# 东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金 2016年年度报告摘要

2016年12月31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:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2017年3月30日

## §1 重要提示

1.1 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。本年度报告由董事长签发。

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3月24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。

本报告期自2016年01月01日起至12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

## §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 东方红中国优势混合 |
| 基金主代码 | 001112 |
| 前端交易代码 | 001112 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年4月7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 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 3,956,944,575.60份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金在国家深化改革、经济结构转型的背景下,积极挖掘符合改革方向,有国际竞争力的行业和企业,严控风险,力争实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金通过动态跟踪海内外主要经济体的GDP、CPI、利率等宏观经济指标,以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等市场指标,确定未来市场变动趋势。本基金通过全面评估上述各种实证指标的变动趋势,对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测,根据上述定性和定量指标的分析结果,运用资产配置优化模型,在目标收益条件下,追求风险最小化目标,最终确定大类资产投资权重,实现资产合理配置。 |
| 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。其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。 |

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 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 唐涵颖 | 郭明 |
| | 联系电话 | 021-63325888 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | service@dfham.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话? | | 4009200808 | 95588 |
| 传真 | | 021-63326981 | 010-66105798 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.dfham.com |
| 基金年度报告备置地点 | 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<br>中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街55号 |

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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 | 2016年 | 2015年4月7日(基金合同生效日)~2015年12月31日 |
|---|---|---|
| 本期已实现收益 | -37,563,740.48 | 199,113,735.63 |
| 本期利润 | -203,647,103.06 | 561,816,358.54 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0394 | 0.0587 |
| 本期基金份额净值增长率 | -2.53% | -9.30% |
| 3.1.2?期末数据和指标 | 2016年末 | 2015年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0114 | 0.0112 |
| 期末基金资产净值 | 4,110,717,280.73 | 6,203,834,366.01 |
| 期末基金份额净值 | 1.039 | 1.066 |

注:1、表中的“期末”均指报告期最后一日,即12月31日;“本期”指2016年1月1日-2016年12月31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。

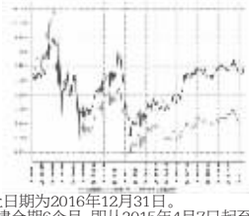
3.2 基金净值表现

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

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 2.26% | 0.67% | -0.12% | 0.52% | 2.38% | 0.15% |
| 过去六个月 | 7.56% | 0.72% | 2.53% | 0.55% | 5.03% | 0.17% |
| 过去一年 | -2.53% | 1.32% | -9.43% | 1.07% | 6.90% | 0.25% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.90% | 1.54% | -13.24% | 1.48% | 17.14% | 0.06% |

[illegible]

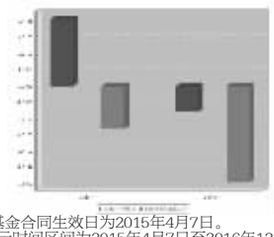
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:(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4月7日起至2015年10月6日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:1、本基金合同生效日为2015年4月7日。

2、本图所示时间区间为2015年4月7日至2016年12月31日。

3、合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自2015年4月7日(基金合同生效日)至2016年12月31日未进行利润分配。

## §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2016年12月31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、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、东方红睿轩沪港深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、东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金、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二十六只证券投资基金。

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 任职日期 | 离任日期 | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 林鹏 | 本基金基金经理,兼任上海东方证券资产管理有限公司董事总经理、公募权益投资决策委员会主席。现任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、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金、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。 | 2016年3月18日 | - | 19年 | 硕士,曾任东方证券研究所研究员、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决策委员会委员、专户投资决策委员会委员、执行董事;现任上海东方证券资产管理有限公司董事总经理、公募权益投资决策委员会主席兼任东方红睿丰基金、东方红睿阳基金、东方红睿元三年定期开放混合、东方红睿逸定期开放混合、东方红沪港深灵活配置混合、东方红沪港深灵活配置混合、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。 |
| 王延飞 | 本基金基金经理,兼任东方红产业升级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证券投资基金基金经理。 | 2015年6月8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高级研究员;现任东方红产业升级混合、东方红睿逸定期开放混合、东方红睿阳混合基金经理。具有基金从业资格,中国国籍。 |
| 秦绪文 | 本基金基金经理。 | 2016年1月22日 | - | 10年 | 硕士,曾任平安证券有限公司证券研究所分析师。东方证券股份有限公司证券研究所董事、汽车行业分析师。上海东方证券资产管理有限公司研究海外研究员、权益研究部资深研究员;现任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。 |
| 杨达治 | 前任基金经理 | 2015年4月7日 | 2016年1月29日 | 15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、公募权益投资部总监;现任公司董事总经理、权益研究部总监。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。

