

东方红合盈5号集合资产管理计划周报

报告期末：2023年9月28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04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	0.00	0.00
2	债券	270,199,349.52	79.38
3	其中：转债	0.00	0.00
4	银行存款及清算备付金合计	15,125,972.50	4.44
5	买入返售金融资产	50,856,057.55	14.94
6	资产支持证券	0.00	0.00
7	定期存款	0.00	0.00
8	其他资产	4,213,430.24	1.24
9	资产总值	340,394,809.81	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

注：本资产管理计划本报告期末未持有股票。

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	019709	23国债16	307,000	30,671,865.34	9.21
2	112311077	23平安银行CD077	300,000	29,517,230.00	8.86
3	112205163	22建设银行CD163	250,000	24,966,957.81	7.50
4	112457	16魏桥05	200,000	20,918,657.53	6.28
5	149757	21铁隧Y1	200,000	20,519,068.49	6.16
6	152461	20厦轨01	200,000	20,445,967.12	6.14
7	112210298	22兴业银行CD298	200,000	19,980,341.04	6.00
8	112204039	22中国银行CD039	200,000	19,974,645.92	6.00
9	112306012	23交通银行CD012	200,000	19,866,900.60	5.96
10	019688	22国债23	184,000	18,681,711.56	5.61

上海东方证券资产管理有限公司
2023年10月11日