

东方红合盈 1 号集合资产管理计划周报

报告期末：2021 年 5 月 14 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1号集合资产管理计划
合同生效时间:	2020年3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	81,753,974.07	16.58
2	债券	384,103,069.60	77.91
3	其中: 转债	973,562.00	0.20
4	银行存款及清算备付金合计	17,482,203.83	3.55
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	9,688,155.27	1.97
9	资产总值	493,027,402.77	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	300122	智飞生物	22,900	4,946,400.00	1.03
2	600584	长电科技	134,400	4,691,904.00	0.97
3	688396	华润微	75,243	4,508,560.56	0.94
4	688390	固德威	18,849	4,335,081.51	0.90
5	002179	中航光电	59,100	4,148,820.00	0.86

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	019640	20 国债 10	475,000	47,519,000.00	9.86
2	019645	20 国债 15	470,000	47,178,600.00	9.79
3	163307	20 南钢 01	450,000	44,833,500.00	9.3
4	143005	17 长发 01	300,000	29,976,000.00	6.22
5	112827	18 卓越 06	300,000	29,928,000.00	6.21
6	151990	19 大华 01	250,000	25,163,000.00	5.22
7	108604	国开 1805	230,000	23,108,100.00	4.8
8	163756	20 国君 G4	200,000	20,164,000.00	4.18
9	012101655	21 京国资 SCP003	200,000	20,006,000.00	4.15
10	149350	21 融创 01	200,000	19,942,000.00	4.14

上海东方证券资产管理有限公司
2021 年 5 月 19 日