东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人:上海东方证券资产管理有限公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司
送出日期:2019年8月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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。本半年度报告由董事长签发。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月22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。

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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年01月01日起至06月30日。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	东方红战略精选混合	
基金主代码	003044	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年8月30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	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	463,327,895.70份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东方红战略精选混合A	东方红战略精选混合C
下属分级基金的交易代码	003044	003045
报告期末下属分级基金的份额总额	423,292,866.96份	40,035,028.74份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下,通过积极主动的投资管理,追求资产净值的长期稳健增值。
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	中债综合指数收益率×80%+恒生指数收益率×10%+沪深300指数收益率×10%。
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。本基金除了投资于股票、债券等传统品种外,还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票,除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外,本基金还面临港股通机制下投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李云亮	胡婉
	联系电话	021-63326888	021-61618888
	电子邮箱	service@dfham.com	Hu566@spdb.com.cn
客户服务电话		4009200808	95528
传真		021-63326981	021-63602540

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.dfham.com
基金半年度报告备置地点	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 上海浦东发展银行股份有限公司 上海市中山东一路12号

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2019年1月1日-2019年6月30日)	
	东方红战略精选混合A	东方红战略精选混合C
本期已实现收益	21,389,800.83	1,622,373.65
本期利润	56,156,478.32	3,966,080.32
加权平均基金份额本期利润	0.1115	0.1000
本期基金份额净值增长率	9.39%	9.17%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0826	0.0698
期末基金资产净值	469,178,453.46	43,848,832.50
期末基金份额净值	1.1084	1.0953

注:1、表中的"期末"均指报告期最后一日,即2019年6月30日;"本期"指2019年1月1日-2019年6月30日。

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。

4、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

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

东方红战略精选混合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
过去一个月	1.91%	0.37%	1.37%	0.19%	0.54%	0.18%
过去三个月	-1.10%	0.47%	-0.40%	0.21%	-0.70%	0.26%
过去六个月	9.39%	0.52%	3.82%	0.22%	5.57%	0.30%
过去一年	6.83%	0.50%	3.38%	0.24%	3.45%	0.26%
自基金合同生效起至今	16.20%	0.39%	3.77%	0.20%	12.43%	0.19%

东方红战略精选混合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
过去一个月	1.88%	0.37%	1.37%	0.19%	0.51%	0.18%
过去三个月	-1.19%	0.47%	-0.40%	0.21%	-0.79%	0.26%
过去六个月	9.17%	0.52%	3.82%	0.22%	5.35%	0.30%
过去一年	6.41%	0.50%	3.38%	0.24%	3.03%	0.26%
自基金合同生效起至今	14.85%	0.39%	3.77%	0.20%	11.08%	0.19%

注:1、本基金合同于2016年8月30日生效。

2、自基金合同生效日起至今指2016年8月30日-2019年6月30日。

3、根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定,本基金的业绩比较基准=中债综合指数收益率×80%+恒生指数收益率×10%+沪深300指数收益率×10%。本基金股票投资部分的业绩比较基准采用沪深300指数,债券投资部分的业绩比较基准采用中国债券总指数。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理,t日收益率(benchmark)按下列公式计算:

benchmark=80%*[t日沪深300指数/(t-1日沪深300指数)-1]+10%*[t日恒生指数/(t-1日恒生指数)-1]+10%*[t日中国债券总指数/(t-1日中国债券总指数)-1];

其中,t=1,2,3,...T,T表示时间截至日;

t日至T日的期间收益率(benchmarkT)按下列公式计算:

benchmarkTt =[∏Tt=(1+benchmark)]-1

其中,T=2,3,4,...; ∏Tt= (1+benchmark) 表示t日至T日的(1+benchmark)数学连乘。

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:截止日期为2019年6月30日。

§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2019年6月30日,本基金管理人共管理东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金、东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金、东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金、东方红稳健精选混合型证券投资基金、东方红睿选定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金、东方红优势精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红收益增强债券型证券投资基金、东方红6个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、东方红信用债债券型证券投资基金、东方红睿轩三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金、东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金、东方红价值精选混合型证券投资基金、东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红益鑫纯债债券型证券投资基金、东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红货币市场基金、东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红配置精选混合型证券投资基金、东方红恒元五年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金三十五只证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
纪文静	上海东方证券资产管理有限公司公募固定收益投资部副总经理,兼任东方红策略精选混合型证券投资基金、东方红稳健精选混合型证券投资基金、东方红睿选定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红6个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、东方红信用债债券型证券投资基金、东方红睿轩三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金、东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红益鑫纯债债券型证券投资基金、东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红配置精选混合型证券投资基金、东方红恒元五年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金	2016年8月30日	-	12	硕士,曾任东海证券股份有限公司固定收益部投资研究经理,纳鼎交易经理,国际证券股份有限公司债券投资与交易部总经理,上海东方证券资产管理有限公司固定收益投资部副总经理兼任东方红领先精选混合、东方红稳健精选混合、东方红睿选定期开放混合、东方红6个月定开纯债、东方红收益增强债券、东方红信用债债券、东方红稳添利纯债、东方红战略精选混合、东方红京东大数据灵活配置混合、东方红优势精选混合、东方红睿丰灵活配置混合、东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合、东方红睿轩三年定期开放灵活配置混合、东方红睿满沪港深灵活配置混合、东方红睿华沪港深灵活配置混合、东方红睿选定期开放混合、东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合、东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合、东方红睿元五年定期开放灵活配置混合、东方红核心优选一年定期开放混合、东方红恒元五年定期开放灵活配置混合、东方红汇利债券、东方红汇阳债券、东方红益鑫纯债债券、东方红智逸沪港深定期开放混合发起式证券投资基金、东方红睿选定期开放混合发起式证券投资基金、东方红睿元五年定期开放混合、东方红恒元五年定期开放混合、东方红核心优选一年定期开放混合、东方红睿泽三年定期开放混合、东方红睿玺三年定期开放混合、东方红睿华沪港深混合、东方红睿华沪港深混合A、东方红睿华沪港深混合C、东方红睿华沪港深混合E、东方红睿华沪港深混合I、东方红睿华沪港深混合Y、东方红睿华沪港深混合R、东方红睿华沪港深混合H、东方红睿华沪港深混合O、东方红睿华沪港深混合P、东方红睿华沪港深混合N、东方红睿华沪港深混合Q、东方红睿华沪港深混合T、东方红睿华沪港深混合U、东方红睿华沪港深混合V、东方红睿华沪港深混合W、东方红睿华沪港深混合X、东方红睿华沪港深混合Z、东方红睿华沪港深混合M、东方红睿华沪港深混合L、东方红睿华沪港深混合S、东方红睿华沪港深混合J、东方红睿华沪港深混合K、东方红睿华沪港深混合B、东方红睿华沪港深混合D、东方红睿华沪港深混合F、东方红睿华沪港深混合G、东方红睿华沪港深混合X、东方红睿华沪港深混合Y