东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

【2015】第三季度报告

基金管理人:上海东方证券资产管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月26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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2015 年10月23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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方红策略精选混合	
场内简称	–	
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	
报告期末基金份额总额	12,809,145.61份	
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。	
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	
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	12,678,945.21份	130,200.40份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日 – 2015年9月30日)	
	东方红策略精选混合A	东方红策略精选混合C
1. 本期已实现收益	2,383,462.48	–8,286.44
2. 本期利润	1,451,074.36	–4,341.46
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0030	–0.0441
4. 期末基金资产净值	12,606,729.94	125,707.50
5. 期末基金份额净值	0.994	0.965

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水平要低于所列数字。

(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)本基金合同于2015年6月5日生效。

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

东方红策略精选混合A

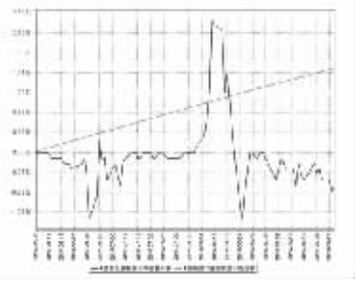
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
过去三个月	–0.80%	0.34%	1.17%	0.01%	–1.97%	0.33%

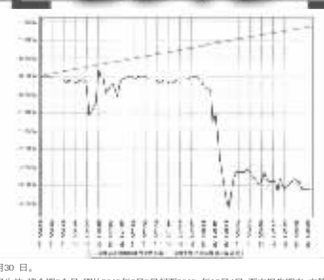
东方红策略精选混合C

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	–3.69%	0.30%	1.17%	0.01%	–4.86%	0.29%

注:过去三个月指2015 年7月1日–2015 年9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:(1)截止日期为 2015 年9月30 日。

(2)本基金合同于2015年6月5日生效,建仓期6个月,因从2015年6月5日起至2015 年12月4日,至本报告期末,本基金尚处于建仓期。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刚登峰	本基金基金经理,兼东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿阳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、东方红优势精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理	2015年6月5日	–	6年	硕士,曾任东方证券股份有限公司资产管理业务总部研究员、上海东方证券资产管理有限公司研究部高级研究员、投资经理助理,资深研究员、投资主办人;现任东方红睿丰混合、东方红睿阳混合、东方红睿元混合、东方红策略精选混合、东方红优势精选混合基金经理。具有基金从业资格,中国国籍。
纪文静	本基金基金经理,兼任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监、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、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理	2015年7月14日	–	9年	硕士,曾任东海证券股份有限公司固定收益部债券交易员、德邦证券股份有限公司债券投资与交易部总经理,2014年10月加入上海东方证券资产管理有限公司,现任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监兼任东方红领先精选混合、东方红稳健精选混合、东方红睿逸定期开放混合、东方红策略精选混合基金经理。具有基金从业资格,中国国籍。

注:(1)上述表格内基金首任基金经理"任职日期"指基金合同生效日,"离任日期"指根据公司决定确定的解聘日期;对此后非首任基金经理,基金经理的"任职日期"和"离任日期"均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

(2)证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期,上海东方证券资产管理有限公司作为本基金管理人,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、基金合同以及其它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,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为,本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

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和组合,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《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》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。

报告期内,未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年三季度股市震荡剧烈,各指数大幅下跌,人民币汇率中间价形成机制改革,叠加清理场外配资等因素,使得市场在8月下旬又出现二次暴跌。上证综指下跌29%,深证成指下跌30%,沪深300下跌28%,创业板指数下跌27%。从行业板块来看,钢铁、有色、家电、计算机、军工、煤炭和非银金融等跌幅较大,银行板块跌幅最小。概念股中迪斯尼、上海自贸区、新能源车和锂电池概念较为抗跌,食品安全和互联网金融概念跌幅居前。

三季度以来,随着IPO暂停和场外清理配资工作的持续,投资者的风险偏好快速回落,避险情绪上升,导致资金大幅回流债市,债券需求强劲。在基本面疲弱、资金面宽松、大类资产配置切换三重因素作用下,债券市场大幅上涨,各类债券收益率均创下或接近2011年以来的新低,中信标普全债指数上涨1.81%。分券种来看,表现最为强劲的是中高等级信用债以及长端利率债。

