

东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金

2014 第 二 季 度 报 告

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：2014年7月17日

§1 重要提示

上海东方证券资产管理有限公司的董事会及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规定，于2014年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

基金名称	
东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金	
交易代码	
000880	
前次交易代码	
000880	
前次交易代码	
000880	
基金运作方式	
契约型开放式	
基金合同生效日	
2014年1月28日	
报告期末基金份额总额	
991,400,913.47份	
投资目标	
把握中国经济转型升级带来的一些重大机遇，深入挖掘隐藏在宏观经济大势下的投资机会，严控风险，力争实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	
本基金以宏观经济形势的大趋势为投资主线，力求把握存在大趋势下的投资机会，实现基金资产的长期稳定增值。	
业绩比较基准	
沪深300指数收益率*70%+中国债券总指数收益率*30%。	
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证券投资基金中的货币型基金。	
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

主要财务指标	报告期(2014年4月1日—2014年6月30日)
1.本期已实现收益	-1,458,201.04
2.本期利润	25,255,190.91
3.加权平均基金份额本期利润	0.0234
4.期末基金资产净值	990,345,081.21
5.期末基金份额净值	0.999

(注：1)所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或损失。

2)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。

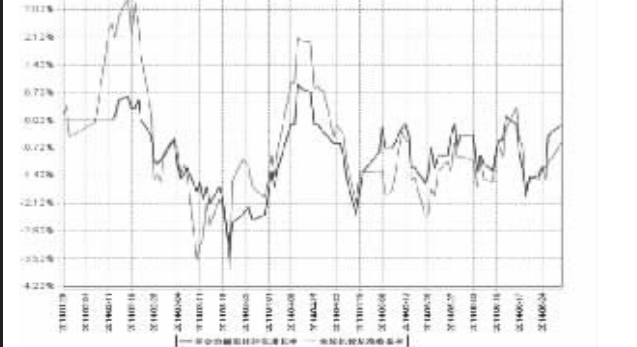
§3.2 基金净值表现

3.2.1 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①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准收益标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.30%	0.48%	1.44%	0.61%	0.82%	-0.13%

注：过去三个月指自2014年4月1日至2014年6月30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：截止日为2014年6月30日
本基金于2014年1月28日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。
本基金建仓期为6个月，即从2014年1月28日起至2014年7月27日，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

§4 管理人报告

4.1 基金经营(或基金经营小组)简介

姓名	职务	在基金经营中担任的职务	说明
王健	董事长	基金经营中担任的职务	曾任上海东方证券资产管理有限公司总经理，现任上海东方证券资产管理有限公司董事长。

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵守信情况的说明

本报告期，上海东方证券资产管理有限公司作为东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金的管理人，严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》以及其有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险，确保基金资产的安全并谋求基金资产的长期稳定增值为目标，管理和运用基金资产，无损害基金份额持有人利益的行为，基金投资组合符合有关法规和基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金公平交易管理制度指导意见》和《上海东方证券资产管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和业绩表现说明

2014年2季度，股市先抑后扬，尤其是中证指数宣布IPO发行节奏及总量调控后，以创业板为代表的中小市值个股出现了一波反弹行情。整个二季度，申万A股指数上涨2.7%，创业板综合指数上涨1.27%。本基金较好地把握了1季度的行情，4、5两个月本基金净值一直处在40%左右，6月提升回到50%左右。本季度取得3.4%涨幅。

4.4.2 报告期内基金的投资表现

报告期内，本基金净值增长率为2.36%，业绩比较基准收益率为1.44%。

§5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	518,280,423.09	46.18
其中：股票		518,280,423.09	46.18
2	固定收益投资	262,536,055.82	23.39
其中：债券		262,536,055.82	23.39
3	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	120,000,000.00	10.69
其中：买断式回购的买入返售金融资产		-	-
7	银行存款和结算备付金合计	219,908,106.52	19.60
8	其他资产	1,470,567.77	0.13
9	合计	1,122,195,153.20	100.00

§6 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧业	30,625,726.08	3.09
B	采矿业	-	-
C	制造业	277,489,197.82	38.12
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	68,960,205.26	6.96
E	建筑业	1,250,000.00	0.13
F	交通运输、仓储和邮政业	32,360,293.93	3.26
G	信息传输、软件和信息技术服务业	7,615,000.00	0.77
H	金融业	-	-
I	房地产业	-	-
J	其他服务业	-	-
K	其他服务业	-	-
L	其他服务业	-	-
M	其他服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		518,280,423.09	52.33

§7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000423	沈阳钢铁	2,000,000	66,640,000.00	6.73
2	000498	平安银行	2,000,058	51,663,152.46	5.22
3	600886	国投电力	10,000,000	51,000,000.00	5.15
4	600066	宁波电力	3,000,047	48,420,758.58	4.89
5	002008	大族激光	2,500,447	43,350,814.98	4.38
6	600887	伊利股份	1,000,080	33,129,649.60	3.34
7	600950	中国铁建	10,000,091	32,300,293.93	3.26
8	002041	登海种业	1,000,062	30,625,726.08	3.09
9	002415	奥康医疗	1,400,093	22,717,575.42	2.29
10	600699	海螺水泥	1,500,079	22,141,151.28	2.24

§8 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	-	-
4	企业债	-	-
5	可转债	-	-
6	其他	-	-
7	其他	-	-
8	其他	-	-
9	其他	-	-
10	其他	-	-
合计		262,536,055.82	26.51

§9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113005	平安银行	750,000	80,115,000.00	8.09
2	110023	民生转债	700,000	64,963,712.00	6.56
3	113001	中行转债	600,000	61,074,000.00	6.17
4	127002	金一转债	600,000	56,383,343.82	5.69

§10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

§11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

§12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

§13 报告期末本基金投资的贵金属交易情况说明

5.11.1 报告期末本基金投资的贵金属交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

§14 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

5.12.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

§15 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

5.13.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

§16 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

5.14.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.15.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.16.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.17.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.18.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.19.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.20.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.21.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.22.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.23.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.24.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.25.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.26.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.27.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.28.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.29.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.30.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.31.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.32.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.33.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.34.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.35.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.36.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.37.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.38.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.39.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.40.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.41.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.42.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.43.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.44.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.45.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.46.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.47.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.48.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.49.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.50.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.51.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.52.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.53.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.54.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.55.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.56.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.57.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.58.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.59.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.60.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.61.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.62.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.63.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.64.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.65.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.66.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.67.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.68.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.69.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.70.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.71.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.72.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.73.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.74.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.75.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.76.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.77.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.78.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.79.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.80.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.81.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.82.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.83.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.84.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.85.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.86.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.87.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.88.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.89.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.90.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.91.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.92.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.93.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.94.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未