东方红纯债债券型发起式证券投资基金

2016 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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2017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2017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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方红纯债债券
基金主代码	001906
前端交易代码	001906
基金运作方式	契约型开放式、发起式
基金合同生效日	2015年10月26日
报告期末基金份额总额	1,009,029,692.76份
投资目标	本基金为纯债基金,主要通过分析影响债券市场的各类要素,对债券组合的平均久期、期限结构、类属品种进行有效配置,追求长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金将采用自上而下的方法,在充分研究基本宏观经济形势以及微观市场主体的基础上,对市场基本利率、债券类产品收益率、货币类产品收益率等大类产品收益率水平变化进行评估,并结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析,针对不同行业、不同投资品种选择投资策略,以此做出最佳的资产配置及风险控制。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:同期中国人民银行公布的一年期银行定期存款税后收益率+1.2%。
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	上海东方证券资产管理有限公司
基金托管人	招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(2016年10月1日 - 2016年12月31日)
1.本期已实现收益	4,009,740.95
2.本期利润	-11,420,323.57
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0113
4.期末基金资产净值	996,703,319.49
5.期末基金份额净值	0.988

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。

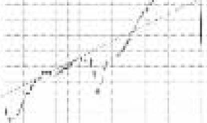
3.2 基金净值表现

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	-1.10%	0.11%	0.68%	0.01%	-1.78%	0.10%

注:过去三个月指2016年10月1日-2016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2016年12月31日。

(2)本基金建仓期6个月,即从2015年10月26日起至2016年4月25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		
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、东方红稳健精选混合型证券投资基金、东方红领先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、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、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红汇利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、东方红益鑫纯债债券型证券投资基金基金经理。	2015年10月26日	-	10年	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、销售交易经理,德邦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部副总经理;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、东方红信用债债券、东方红收益增强债券、东方红汇阳债券、东方红汇利债券、东方红稳添利纯债、东方红战略精选混合、东方红价值精选混合、东方红益鑫纯债债券基金经理。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》等规定。

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

债券市场10月中下旬开始的调整大大超出了市场的预期:从基本面因素来看,经济数据企稳,地产政策对地产投资增速的影响仍有时滞;供给侧改革以来境内大宗商品价格的快速上涨导致PPI大幅上行,原油动产协议以及中央经济工作会议提及的农产品供给侧改革都进一步推升了通胀预期;四季度人民币持续贬值,外汇占款下降,市场资金缺口增大,而央行"锁短放长"的投放抬升了市场资金成本,导致资金面极度紧张;表外理财规模将于明年一季度纳入MPA考核,将导致明年表外理财增速趋缓;美国大选以及美联储加息后,美元指数连创新高,美债收益率快速上行,也加剧了国内债市调整的压力。此轮调整在以上几方面因素的作用下,再叠加市场一些事件性冲击,从而后期的调整大超预期,更多体现为情绪上的宣泄,1个月的时间10年国债收益率回到了2015年2月的水平,从年初2.8%附近上升至3.4%。本基金在操作上,前期也适时降低了仓位和久期,操作思路上仍寻求稳健配置为主。

2017年我们需要关注以下风险点:(1)受制于美国加息压力,货币政策边际上有收紧的趋向,需要更加注意资金面的波动对市场的影响;(2)监管层去杠杆的决心,加强银行委外监管,或导致市场整体信用收缩,债券市场的需求较今年大幅减弱,极端情况下或给债券市场带来流动性风险;(3)美国仍然处于加息通道,目前看明年6月再次加息概率极大,市场或由此产生较大波动,给汇率造成一定压力,从而在资金面以及利率方面都给国内债市带来一定的压力。整体而言,2017年债券市场或波动较大,前期关注房地产投资增速对经济基本面的拖累以及通胀数据的变化,债券将由此产生趋势性机会。考虑到1月外汇流出以及信贷压力都较大,以及春节备付提现的需求,短期内债券市场仍以小幅震荡为主,操作上可以考虑逢调整适度加仓。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2016年12月31日,本基金份额净值为0.988元,份额累计净值为1.020元。报告期内,本基金份额净值增长率为-1.10%,同期业绩比较基准收益率为0.68%。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	919,309,651.06	92.19
	其中:债券	755,871,300.00	75.80
	资产支持证券	163,438,351.06	16.39
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	61,408,399.42	6.16
8	其他资产	16,526,193.70	1.66
9	合计	997,244,244.18	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金不参与股票投资。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金不参与股票投资