3、对于报告期内离任的基金经理,“职务”栏内填写的为离任前的职务。

4、基金管理人于2016年1月29日公告,杨达治先生于2016年1月29日离任本基金的基金经理。

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规关于公平交易的规定,公司建立了与公平交易相关的控制制度、流程以及信息披露程序等,保证公司在投资管理活动中公平对待各投资组合,防范不同投资组合之间进行利益输送,并定期对同向交易、反向交易和异常交易行为进行监控和分析。交易部使用恒生交易系统中的公平交易模块进行交易执行和分配,合规与风险管理部对公司各投资组合及组合之间的交易行为进行事后分析,校验公平交易执行情况。对于同向交易,合规与风险管理部侧重于对公司管理的不同产品(包含了公募产品、私募产品)的整体收益率差异、投资类别(股票、债券)的收益率差异进行分析,对连续四个季度期间内交易所竞价交易的所有交易记录,在不同时间窗下(日内、3日内、5日内)的同向交易价差按两两组合进行显著性检验,并根据显著性检验结果,对符合异常交易筛选条件并超过规定阀值的交易记录,通过逐笔检查或抽样分析的方法,分析相应交易行为的公平性。对同一投资人员管理的不同产品,则持续监控和跟踪其同向交易价差,如价差显著不为零,则在逐笔分析相关交易记录的基础上,对投资人员进行访谈,要求其进行相关的解释和说明,以更为审慎地判断其合理性。对于反向交易,除程序化交易外原则上禁止组合内部及组合之间的日内反向交易,如有投资策略或流动性等特殊需要的,需由投资经理提供投资依据,经投资决策委员会审慎审批后留档备查。本年度未发现公司管理的投资组合间存在违反公平交易原则的交易行为。

4.3.2 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。

4.3.3 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。

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 管理人对报告期内本基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 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。

4.4.2 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1.039元,份额累计净值为1.039元。报告期内,本基金份额净值增长率为-2.53%,同期业绩比较基准收益率为-9.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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。在不确定性中寻找确定性的机会,会是超额收益的来源。接下来我们会关注:第一:行业龙头公司。经济发展到当前阶段,经济增速、人口结构、环保压力等外部环境约束下,很多行业步入到整合时期,具有成本优势、网络效应、高客户粘性等核心竞争力的行业龙头公司会在存量市场下,进一步提高自己的市占率。第二:通过改革能够带来新活力、盈利较大改善的公司;第三:成长股经过一年多时间的调整,有一些优秀的公司已经回落到观察区间,保持跟踪和等待。

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。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,对基金所持有的投资品种进行估值,本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金份额净值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务,本基金管理人对估值和定价过程进行了严格的控制。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上,确定本基金管理人采用的估值政策。本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历,具有基金从业人员资格。同时,公司设估值决策小组,成员包括:公司总经理、合规总监(或督察长)、交易总监、运营总监、基金会计主管等。基金经理不参与基金日常估值业务,对于属于东证资管估值政策范围内的特殊估值变更可参与讨论,但最终决策由估值决策小组讨论决策并联名审批。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署提供中债收益率曲线和中债估值的服务协议,由其按约定提供银行间同业市场债券品种的估值数据。

