东方红稳健精选混合型证券投资基金

【2015】第四季度报告

基金管理人:上海东方证券资产管理有限公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月20日

§1 重要提示

基金管理人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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月18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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方红稳健精选混合	
场内简称	–	
基金主代码	001203	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年4月17日	
报告期末基金份额总额	3,842,956,140.93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资产的稳定增值。本基金通过定性与定量研究相结合的方法,确定投资组合中股票、债券和现金类大类资产的配置比例。	
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	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	东方红稳健精选混合A	东方红稳健精选混合C
下属分级基金的场内简称	–	–
下属分级基金的交易代码	001203	001204
下属分级基金的前端交易代码	001203	001204
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	3,559,551,574.83份	283,404,566.10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10月1日 – 2015年12月31日)	
	东方红稳健精选混合A	东方红稳健精选混合C
1. 本期已实现收益	35,660,514.75	1,372,792.89
2. 本期利润	85,171,027.21	5,344,483.13
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0261	0.0333
4. 期末基金资产净值	3,831,993,167.15	311,105,165.64
5. 期末基金份额净值	1.077	1.098

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

东方红稳健精选混合A

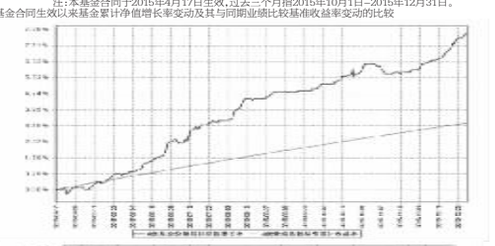
主要财务指标	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④

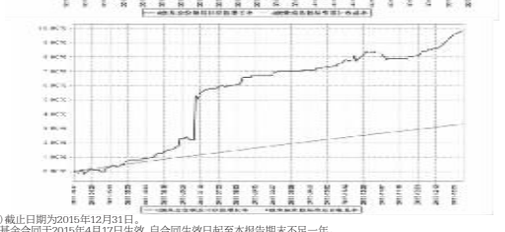
东方红稳健精选混合C

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	2.33%	0.10%	1.09%	0.01%	1.24%	0.09%

注:本基金合同于2015年4月17日生效,过去三个月指2015年10月1日–2015年12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:(1)截止日期为2015年12月31日。

(2)本基金合同于2015年4月17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4月17日起至2015年10月16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		
林鹏	本基金基金经理兼东方证券资产管理有限公司执行董事、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、东方红领先精选灵活配置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4月17日	–	18年	硕士,曾任东方证券股份有限公司研究所研究员、资产管理业务总部投资经理;现任上海东方证券资产管理有限公司执行董事兼任东方红睿丰混合、东方红睿阳混合、东方红睿元混合、东方红领先精选混合、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。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、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金、东方红策略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、东方红信用债债券型证券投资基金基金经理	2015年7月14日	–	10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、东方红纯债债券、东方红收益增强债券、东方红信用债债券基金经理。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年四季度沪深300指数上涨16.49%,创业板大涨30.32%。电子(41.0%)房地产(39.8%)计算机(39.3%)通信(37.4%)纺织服装(35.2%)化工(35.0%)涨幅居前;钢铁(5.5%)交通运输(5.8%)国防军工(10.6%)涨幅靠后。本产品处于建仓期,四季度上涨4.91%。

四季度市场以恢复性上涨为主,TMT为代表的成长股风格的股票表现较好,这与三季度股灾中跌幅较大有关。而四季度末随着保险资金的举牌,一些低估值的板块比如地产跟家电表现也相对较好。

考虑16年的行情,保险资金入市甚至以举牌的方式未来还会出现,保险资金跟与之风格类似的银行理财资金的入市将对低估值高分红的个股形成利好,我们会增加这部分配置的比例。除此之外,还有部分符合经济转型方向,承接全球高端制造转移的公司的估值与成长还比较匹配,我们会加大这部分个股的研究与投资力度。