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

本基金不参与股票投资。

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	150,734,900.00	15.12
	其中:政策性金融债	108,849,000.00	10.92
4	企业债券	173,472,400.00	17.40
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	334,794,000.00	33.59
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	96,870,000.00	9.72
9	其他	-	-
10	合计	755,871,300.00	75.84

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	101651017	16平安不动MTN001	1,000,000	98,400,000.00	9.87
2	111610147	16兴业CD147	1,000,000	96,870,000.00	9.72
3	1580253	15国网债05	800,000	79,792,000.00	8.01
4	1082101	10中石油MTN2	700,000	69,762,000.00	7.00
5	101660021	16九龙江MTN001	600,000	58,284,000.00	5.85

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	123870	世贸天03	700,000	71,661,224.66	7.19
2	131137	远东五A2	800,000	45,777,126.40	4.59
3	116076	京东2优1	400,000	40,000,000.00	4.01
4	116132	深南优09	60,000	6,000,000.00	0.60

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

本基金不参与权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未进行国债期货投资。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未进行国债期货投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

本基金不参与股票投资。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,015.98
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,525,177.72
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,526,193.70

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金不参与股票投资。

5.10.6 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	1,009,032,424.30
报告期期间基金总申购份额	250.70
减:报告期期间基金总赎回份额	2,982.24
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	1,009,029,692.76

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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,450.04
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,450.04
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.99

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
1	认购	2015年10月20日	10,000,450.04	10,001,000.00	-
合计			10,000,450.04	10,001,000.00	

注:本基金管理人运用固有资金于本基金认购期内认购本基金10,000,450.04份(其中募集期间利息转增份额450.04份),按照招募说明书规定,认购费1000元。本报告期内,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	10,000,450.04	0.99	10,000,450.04	0.99	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	10,000,450.04	0.99	10,000,450.04	0.99	3年

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予注册东方红纯债债券型发起式证券投资基金的文件;
2、《东方红纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》;
3、《东方红纯债债券型发起式证券投资基金托管协议》;
4、东方红纯债债券型发起式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。

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
2017年1月20日

东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金

2016 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:2017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2017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2016年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方红产业升级混合
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	341,745,110.91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"一些行业";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(2016年10月1日 - 2016年12月31日)
1.本期已实现收益	4,622,171.73
2.本期利润	-3,456,443.68
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0103
4.期末基金资产净值	741,402,522.80
5.期末基金份额净值	2.169

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。

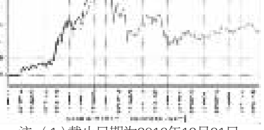
3.2 基金净值表现

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	-0.50%	0.73%	0.46%	0.52%	-0.96%	0.21%

注:过去三个月指2016年10月1日-2016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2016年12月31日。

(2)本基金建仓期6个月,即从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		
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、东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2015年6月26日	-	7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、东方红睿阳混合基金经理。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,基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

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

2016年,沪深300指数下跌11.28%,创业板指数下跌27.71%。其中食品饮料(7.56%)、家电(1.78%)、银行(0.69%)涨幅居前;传媒(-37.71%)、计算机(-36.12%)、餐饮旅游(27.81%)跌幅较多。本产品坚持价值精选的策略,跑赢沪深300指数和创业板指数,取得了一定的相对收益。

2016年四季度,外部环境依然压力较大,美元加息,人民币汇率出现进一步的贬值,全球主要市场出现流动性收紧的态势。由于供给侧改革等因素,化工等行业出现产品价格企稳回升,相关产业链表现较好,高估值标的依然在去泡沫的过程中。

展望2017年,宏观环境依旧将会错综复杂,中美贸易关系、欧洲政治前景、人民币汇率、国内低利率市场环境的持续性等方面扑朔迷离。在外部环境错综复杂的情况下,我们仍然会把主要精力放在:(1)优秀的蓝筹公司;(2)通过改革能够带来新活力、盈利较大改善的公司;(3)估值回落进入价值投资区间的优质成长股。

我们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,力争以合理的价格买入,追求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2016年12月31日,本基金份额净值为2.169元,份额累计净值为2.169元。报告期内,本基金份额净值增长率为-0.50%,同期业绩比较基准收益率为0.46%。

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	638,701,786.08	85.36
	其中:股票	638,701,786.08	85.36
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	69,327,518.80	9.27
8	其他资产	40,206,226.29	5.37
9	合计	748,235,531.17	100.00

