

东方红添裕5号集合资产管理计划周报

报告期末：2024年5月24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06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	002179	中航光电	34,700	1,222,481.00	1.21
2	000682	东方电子	107,300	1,203,906.00	1.19
3	600765	中航重机	53,400	988,434.00	0.98
4	300286	安科瑞	37,400	916,300.00	0.90
5	600879	航天电子	109,900	811,062.00	0.80
6	600487	亨通光电	54,500	804,965.00	0.79
7	000400	许继电气	27,400	779,804.00	0.77
8	600131	国网信通	44,100	771,750.00	0.76
9	300395	菲利华	21,900	655,029.00	0.65
10	002025	航天电器	13,200	584,364.00	0.58
11	002050	三花智控	27,000	575,910.00	0.57
12	300360	炬华科技	37,100	554,645.00	0.55
13	300604	长川科技	19,200	546,432.00	0.54
14	002920	德赛西威	5,300	527,774.00	0.52
15	000938	紫光股份	23,000	515,890.00	0.51
16	000063	中兴通讯	19,200	514,560.00	0.51
17	603606	东方电缆	11,300	513,924.00	0.51
18	000811	冰轮环境	44,000	487,520.00	0.48
19	300666	江丰电子	10,700	478,397.00	0.47
20	300036	超图软件	32,600	457,704.00	0.45
21	603596	伯特利	12,600	446,040.00	0.44
22	603197	保隆科技	10,800	431,568.00	0.43
23	300748	金力永磁	30,300	427,836.00	0.42
24	300627	华测导航	14,800	418,692.00	0.41
25	600456	宝钛股份	15,300	415,854.00	0.41
26	600312	平高电气	28,900	415,582.00	0.41
27	601669	中国电建	76,600	410,576.00	0.41
28	600862	中航高科	21,000	410,550.00	0.40
29	300634	彩讯股份	21,600	380,160.00	0.38
30	601390	中国中铁	55,100	369,721.00	0.36

31	300687	赛意信息	20,100	314,163.00	0.31
32	601800	中国交建	31,600	281,240.00	0.28
33	002230	科大讯飞	6,700	280,060.00	0.28
34	300034	钢研高纳	16,200	272,160.00	0.27
35	600760	中航沈飞	4,800	184,848.00	0.18
36	01801	信达生物	4,500	147,088.04	0.15
37	002908	德生科技	4,400	37,092.00	0.04

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	2128033	21建设银行二级03	100,000	102.30	2.73	10,513,754.10	10.37
2	2028024	20中信银行二级	100,000	101.97	2.95	10,508,352.46	10.37
3	1928013	19民生银行永续债	100,000	100.29	2.17	10,480,748.63	10.34
4	2028017	20农业银行永续债 01	100,000	101.25	2.78	10,138,394.52	10.00
5	113053	隆22转债	31,520	118.75	-	3,244,569.49	3.20
6	110081	闻泰转债	30,000	113.89	-	3,102,221.92	3.06
7	127045	牧原转债	12,000	126.83	-	1,467,576.99	1.45
8	019725	23国债22	2,000	101.65	2.16	206,861.92	0.20

上海东方证券资产管理有限公司
2024年05月28日