东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

【2015】年度报告摘要

基金管理人:上海东方证券资产管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2016年3月26日

§1 重要提示

1.1 重要提示

上海东方证券资产管理有限公司的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

上海东方证券资产管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金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基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2015年6月5日(基金合同生效日)起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	东方红策略精选混合	
基金主代码	001405	
基金运作方式	契约型开放式,发起式	
基金合同生效日	2015年6月5日	
基金管理人	上海东方证券资产管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,739,005,317.80份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	东方红策略精选混合A	东方红策略精选混合C
下属分级基金的场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	001405	001406
下属分级基金的前端交易代码	001405	001406
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	81,208,861.61份	2,657,796,456.19份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过严谨的大类资产配置策略和个券精选策略,在做好风险管理的基础上,运用多样化的投资策略实现基金资产的稳定增值。
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的三年期银行定期存款税后收益率+1.5%。
风险收益特征	本基金是一只混合型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海东方证券资产管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	唐涵颖	田青
	联系电话	021-63325888	010-67595096
	电子邮箱	service@dfham.com	tianqing.1.zh@ccb.com
客户服务电话		4009200808	010-67595096
传真		021-63326981	010-66275853

2.4信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.dfham.com	
基金年度报告备置地点	上海东方证券资产管理有限公司 上海市中山南路318号2号楼31层 中国建设银行股份有限公司 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼	

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年6月5日(基金合同生效日)-2015年12月31日	
	东方红策略精选混合A	东方红策略精选混合C
本期已实现收益	4,832,225.17	11,206,682.81
本期利润	5,456,908.11	29,599,734.30
加权平均基金份额本期利润	0.0172	0.0509
本期基金份额净值增长率	2.50%	-0.60%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	
期末可供分配基金份额利润	-0.0306	-0.0602
期末基金资产净值	83,271,190.78	2,642,709,974.30
期末基金份额净值	1.025	0.994

注:1、上述指标的计算时间的起始日为2015年6月5日(基金合同生效日),截至本报告期末不足一年。

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方红策略精选混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.12%	0.17%	1.07%	0.01%	2.05%	0.16%
过去六个月	2.30%	0.27%	2.25%	0.01%	0.05%	0.26%
自基金合同生效起至今	2.50%	0.28%	2.61%	0.01%	-0.11%	0.27%

东方红策略精选混合C

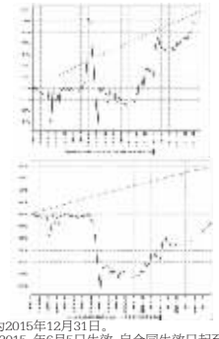
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.01%	0.16%	1.07%	0.01%	1.94%	0.15%
过去六个月	-0.80%	0.25%	2.25%	0.01%	-3.05%	0.24%
自基金合同生效起至今	-0.60%	0.26%	2.61%	0.01%	-3.21%	0.25%

注:1、本基金合同于2015年6月5日生效,截止本报告期末不足一年。

2、自基金合同生效日起至今指2015年6月5日-2015年12月31日。

[illegible]

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

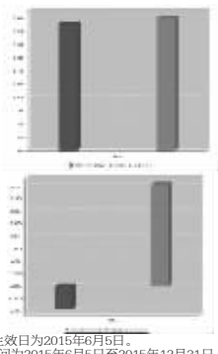


注:(1)截止日期为2015年12月31日。

(2)本基金合同于2015 年6月5日生效,自合同生效日起至本报告期末不足一年。

(3)本基金建仓期6个月,即从2015年6月5日起至2015 年12月4日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:1、本基金合同生效日为2015年6月5日。

2、本图所示时间区间为2015年6月5日至2015年12月31日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自2015年6月5日(基金合同生效日)至2015年12月31日未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上海东方证券资产管理有限公司成立于2010年7月28日,是国内首家获中国证监会批准设立的券商系资产管理公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准东方证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》(证监许可[2010]518号)批准,由东方证券股份有限公司出资3亿元在原东方证券资产管理业务总部的基础上成立。2013年8月,公司成为首家获得“公开募集证券投资基金管理业务资格”的证券公司,公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。截至2015年12月31日,本基金管理人共管理东方证券股份有限公司资产管理业务总部的证券公司,公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。截至2015年12月31日,本基金管理人共管理东方证券股份有限公司资产管理业务总部的基础上成立。2013年8月,公司成为首家获得“公开募集证券投资基金管理业务资格”