

东方红添裕5号集合资产管理计划月报

报告期：2024年5月1日至2024年5月31日

报告披露时间：2024年6月5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。

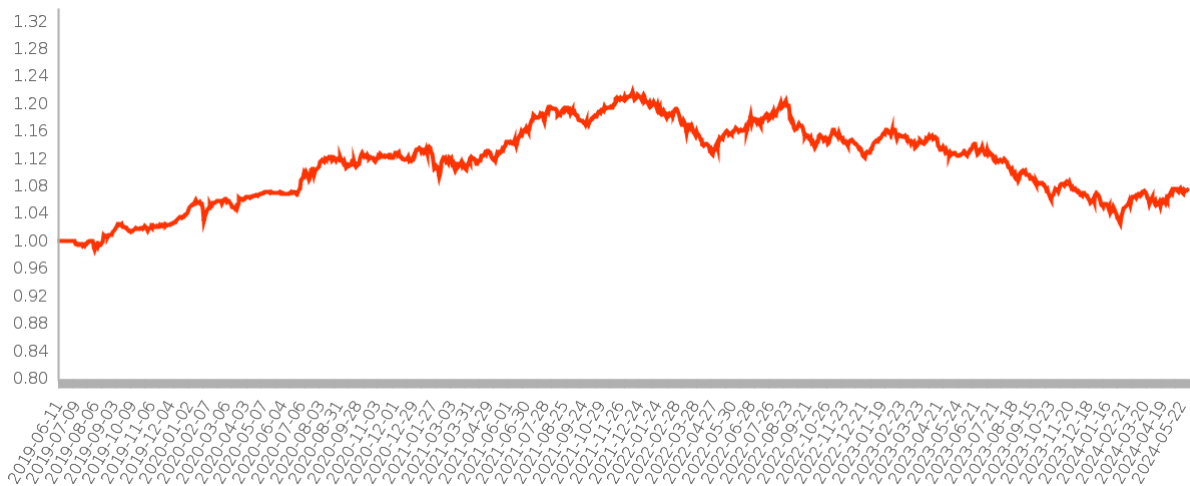
本资产管理计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本资产管理计划合同及说明书。

本报告中数据未经审计。

一、基本信息

成立日期：	2019-06-11
本运作周期起始日：	2022-06-13
报告期末单位净值：	0.9617
报告期末累计单位净值：	1.0817

二、产品自成立以来复权单位净值走势



三、产品区间累计收益率及与混合债券型二级基金指数收益率比较

	报告期内累计收益率	今年以来累计收益率	成立以来累计收益率	成立以来年化收益率	本运作周期以来累计收益率
本产品	0.70%	0.32%	7.44%	1.45%	-7.53%
混合债券型二级基金指数	0.44%	1.92%	22.07%	4.09%	0.73%

注：年化收益率按照365天年化，数据截至报告期末。成立不到一年的产品，收益率不做年化处理。

四、产品综合指标

指标名称	今年以来	成立以来
最大回撤	4.26%	15.79%
夏普比率	-	0.02

注：夏普比率=(日均收益率-日均无风险收益率)/日收益率标准差*(250^{0.5})。日均收益率为区间内产品日收益率平均数；日均无风险收益率=(1+年无风险收益率)^(1/250)-1，年无风险收益率取1.5%，数据截至报告期末。成立不到一年的产品，不计算夏普比率。

五、报告期末资产组合情况

市场	品种	市值(万元)	占资产净值比(%)
交易所	利率债	20.71	0.20
	信用债	0.00	0.00
	可转债	0.00	0.00
银行间	利率债	0.00	0.00
	信用债	4,166.55	40.91
	可转债	0.00	0.00
小计		4,187.25	41.11
股票投资		1,997.67	19.61
现金及等价物(含货基、存款、逆回购)		3,153.94	30.97

合计	9,338.87	91.69
----	----------	-------

六、报告期末债券久期分布

久期分布（按行权久期）	期限	市值（万元）	占资产净值比（%）
	0-1年（含1年）	2,062.71	20.25
	1-3年（含3年）	2,103.84	20.66
	3-5年（含5年）	20.71	0.20
	5-7年（含7年）	0.00	0.00
	7年以上	0.00	0.00
	合计	4,187.25	41.11

七、报告期末债券评级分布

债项评级分布	评级	市值（万元）	占资产净值比（%）
	AAA	4,166.55	40.91
	AA+	0.00	0.00
	AA	0.00	0.00
	AA-	0.00	0.00
	A-1	0.00	0.00
	利率债	20.71	0.20
	其他	0.00	0.00
	合计	4,187.25	41.11
主体评级分布	AAA	4,166.55	40.91
	AA+	0.00	0.00
	AA	0.00	0.00
	AA-	0.00	0.00
	利率债	20.71	0.20
	其他	0.00	0.00
	合计	4,187.25	41.11

上海东方证券资产管理有限公司
2024年6月5日