本报告期内,参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配应遵循下列原则:1、本基金的每份基金份额享有同等分配权;2、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益每年最多分配6次,每份基金份额每次收益分配比例不低于收益分配基准日每份基金份额截至收益分配基准日可供分配利润的25%;3、若《基金合同》生效不满3个月则可不进行收益分配;4、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;5、基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;6、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,基金管理人可对基金收益分配原则进行调整,不需召开基金份额持有人大会。本基金本报告期未进行利润分配。

本基金本报告期未进行利润分配。

本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明,在本报告期内,基金托管人——工商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对上海东方证券资产管理有限公司编制和披露的东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

## §6 审计报告

本报告期基金财务报告经立信会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师王斌、唐成签字出具了信会师报字[2016]第130171号标准无保留意见的审计报告。

投资者可通过本基金年度报告正文查看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2016年12月31日

单位:人民币元

| 资?产 | 本期末 2016年12月31日 | 上年度末 2015年12月31日 |
|---|---|---|
| 资?产: | | |
| 银行存款 | 70,448,607.68 | 415,327,269.64 |
| 结算备付金 | 258,338,908.59 | 253,418,461.90 |
| 存出保证金 | 777,900.60 | 3,852,128.85 |
| 交易性金融资产 | 3,596,242,555.89 | 5,579,313,231.82 |
| 其中:股票投资 | 3,596,242,555.89 | 5,579,313,231.82 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | - | - |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 172,500,000.00 | - |
| 应收证券清算款 | 68,673,437.84 | 17,097,981.13 |
| 应收利息 | 181,972.90 | 173,510.26 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 44,773.93 | 666,889.13 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 4,167,208,157.43 | 6,269,849,472.73 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2016年12月31日 | 上年度末 2015年12月31日 |
| 负?债: | | |
| 短期借款 | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - |
| 应付证券清算款 | 28,119,708.07 | - |
| 应付赎回款 | 11,340,612.11 | 48,827,436.25 |
| 应付管理人报酬 | 5,308,907.23 | 8,545,238.08 |
| 应付托管费 | 894,817.86 | 1,424,206.38 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 10,641,199.19 | 6,844,770.44 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 195,632.24 | 373,455.57 |
| 负债合计 | 56,490,876.70 | 66,015,106.72 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 3,956,944,575.60 | 5,817,608,319.09 |
| 未分配利润 | 153,772,705.13 | 386,226,046.92 |
| 所有者权益合计 | 4,110,717,280.73 | 6,203,834,366.01 |
| 负债和所有者权益总计 | 4,167,208,157.43 | 6,269,849,472.73 |

注:1.本基金于2015年4月7日成立,无上年度末可比数据。

2.报告截止日2016年12月31日,基金份额净值1.039元,基金份额总额3,956,944,575.60。

7.2 利润表

会计主体:东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

| 资?产 | 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 | 上年度可比期间 2015年4月7日(基金合同生效日)至2015年12月31日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | -98,376,187.61 | 730,443,134.43 |
| 1.利息收入 | 7,231,740.75 | 21,328,028.04 |
| 其中:存款利息收入 | 5,833,703.33 | 17,152,377.14 |
| 债券利息收入 | - | 1,025.31 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 1,398,037.42 | 4,174,625.59 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) | 58,726,887.38 | 321,079,880.33 |
| 其中:股票投资收益 | -25,323,657.46 | -26,324,078.38 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | - | 5,512,438.59 |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 贵金属投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | 241,733,500.00 |
| 股利收益 | 84,050,544.84 | 100,158,020.12 |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | -166,083,362.58 | 362,702,622.91 |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列) | 1,748,546.84 | 25,332,603.15 |
| 减:二、费用 | 105,270,915.45 | 168,626,775.89 |
| 1. 管理人报酬 | 75,128,812.50 | 105,074,901.27 |
| 2. 托管费 | 12,521,468.71 | 17,512,483.51 |
| 3. 销售服务费 | - | - |
| 4. 交易费用 | 17,448,680.90 | 45,848,621.35 |
| 5. 利息支出 | - | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6. 其他费用 | 171,953.34 | 190,769.76 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | -203,647,103.06 | 561,816,358.54 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | -203,647,103.06 | 561,816,358.54 |

