

基金管理人:上海东方证券资产管理有限公司  
基金托管人:中国工商银行股份有限公司  
报告送出日期:2018年7月19日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本基金报告所载资料不存在虚假记载、误导陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同,于2018年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、基金净值表现、持有人数、持有人结构、基金资产净值和份额净值等数据。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

本报告中财务数据未经审计。

§ 2 基金产品概况

基金名称 东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金

基金代码 000480

交易方式 灵活配置型开放式

前端申购代码 000480

前端赎回代码 7047

基金合同生效日 2014年1月6日

报告期末基金余额 1,790,464,536.09

投资目标 把握中国经济转型升级的一些大趋势,深入挖掘隐藏在大趋势下的投资机会,力争在控制风险的前提下获取超越基准的收益。

投资策略 本基金在经济发展的大趋势下为投资者,力争在控制风险的前提下获取超越基准的收益。

风险收益特征 中长期灵活配置型基金,风险收益特征为“股票型基金”。

基金管理人 上海东方证券资产管理有限公司

基金托管人 中国工商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2018年1月1日 - 2018年3月31日)

1.本期已实现收益 102,210,426.15

2.本期利润 -272,618,826.47

3.期末可供分配基金份额利润 -0.0106

4.期末基金资产净值 4,279,560,525.45

5.期末基金份额净值 2.900

注: (1) 所列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将低于所列数字。

(2) 本期利润为本报告期收入减去各项费用后的变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -6.05% 1.12% -6.65% 0.79% 0.40% 0.35%

注: 过去三个报告期(2018年1月1日 - 2018年3月31日)。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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: 上图展示了基金成立以来的净值增长率与业绩比较基准的相对表现。

3.2.3 基金净值表现

3.2.3.1 本报告期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

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.06% 0.16% -0.07% 0.09% 0.00% 0.00%

3.2.3.2 本报告期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

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.17% 0.07% 0.00% 0.00% 0.00% 0.00%

注: (1) 所列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将低于所列数字。

(2) 本期利润为本报告期收入减去各项费用后的变动收益。

3.2.4 基金净值

3.2.4.1 本报告期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

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.06% 0.16% -0.07% 0.09% 0.00% 0.00%

3.2.4.2 本报告期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

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.17% 0.07% 0.00% 0.00% 0.00% 0.00%

注: (1) 所列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将低于所列数字。

(2) 本期利润为本报告期收入减去各项费用后的变动收益。

3.2.5 基金净值

3.2.5.1 本报告期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

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.06% 0.16% -0.07% 0.09% 0.00% 0.00%

3.2.5.2 本报告期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

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.17% 0.07% 0.00% 0.00% 0.00% 0.00%

注: (1) 所列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将低于所列数字。

(2) 本期利润为本报告期收入减去各项费用后的变动收益。

3.2.6 基金净值

3.2.6.1 本报告期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

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.06% 0.16% -0.07% 0.09% 0.00% 0.00%

3.2.6.2 本报告期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

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.17% 0.07% 0.00% 0.00% 0.00% 0.00%

注: (1) 所列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将低于所列数字。

(2) 本期利润为本报告期收入减去各项费用后的变动收益。

3.2.7 基金净值

3.2.7.1 本报告期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

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.06% 0.16% -0.07% 0.09% 0.00% 0.00%

3.2.7.2 本报告期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

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.17% 0.07% 0.00% 0.00% 0.00% 0.00%

注: (1) 所列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将低于所列数字。

(2) 本期利润为本报告期收入减去各项费用后的变动收益。

3.2.8 基金净值

3.2.8.1 本报告期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

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.06% 0.16% -0.07% 0.09% 0.00% 0.00%

3.2.8.2 本报告期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

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.17% 0.07% 0.00% 0.00% 0.00% 0.00%

注: (1) 所列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将低于所列数字。

(2) 本期利润为本报告期收入减去各项费用后的变动收益。

3.2.9 基金净值

3.2.9.1 本报告期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

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.06% 0.16% -0.07% 0.09% 0.00% 0.00%

3.2.9.2 本报告期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

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.17% 0.07% 0.00% 0.00% 0.00% 0.00%

注: (1) 所列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将低于所列数字。

(2) 本期利润为本报告期收入减去各项费用后的变动收益。

3.2.10 基金净值

3.2.10.1 本报告期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

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.06% 0.16% -0.07% 0.09% 0.00% 0.00%

3.2.10.2 本报告期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

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.17% 0.07% 0.00% 0.00% 0.00% 0.00%

注: (1) 所列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将低于所列数字。

(2) 本期利润为本报告期收入减去各项费用后的变动收益。

3.2.11 基金净值

3.2.11.1 本报告期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

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.06% 0.16% -0.07% 0.09% 0.00% 0.00%

3.2.11.2 本报告期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

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.17% 0.07% 0.00% 0.00% 0.00% 0.00%

注: (1) 所列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将低于所列数字。

(2) 本期利润为本报告期收入减去各项费用后的变动收益。

3.2.12 基金净值

3.2.12.1 本报告期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

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.06% 0.16% -0.07% 0.09% 0.00% 0.00%

3.2.12.2 本报告期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

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.17% 0.07% 0.00% 0.00% 0.00% 0.00%

注: (1) 所列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将低于所列数字。

(2) 本期利润为本报告期收入减去各项费用后的变动收益。

3.2.13 基金净值

3.2.13.1 本报告期基金份额