注:本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	27,883,780.88	3.76
B	采矿业	-	-
C	制造业	495,729,882.86	66.86
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	41,635,788.64	5.62
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	35,367,824.15	4.77
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	30,119,342.71	4.06
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	7,965,166.84	1.07
S	综合	-	-
	合计	638,701,786.08	86.15

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

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	3,758,890	66,156,464.00	8.92
2	002415	海康威视	2,361,372	56,224,267.32	7.58
3	000333	美的集团	1,599,700	45,063,549.00	6.08
4	600297	广汇汽车	4,863,994	41,635,788.64	5.62
5	300058	蓝色光标	2,916,163	29,657,377.71	4.00
6	600066	宇通客车	1,506,449	29,511,335.91	3.98
7	000651	格力电器	1,166,320	28,714,798.40	3.87
8	600486	扬农化工	753,990	28,553,601.30	3.85
9	002311	海大集团	1,859,536	27,986,016.80	3.77
10	600660	福耀玻璃	1,470,493	27,395,284.59	3.70

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

本基金本报告期末未进行股指期货投资。

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。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

本基金本报告期末未进行国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未进行国债期货投资。

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	224,462.40
2	应收证券清算款	39,651,366.73
3	应收股利	-
4	应收利息	13,088.26
5	应收申购款	317,308.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	40,206,226.29

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	337,043,216.39
报告期期间基金总申购份额	53,166,399.15
减:报告期期间基金总赎回份额	48,464,504.63
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	341,745,110.91

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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	5,060,222.67
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(%)	1.47

注:本报告期,基金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

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
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: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发起式证券投资基金,按照招募说明书规定,申购费1000元。本报告期内,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
2017年1月20日

东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

2016 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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2017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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方红策略精选混合	
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	895,117,631.09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。	
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	894,998,013.21份	119,617.88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(2016年10月1日 - 2016年12月31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	2,371,099.79	108,978.93
2. 本期利润	-12,905,668.87	295,321.41
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0194	0.0094
4. 期末基金资产净值	954,713,308.60	121,503.02
5. 期末基金份额净值	1.067	1.016

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

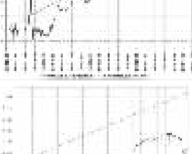
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.93%	0.13%	1.01%	0.01%	-1.94%	0.12%

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	-1.07%	0.24%	1.01%	0.01%	-2.08%	0.23%

注:过去三个月指2016年10月1日-2016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 2016 年12月31 日。

(2)本基金建仓期6个月,即从2015年6月5日起至2015年12月4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		
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、东方红稳健精选混合型证券投资基金、东方红领先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、东方红纯债债券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、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红汇利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、东方红益鑫纯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投资研究经理、销售交易经理,德邦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部副总监;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、东方红信用债债券、东方红收益增强债券、东方红汇阳债券、东方红汇利债券、东方红稳添利纯债、东方红战略精选混合、东方红价值精选混合、东方红益鑫纯债债券基金经理。具有基金从业资格,中国国籍。
饶刚	本基金基金经理,兼任上海东方证券资产管理有限公司副总经理、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金基金经理。	2016年7月28日	-	18年	硕士,曾任兴业证券股份有限公司职员,富国基金管理有限公司研究员、固定收益部总经理兼基金经理、总经理助理,富国资产管理(上海)有限公司总经理;现任上海东方证券资产管理有限公司副总经理兼任东方红策略精选混合、东方红汇阳债券、东方红汇利债券基金经理。具有基金从业资格,中国国籍。
孔令超	本基金基金经理,兼任东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金基金经理。	2016年8月5日	-	6年	硕士,曾任平安证券有限责任公司总部综合研究所策略研究员、国信证券股份有限公司经济研究所策略研究员,现任东方红策略精选混合、东方红汇阳债券、东方红汇利债券基金经理。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

四季度权益市场整体仍是震荡格局,上证综指上涨3.29%,而创业板指下跌8.74%。从节奏上看,四季度初随着经济出现一些企稳复苏的迹象,整体市场表现相对较强,一些周期股表现较好;另外在保险举牌等因素的催化下,一些低估值稳定的价值股也表现较好。但12月份开始,随着美国加息临近带来的国内货币收紧压力,以及监管层对保险举牌的规范监管,多重因素下市场逐步回调。本产品在操作上,坚持价值投资理念,基础仓位以稳健增长且估值合理的价值股为主要配置方向。同时根据宏观环境的变化进行一些相应的配置调整,配置一些受益于经济阶段企稳和通胀阶段回升的周期性品种和以降低整体组合的波动,提高组合收益。