我们仍将追随社会发展的大趋势而选择收益的品种,选择优秀的公司,期望给投资者带来回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,本基金份额净值为1.046元,份额累计净值为1.046元。报告期内,本基金份额净值增长率为4.91%,同期业绩比较基准收益率为13.81%。

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	76,601,150.91	1.61
	其中:股票	76,601,150.91	1.61
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	4,444,987,551.40	93.48
	其中:债券	4,444,987,551.40	93.48
	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	33,772,859.59	0.71
8	其他资产	199,750,837.66	4.20
9	合计	4,755,112,399.56	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	28,643,634.13	0.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	1,571,551.95	0.04
F	批发和零售业	222,304.44	0.01
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	13,098,268.18	0.32
J	金融业	28,070,000.00	0.68
K	房地产业	4,886,000.00	0.12
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	109,392.21	0.00
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	76,601,150.91	1.85

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	600036	招商银行	1,000,000	17,990,000.00	0.43
2	600079	人福医药	500,000	11,130,000.00	0.27
3	300059	东方财富	202,000	10,510,060.00	0.25
4	601318	中国平安	280,000	10,080,000.00	0.24
5	002415	海康威视	199,984	6,877,449.76	0.17
6	000002	万 科A	200,000	4,886,000.00	0.12
7	600066	宇通客车	200,000	4,498,000.00	0.11
8	000538	云南白药	50,000	3,631,000.00	0.09
9	603508	思维列控	14,605	1,136,853.20	0.03
10	300496	中科创达	6,560	918,465.60	0.02

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	1,277,768,314.30	30.84
	其中:政策性金融债	1,277,768,314.30	30.84
4	企业债券	1,277,270,469.30	30.83
5	企业短期融资券	932,156,000.00	22.50
6	中期票据	948,212,000.00	22.89
7	可转债	9,580,767.80	0.23
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	4,444,987,551.40	107.29

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	150210	15国开10	3,300,000	357,588,000.00	8.63
2	150316	15进出16	3,000,000	306,960,000.00	7.41
3	150208	15国开08	2,200,000	230,758,000.00	5.57
4	150211	15国开11	2,100,000	210,609,000.00	5.08
5	150209	15国开09	1,400,000	148,708,000.00	3.59

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

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	302,119.77
2	应收证券清算款	140,603,217.55
3	应收股利	–
4	应收利息	58,845,500.34
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	199,750,837.66

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注: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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000002	万 科A	4,886,000.00	0.12	重大事项停牌

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	东方红稳健精选混合A	东方红稳健精选混合C
报告期期初基金份额总额	3,005,937,306.23	5,638,155.00
报告期期间基金总申购份额	569,312,241.37	278,094,867.94
减:报告期期间基金总赎回份额	15,697,972.77	328,456.84
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	3,559,551,574.83	283,404,566.10

注:(1)本基金合同于2015年4月17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

本报告期,本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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 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稳健精选混合型证券投资基金的文件;

2、《东方红稳健精选混合型证券投资基金合同》;

3、《东方红东方红稳健精选混合型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。

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
2016年1月20日

东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金

【2015】第四季度报告

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:2016年1月20日

§1 重要提示

基金管理人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2016年1月18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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方红新动力混合
场内简称	–
基金主代码	000480
前端交易代码	000480
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1月28日
报告期末基金份额总额	648,247,688.99份
投资目标	把握中国经济转型期的一些大趋势,深入挖掘隐藏在大趋势下的投资机会,严控风险,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金以经济发展中的大趋势为投资主线,力求挖掘孕育在大趋势下的投资机会,实现基金资产的长期稳定增值。 管理人通过定性和半定量的比较大类资产之间的风险收益比,在符合基金合同的情况下,在大类资产之间做一个相对最优的配置。
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10月1日 – 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	14,561,698.89
2.本期利润	207,835,114.82
3.加权平均基金份额本期利润	0.3040
4.期末基金资产净值	1,285,168,867.11
5.期末基金份额净值	1.983

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

主要财务指标	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

注:过去三个月指2015年10月1日–2015年12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:截止日期为2015年12月31日。