三季度本产品也积极调整了投资策略:股票操作上,通过仓位控制和结构调整规避了一部分风险,在个股选择上,仍坚持从公司基本面角度出发,选择估值水平和业绩成长性相匹配的公司;债券操作上,更加积极预配配,精选个券,把握了市场机会,获取了稳定的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2015年9月30日,本基金A类份额净值为0.994元,份额累计净值为0.994元,C类份额净值为0.965元,份额累计净值为0.965元。报告期内,本基金A类份额净值增长率为–0.80%,同期业绩比较基准收益率为1.17%,C类份额净值增长率为–3.69%,同期业绩比较基准收益率为1.17%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金,基金合同生效未满三年,不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	922,000.00	7.12
	其中:股票	922,000.00	7.12
2	固定收益投资	3,362,133.20	25.96
	其中:债券	3,362,133.20	25.96
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	8,417,456.51	65.01
7	其他资产	247,143.42	1.91
8	合计	12,948,733.13	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	922,000.00	7.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	–	–
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
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	922,000.00	7.24

5.3 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	000538	云南白药	10,000	640,000.00	5.03
2	600066	宇通客车	15,000	282,000.00	2.21

5.4 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	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	3,362,133.20	26.41
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	3,362,133.20	26.41

5.5 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	124155	13爵域投	8,000	847,040.00	6.65
2	122433	15融创02	8,000	813,600.00	6.39
3	122395	15富力债	8,000	809,360.00	6.36
4	122563	PR亳州债	9,490	808,832.70	6.35
5	122444	15冠城债	700	70,420.00	0.55

5.6 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
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
5.8 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 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保证金明细
本基金本报告期末进行股指期货投资。
5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金投资股指期货以套期保值为目的,以回避市场风险。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理股指期货合约数量,以萃取相应股票组合的超额收益。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 本期国债期货投资政策
本基金投资国债期货以套期保值为目的,以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量,以萃取相应债券组合的超额收益。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末进行国债期货投资。
5.10.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末进行国债期货投资。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1
本基金持有的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.11.2
基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。
5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	104,396.36
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	108,672.97
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	34,074.09
8	其他	–
9	合计	247,143.42

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。
5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	东方红策略精选混合A	东方红策略精选混合C
报告期期初基金份额总额	1,029,980,930.74	28,000.00
报告期期间基金总申购份额	595,243.86	102,200.40
减:报告期期间基金总赎回份额	1,017,897,229.39	–
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"–"填列)	–	–
报告期期末基金份额总额	12,678,945.21	130,200.40

注:1.本基金合同于2015年6月5日生效。
(2)总申购份额含红利再投份额,本基金暂未开通基金转换业务)。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	–
报告期期间卖出/赎回总份额	–
报告期末管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	78.07

注:本报告期,管理人持有本基金份额未发生变动。
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本报告期,本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	78.07	10,000,000.00	78.07	3年
基金管理人高级管理人员	–	–	–	–	–
基金经理等人员	–	–	–	–	–
基金管理人股东	–	–	–	–	–
其他	–	–	–	–	–
合计	10,000,000.00	78.07	10,000,000.00	78.07	3年

注:截止日期2015年9月30日。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1、中国证监会批准设立东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金的文件;
2、《东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金合同》;
3、《东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》;
4、报告期内在指定报刊上披露的各项公告;
5、基金管理人业务资格批件、营业执照;
6、中国证监会要求的其他文件。
9.2 存放地点
备查文件存放于基金管理人的办公场所:上海市中山南路318号2号楼31层。
9.3 查阅方式
投资者可到基金管理人的办公场所免费查阅备查文件,亦可通过公司网站查阅,公司网址为:www.dfham.com。

