

东方红添裕 5 号集合资产管理计划周报

报告期末：2021 年 4 月 30 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	300373	扬杰科技	18,700	835,516.00	2.15
2	300763	锦浪科技	2,200	453,002.00	1.16
3	002179	中航光电	6,400	436,352.00	1.12
4	002008	大族激光	10,600	425,802.00	1.09
5	600406	国电南瑞	13,000	415,740.00	1.07
6	603986	兆易创新	2,100	405,783.00	1.04
7	300769	德方纳米	2,800	403,480.00	1.04
8	600584	长电科技	10,700	393,760.00	1.01
9	600516	方大炭素	43,400	385,826.00	0.99
10	00981	中芯国际	16,500	344,324.52	0.89
11	300558	贝达药业	2,800	299,600.00	0.77
12	600703	三安光电	11,700	293,670.00	0.76
13	300724	捷佳伟创	2,500	276,150.00	0.71
14	000538	云南白药	2,500	268,875.00	0.69
15	600745	闻泰科技	2,900	247,370.00	0.64
16	000830	鲁西化工	15,100	232,238.00	0.60
17	600456	宝钛股份	6,000	221,220.00	0.57
18	600486	扬农化工	1,900	212,838.00	0.55
19	01810	小米集团 — W	9,000	184,439.48	0.47

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	019649	21 国债 01	55,000	99.89	2.55	5,506,600.00	14.16
2	136690	16 恒安 01	40,000	99.82	3.59	3,999,200.00	10.28
3	112457	16 魏桥 05	32,020	92.67	7.06	3,177,985.00	8.17
4	143027	17 荣盛 01	30,000	101.01	4.19	3,037,200.00	7.81
5	149087	20 荣盛 G1	30,000	100.43	4.61	3,018,300.00	7.76
6	112427	16 滨房 01	30,000	100.60	3.73	3,013,500.00	7.75
7	136624	16 融创 07	30,000	98.83	4.50	2,988,300.00	7.68
8	149235	20 碧水 G1	30,000	99.07	5.78	2,984,100.00	7.67
9	163376	20 融创 01	30,000	96.81	5.94	2,962,800.00	7.62
10	124915	14 宏桥 02	30,000	98.48	10.40	2,955,300.00	7.60
11	132015	18 中油 EB	20,000	99.90	-	2,035,600.00	5.23
12	136417	16 万达 02	20,000	99.70	7.47	1,999,200.00	5.14
13	136750	16 荣盛 01	18,000	101.19	4.27	1,815,300.00	4.67
14	110059	浦发转债	13,500	104.64	-	1,379,565.00	3.55
15	113042	上银转债	9,890	101.02	-	1,006,307.50	2.59
16	136633	16 融创 06	7,050	100.09	5.98	706,762.50	1.82
17	113603	东缆转债	5,000	120.47	-	586,950.00	1.51
18	128021	兄弟转债	1,000	119.06	-	104,450.00	0.27
19	110079	杭银转债	190	100.00	-	21,962.10	0.06

上海东方证券资产管理有限公司
2021 年 5 月 7 日