债券市场10月中下旬开始的调整大大超出了市场的预期:从基本面因素来看,经济数据企稳,地产政策对地产投资增速的影响仍有时滞;供给侧改革以来境内大宗商品价格的快速上涨导致PPI大幅上行,原油动产协议以及中央经济工作会议提及的农产品供给侧改革都进一步推升了通胀预期;四季度人民币持续贬值,外汇占款下降,市场资金缺口增大,而央行"锁短放长"的投放抬升了市场资金成本,导致资金面极度紧张;表外理财规模将于明年一季度纳入MPA考核,将导致明年表外理财增速趋缓;美国大选以及美联储加息后,美元指数连创新高、美债收益率快速上行,也加剧了国内债市调整的压力。此轮调整在以上几方面因素的作用下,再叠加市场一些事件性冲击,从而后期的调整大超预期,更多体现为情绪上的宣泄,1个月的时间10年国债收益率回到了2015年2月的水平,从年初2.8%附近上升至3.4%。本产品在操作上,前期也适时降低了仓位和久期,操作思路上仍寻求稳健配置为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2016年12月31日,本基金A类份额净值为1.067元,份额累计净值为1.067元,C类份额净值为1.016元,份额累计净值为1.016元。报告期内,本基金A类份额净值增长率为-0.93%,同期业绩比较基准收益率为1.01%,C类份额净值增长率为-1.07%,同期业绩比较基准收益率为1.01%。

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	101,393,969.27	10.60
	其中:股票	101,393,969.27	10.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	657,722,858.60	68.79
	其中:债券	657,722,858.60	68.79
	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	178,400,407.60	18.66
	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	12,192,329.19	1.28
8	其他资产	6,404,599.68	0.67
9	合计	956,114,164.34	100.00

注:本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	2,831,282.56	0.30
B	采矿业	4,180,004.00	0.44
C	制造业	70,760,105.48	7.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,849,793.00	0.72
E	建筑业	15,592.23	0.00
F	批发和零售业	2,995,500.00	0.31
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	13,761,692.00	1.44
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	101,393,969.27	10.62

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

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

代码	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	002415	海康威视	325,000	7,738,250.00	0.81
2	000001	平安银行	600,000	5,460,000.00	0.57
3	600036	招商银行	284,600	5,008,960.00	0.52
4	600875	东方电气	400,000	4,316,000.00	0.45
5	002595	豪迈科技	200,000	4,210,000.00	0.44
6	002475	立讯精密	200,000	4,150,000.00	0.43
7	600900	长江电力	315,300	3,991,698.00	0.42
8	603001	奥康国际	171,200	3,920,480.00	0.41
9	600066	宇通客车	200,000	3,918,000.00	0.41
10	600104	上汽集团	166,000	3,892,700.00	0.41

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	28,993,500.00	3.04
2	央行票据	-	-
3	金融债券	69,435,000.00	7.27
	其中:政策性金融债	19,970,000.00	2.09
4	企业债券	509,516,960.20	53.36
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	1,707,398.40	0.18
8	同业存单	48,070,000.00	5.03
9	其他	-	-
10	合计	657,722,858.60	68.88

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	136830	16中信G1	500,000	49,465,000.00	5.18
2	111698940	16徽商银行CD100	500,000	48,070,000.00	5.03
3	112469	16涪陵02	400,000	40,000,000.00	4.19
4	136810	16福新02	400,000	38,620,000.00	4.04
5	112468	16景峰01	300,000	29,829,000.00	3.12

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。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	30,138.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,374,460.79
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,404,599.68

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	600875	东方电气	4,316,000.00	0.45	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	11,727,756.59	100,100,200.40
报告期期间基金总申购份额	883,320,257.26	19,417.48
减:报告期期间基金总赎回份额	50,000.64	100,000,000.00
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	894,998,013.21	119,617.88

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

东方红策略精选混合A

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	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.12

东方红策略精选混合C

单位:份

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

注:基金管理人持有本基金份额占总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额。

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
1	认购	2015年6月2日	10,000,000.00	10,001,000.00	-
合计			10,000,000.00	10,001,000.00	

注:上述基金管理人运用固有资金于2015 年6月2日认购东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金,按照招募说明书规定,认购费1000元。

§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	1.12	10,000,000.00	1.12	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	1.12	10,000,000.00	1.12	3年

注:截止日期2016年12月31日,报告期末发起式基金发起资金持有份额占基金总份额的计算中,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

§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、东方红策略精选灵活配置混合型发起式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。

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
2017年1月20日