上海东方证券资产管理有限公司
2015年10月26日

东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金

【2015】第三季度报告

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:2015年10月26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 2015年10月20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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方红产业升级混合
场内简称	–
基金主代码	000619
前端交易代码	000619
后端交易代码	–
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年6月6日
报告期末基金份额总额	330,419,067.49份
投资目标	把握经济结构调整的战略性机遇,在受益于产业升级的传统行业和新兴产业中精选具有核心竞争优势的个股,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金以中国转型期的产业结构升级为投资主线,综合运用多种投资策略构建资产组合。一方面,管理人通过研究发达国家产业演进的历史,结合中国经济的自身特点和政策导向,寻找中国当期阶段最受益的"一类行业";另一方面,管理人会"自下而上"的观察一些行业竞争格局的变化,把握产业演进过程中,行业龙头盈利能力提升的投资机会。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准=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债券型基金与货币市场基金。
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

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日 – 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	37,911,824.43
2.本期利润	–152,930,592.19
3.加权平均基金份额本期利润	–0.4668
4.期末基金资产净值	598,682,806.51
5.期末基金份额净值	1.812

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水平要低于所列数字。

(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。

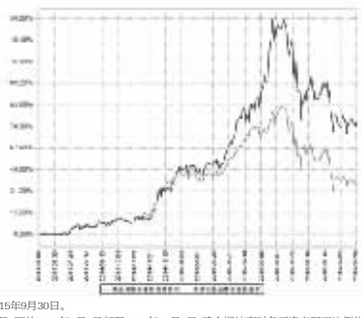
3.2 基金净值表现

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	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
过去三个月	–19.36%	2.60%	–19.92%	2.34%	0.56%	0.26%

注:过去三个月指2015年7月1日–2015年9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:(1)截止日期为2015年9月30日。

(2)本基金建仓期6个月,因从2014年6月6日起至2014年12月5日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨达治	本基金基金经理,兼任公司董事总经理、公募权益投资部总监、权益研究部总监、东方红新动力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、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、东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2014年6月6日	–	13年	硕士,曾任东方证券股份有限公司证券投资业务总部研究员;东方基金有限责任公司研究部研究员;东方证券股份有限公司资产管理业务总部投资经理;上海东方证券资产管理有限公司投资部投资经理、研究部副总监兼投资经理;现任公司董事总经理、公募权益投资部总监、权益研究部总监兼东方红新动力混合、东方红产业升级混合、东方红睿丰混合、东方红睿元混合、东方红中国优势混合、东方红京东大数据混合基金经理。具有基金从业资格,中国国籍。
王延飞	本基金基金经理,兼任东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2015年6月26日	–	5年	硕士,曾任东方证券股份有限公司资产管理业务总部研究员、上海东方证券资产管理有限公司研究部研究员,高级研究员,现任东方红产业升级混合、东方红中国优势混合基金经理。具有基金从业资格,中国国籍。

注:(1)上述表格内基金首任基金经理"任职日期"指基金合同生效日,"离任日期"指根据公司决定确定的解聘日期;对此后非首任基金经理,基金经理的"任职日期"和"离任日期"均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

(2)证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期,上海东方证券资产管理有限公司作为本基金管理人,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、基金合同以及其它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,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为,本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

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和组合,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《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》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。

报告期内,未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年三季度沪深300指数下跌28.4%,创业板指数下跌27.1%。其中银行(–16.26%)餐饮旅游(–23.46%)医药(–26.97%)跌幅较小,钢铁(–45.66%)有色(–40.7%)煤炭(–40.36%)跌幅较大。本产品坚持价值精选的策略,跑赢沪深300和创业板指数,取得较好的相对收益。

从6月中旬开始的流动性危机带来的"踩踏",到8月中旬的人民币迅速贬值带来的资金外逃风波,再到9月份的清理场外配资,股市经历了快速下跌的过程。展望未来:(1)资本市场环境趋于稳定。两市融资余额在9月份后落入到1万亿以下的区间,场外配资已到尾声,汇率也逐渐企稳,投资者信心恢复;(2)8月20日以来,10年期国债到期收益率再次迅速从3.5%降到3%左右,表明国内资金面仍然很充裕,结合大类资产比较来看,部分优质估值的蓝筹股具备估值提升的动能,具备了一定投资价值;(3)从发电量、货运周转量等指标来看,整体经济形势还是很差,转型压力巨大,部分符合转型方向的优质成长股在经历了这波下跌后也具备了较大市值扩张空间。

