41
7	163756	20 国君 G4	100,000	10,069,000.00	3.31
8	031800399	18 昆山高新 PPN002	100,000	10,067,000.00	3.31
9	012100012	21 荣盛 SCP001	100,000	10,027,000.00	3.29
10	012101446	21 华润 SCP002	100,000	9,997,000.00	3.28

上海东方证券资产管理有限公司
2021 年 4 月 28 日