本基金建仓期6个月,即从2014年1月28日起至2014年7月27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	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1月28日	2015年12月9日	14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、执行董事;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中国优势混合、东方红睿元混合、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。
周云	本基金基金经理,兼任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。	2015年9月14日	–	8年	博士,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/投资主办人,现任东方红新动力混合、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。

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

4季度,实体经济的表现一如既往的疲软,仍看不到企稳的迹象;利率继续下行,10年期国债收益率跌破3%。A股市场在股灾情绪平复后,各类指数均有所反弹,沪深300指数上涨16.5%,分板块看,以TMT为代表的新兴行业涨幅靠前。

展望16年,我们认为A股上下波动幅度有可能非常巨大,一方面流动性宽松,实体经济不好的局面依然会维持,资本市场大概率还会比较活跃;另一方面以创业板为代表的大部分股票估值高企,注册制推出后股票供给也可能超预期。操作上,除了持有估值合理的优质股票外,我们会根据市场情况灵活调控仓位,努力为基金持有人创造超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,本基金份额净值为1.983元,份额累计净值为2.071元。本报告期,本基金净值增长率为18.67%,业绩比较基准收益率为12.26%。

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	1,143,127,051.31	88.35
	其中:股票	1,143,127,051.31	88.35
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	143,024,961.92	11.05
8	其他资产	7,720,375.16	0.60
9	合计	1,293,872,388.39	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	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	929,236,659.10	72.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	57,150,000.00	4.45
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	10,149,000.00	0.79
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	36,547,000.00	2.84
K	房地产业	109,935,000.00	8.55
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	109,392.21	0.01
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	1,143,127,051.31	88.95

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	7,000,000	115,010,000.00	8.95
2	000002	万 科A	4,500,000	109,935,000.00	8.55
3	002304	洋河股份	1,524,820	104,511,162.80	8.13
4	600066	宇通客车	4,230,814	95,151,006.86	7.40
5	002415	海康威视	2,475,000	85,115,250.00	6.62
6	600557	康缘药业	2,920,090	73,060,651.80	5.68
7	002157	正邦科技	3,350,000	67,335,000.00	5.24
8	600703	三安光电	2,550,040	61,914,971.20	4.82
9	000651	格力电器	2,726,000	60,926,100.00	4.74
10	600271	航天信息	741,500	52,987,590.00	4.12

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
IC1601	IC1601	–10	–14,798,000.00	–292,000.00	–
公允价值变动总额合计(元)					–292,000.00
股指期货投资本期收益(元)					–1,519,980.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					–292,000.00

注:买入持仓量以正数表示,卖出持仓量以负数表示。

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

根据本基金合同,本基金不参与国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金合同,本基金不参与国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同,本基金不参与国债期货投资。

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	306,009.48
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	94,504.27
5	应收申购款	3,264,850.02
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	7,720,375.16

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000002	万 科A	109,935,000.00	8.55	重大事项停牌
2	600271	航天信息	52,987,590.00	4.12	重大事项停牌

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	640,176,867.62
报告期期间基金总申购份额	269,134,802.64
减:报告期期间基金总赎回份额	261,063,981.27
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	648,247,688.99

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

本报告期,本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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 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新动力灵活配置混合型证券投资基金的文件;

2、《东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金合同》;

3、《东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

4、东方红新动力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
2016年1月20日

东方红优势精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

【2015】第四季度报告

基金管理人:上海东方证券资产管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月20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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月18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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方红优势精选灵活混合
场内简称	–
基金主代码	001712
前端交易代码	000712
基金运作方式	契约型开放式,发起式
基金合同生效日	2015年9月8日
报告期末基金份额总额	501,589,663.04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,在做好风险管理前上,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	中证800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,其预期风险与预期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10月1日 – 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	10,874,707.04
2.本期利润	29,892,250.18
3.加权平均基金份额本期利润	0.0496
4.期末基金资产净值	524,426,781.34
5.期末基金份额净