站在目前时点,我们更加坚信精选个股的重要性,仍将坚持"幸运的行业,能干的管理层,合理的估值"的投资理念,选择消费升级、人口老龄化、新能源相关、信息化重构等相关择优秀公司,以合理的价格买入,力争给投资者带来绝对回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2015年9月30日,本基金份额净值为1.812元,份额累计净值为1.812元。报告期内,本基金份额净值增长率为–19.36%,同期业绩比较基准收益率为–19.92%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内,本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	463,314,598.72	76.31
	其中:股票	463,314,598.72	76.31
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	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	–	–
	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	134,825,528.30	22.21
8	其他资产	8,984,495.53	1.48
9	合计	607,124,622.55	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	3,150,000.00	0.53
B	采矿业	–	–
C	制造业	362,754,851.72	60.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,800,838.00	2.31
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	12,721,749.00	2.12
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,235,200.00	0.71
J	金融业	22,176,960.00	3.70
K	房地产业	38,190,000.00	6.38
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
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	6,285,000.00	1.05
S	综合	–	–
	合计	463,314,598.72	77.39

5.3 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	600887	伊利股份	3,300,000	50,754,000.00	8.48
2	002415	海康威视	1,500,000	48,870,000.00	8.16
3	002304	洋河股份	830,091	45,231,658.59	7.56
4	600066	宇通客车	2,100,068	39,481,278.40	6.59
5	000002	万 科A	3,000,000	38,190,000.00	6.38
6	600557	康缘药业	1,500,000	31,095,000.00	5.19
7	600036	招商银行	1,248,000	22,176,960.00	3.70
8	600271	航天信息	400,000	21,476,000.00	3.59
9	000538	云南白药	295,037	18,882,368.00	3.15
10	600535	天士力	540,000	17,906,400.00	2.99

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。
5.5 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
本基金本报告期末未持有债券。
5.6 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
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
5.8 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 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持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
公允价值变动总额合计(元)					811,440.00
股指期货投资本期收益(元)					11,354,740.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					811,440.00

注:本基金本报告期末未持有股指期货。
5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金投资股指期货以套期保值为目的,以回避市场风险。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。管理人通过动态管理股指期货合约数量,以萃取相应股票组合的超额收益。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 本期国债期货投资政策
本基金投资国债期货以套期保值为目的,以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。管理人通过动态管理国债期货合约数量,以萃取相应债券组合的超额收益。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末进行国债期货投资。
5.10.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末进行国债期货投资。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1
本基金持有的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.11.2
基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。
5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	842,052.52
2	应收证券清算款	7,822,528.81
3	应收股利	–
4	应收利息	47,261.43
5	应收申购款	272,652.77
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	8,984,495.53

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。
5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	325,875,664.11
报告期期间基金总申购份额	244,893,526.44
减:报告期期间基金总赎回份额	240,350,123.06
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"–"填列)	–
报告期期末基金份额总额	330,419,067.49

注:总申购份额含红利再投份额(本基金暂未开通基金转换业务)。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期期初管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期间买入/申购总份额	5,060,222.67
报告期期间卖出/赎回总份额	–
报告期期末管理人持有的本基金份额	5,060,222.67
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.53

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率注
1	申购	2015年7月7日	5,060,222.67	10,000,000.00	–
合计			5,060,222.67	10,000,000.00	

注:1.本基金管理人运用固有资金于2015年7月7日申购东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金,按照招募说明书规定,申购费1000元。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1、中国证监会批准设立东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金的文件;
2、《东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金合同》;
3、《东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
4、东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金财务报表及报表附注;
5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告;
6、基金管理人业务资格批件、营业执照;
7、中国证监会要求的其他文件。
8.2 存放地点
备查文件存放于基金管理人的办公场所:上海市中山南路318号2号楼31层。
8.3 查阅方式
投资者可到基金管理人的办公场所免费查阅备查文件,亦可通过公司网站查阅,公司网址为:www.dfham.com。

上海东方证券资产管理有限公司
2015年10月26日

东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金

【2015】第三季度报告

基金管理人:上海东方证券资产管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月26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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015 年10月22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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方红京东大数据混