

东方红合盈 6 号集合资产管理计划周报

报告期末：2021 年 5 月 21 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 8 月 6 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	109,864,684.26	12.85
2	债券	696,591,142.00	81.49
3	其中：转债	18,272,416.50	2.14
4	银行存款及清算备付金合计	20,541,877.21	2.40
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	27,842,212.01	3.26
9	资产总值	854,839,915.48	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	688390	固德威	22,794	6,108,792.00	0.94
2	300769	德方纳米	33,100	5,890,807.00	0.90
3	300014	亿纬锂能	56,700	5,710,824.00	0.88
4	600584	长电科技	174,700	5,564,195.00	0.85
5	002179	中航光电	74,700	5,381,388.00	0.83

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	210203	21 国开 03	500,000	50,225,000.00	7.71
2	102001470	20 蓉城轨 交 MTN005	400,000	40,564,000.00	6.22
3	163763	20 信投 G5	400,000	40,284,000.00	6.18
4	200010	20 付息国 债 10	400,000	40,020,000.00	6.14
5	112457	16 魏桥 05	310,000	30,876,000.00	4.74
6	112882	19 魏桥 01	309,030	30,856,645.50	4.73
7	102001703	20 洪市政 MTN003	300,000	30,333,000.00	4.65
8	112768	18 新化 03	300,000	30,072,000.00	4.61
9	012003305	20 红狮 SCP006	300,000	30,003,000.00	4.60
10	019640	20 国债 10	210,000	21,008,400.00	3.22

上海东方证券资产管理有限公司
2021 年 5 月 26 日