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 5,817,608,319.09 | 386,226,046.92 | 6,203,834,366.01 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润) | - | -203,647,103.06 | -203,647,103.06 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | -1,860,663,743.49 | -28,806,238.73 | -1,889,469,982.22 |
| 其中:1.基金申购款 | 137,297,288.13 | -6,741,330.10 | 130,555,958.03 |
| 2.基金赎回款 | -1,997,961,031.62 | -22,064,908.63 | -2,020,025,940.25 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | - | - |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 3,956,944,575.60 | 153,772,705.13 | 4,110,717,280.73 |

| 项目 | 上年度可比期间 2015年4月7日(基金合同生效日)至2015年12月31日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | - | - | - |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 561,816,358.54 | 561,816,358.54 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | 5,817,608,319.09 | -175,590,311.62 | 5,642,018,007.47 |
| 其中:1.基金申购款 | 14,502,868,084.14 | 39,924,315.40 | 14,542,792,399.54 |
| 2.基金赎回款 | -8,685,259,765.05 | -215,514,627.02 | -8,900,774,392.07 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | - | - |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 5,817,608,319.09 | 386,226,046.92 | 6,203,834,366.01 |

注:报表附注为财务报表的组成部分。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

陈光明 任莉

詹明

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2015]232号文)准予注册,由上海东方证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2015年4月7日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定期。本基金的基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。本基金于2015年3月30日至2015年4月1日向社会公开募集, 扣除认购费后的有效认购资金13,855,423,631.41元,利息转份额695,089.56元,募集规模为13,856,118,720.97份。上述募集资金已由立信会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了验资报告。根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、债券(含中小企业私募债)、中期票据、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的0%—95%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%;本基金投资于中国优势相关的证券不低于非现金基金资产的80%。

本基金的业绩比较基准为:中证800指数收益率*70%+中国债券总指数收益率*30%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2016年12月31日的财务状况以及2016年1月1日至2016年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 于2016年5月1日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 上海东方证券资产管理有限公司(“东证资管”) | 基金管理人、基金销售机构 |
| 工商银行股份有限公司(“工商银行”) | 托管人、基金代销机构 |
| 东方证券股份有限公司(“东方证券”) | 基金管理人的股东、基金代销机构 |

注:1、本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 | | 上年度可比期间 2015年4月7日(基金合同生效日)至2015年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 东方证券 | 6,863,150,650.65 | 54.74% | 29,414,759,975.27 | 90.97% |

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 | | 上年度可比期间 2015年4月7日(基金合同生效日)至2015年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 |
| 东方证券 | - | - | 17,208,463.90 | 100.00% |

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 | | 上年度可比期间 2015年4月7日(基金合同生效日)至2015年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 回购成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 回购成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 东方证券 | 11,408,800,000.00 | 100.00% | 54,975,600,000.00 | 100.00% |

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 东方证券 | 5,019,013.59 | 54.74% | 9,896,125.26 | 93.00% |

| 关联方名称 | 上年度可比期间 2015年4月7日(基金合同生效日)至2015年12月31日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 东方证券 | 26,148,383.77 | 92.46% | 4,877,111.67 | 71.25% |

注:1.上述佣金按市场佣金率计算,扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括:为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

2.截至报告期末,本公司因作为证券公司子公司尚未获得在上海交易所租用其他券商交易单元的资格,此事已向中国证监会报告,并等待进一步指示与解决;本公司已在深圳交易所获得租用券商交易单元的资格,并已按公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 | 上年度可比期间 2015年4月7日(基金合同生效日)至2015年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 75,128,812.50 | 105,074,901.27 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | - | 56,335,342.50 |

注:1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%的年费率计提。管理费的计算方法下:

H=E×1.5%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。

2、实际支付销售机构的客户维护费以本基金管理人和各销售机构对账确认的金额为准。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 | 上年度可比期间 2015年4月7日(基金合同生效日)至2015年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 12,521,468.71 | 17,512,483.51 |

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值 基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内及上年度可比期间本基