

东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

本基金管理人：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...

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10月24日复核了本报告中...

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...

基金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。

本报告自2017年7月1日起至9月30日止。

2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称 (Fund Name) and 基金代码 (Fund Code). Includes details for 东方红新动力混合.

投资目标: 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增值。

投资策略: 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...

业绩比较基准: 沪深300指数收益率\*70%+中国债券总收益率\*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...

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

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators) and 报告期 (Reporting Period).

注: (1)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...

(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...

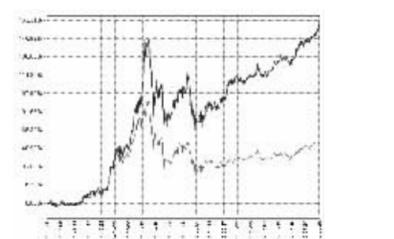
3.2 基金净值表现

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

Table with 5 columns: 阶段 (Period), 净值增长率① (Net Return), 净值增长率基准② (Benchmark Return), 业绩比较基准收益③ (Benchmark Return), 业绩比较基准收益④ (Benchmark Return).

注: 过去三个月即2017年7月1日至2017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2017年9月30日。(2)本基金建仓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符合基金合同约定。

4 管理人报告

4.1 基金运作(或基金管理人)简介

Table with 4 columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任职日期 (Start Date), 离任日期 (End Date).

注: (1)上述报告期内基金基金经理“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。

(2)证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内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》、基金合同及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,无损害基金份额持有人利益的行为,本基金投资组合符合有关法律法规及基金合同约定的投资范围,基金资产投资运作符合有关法律法规及基金合同约定的投资范围,基金资产投资运作符合有关法律法规及基金合同约定的投资范围...

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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对手开仓日期与反向交易或成交较多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

三季度在宏观层面较为稳定的背景下,市场风险偏好逐渐上升,市场整体活跃度提升,沪深300指数上涨4.63%,创业板指数上涨4.04%,分行业来看,钢铁、有色金属、食品饮料等行业表现较好,涨幅超过10%,传媒、公用事业、纺织服装、医药生物等各个行业收益各异。三季度市场活跃度超过我们之前的预期,本产品资产配置较为均衡,单季度上涨6.32%。

展望未来,我们依然维持自下而上的选股策略,在海外配置资金的推动下,绝大多数一线白马股的估值在此背景下,二三线低估值个股性价比日益突出,我们特别关注一些基本面质地优秀而受益于外部环境的公司。在组合管理的大方向上,我们坚持逐步降低前期涨幅过大通过多轮估值调整的个股或性价比不高的高股,争取更为客户创造长期稳定的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2017年9月30日,本基金份额净值为2.439元,份额累计净值2.527元;本报告期基金份额净值增长率为6.32%,同期业绩比较基准收益率为3.11%。

4.6 报告期内基金持有人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人数不满二百人或基金资产净值低于五千万元的情况。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 金额(元) (Amount), 占基金总资产的比例(%) (Percentage).

注:本基金本报告期末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港股通投资股票投资组合

Table with 4 columns: 代码 (Code), 行业类别 (Sector), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

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

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量(股) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

5.4 报告期末按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

本基金本报告期末未进行股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未进行国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 投资组合报告附注

5.11.2 投资组合报告附注

5.11.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额(元) (Amount).

注:以上分类采用全球行业分类标准(Global Industry Classification Standard, GICS)。

5.2 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

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量(股) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

5.4 报告期末按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

本基金本报告期末未进行股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未进行国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 投资组合报告附注

5.11.2 投资组合报告附注

5.11.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额(元) (Amount).

注:以上分类采用全球行业分类标准(Global Industry Classification Standard, GICS)。

5.2 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

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量(股) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

5.4 报告期末按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

本基金本报告期末未进行股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未进行国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 投资组合报告附注

5.11.2 投资组合报告附注

5.11.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额(元) (Amount).

注:以上分类采用全球行业分类标准(Global Industry Classification Standard, GICS)。

5.2 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

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量(股) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

5.4 报告期末按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

本基金本报告期末未进行股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未进行国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 投资组合报告附注

5.11.2 投资组合报告附注

5.11.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额(元) (Amount).

注:以上分类采用全球行业分类标准(Global Industry Classification Standard, GICS)。

5.2 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

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量(股) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

5.4 报告期末按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

本基金本报告期末未进行股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未进行国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 投资组合报告附注

5.11.2 投资组合报告附注

5.11.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额(元) (Amount).

注:以上分类采用全球行业分类标准(Global Industry Classification Standard, GICS)。

5.2 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

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量(股) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

5.4 报告期末按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

本基金本报告期末未进行股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未进行国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 投资组合报告附注

5.11.2 投资组合报告附注

5.11.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额(元) (Amount).

注:以上分类采用全球行业分类标准(Global Industry Classification Standard, GICS)。

5.2 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

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量(股) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

5.4 报告期末按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

本基金本报告期末未进行股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未进行国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 投资组合报告附注

5.11.2 投资组合报告附注

5.11.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额(元) (Amount).

注:以上分类采用全球行业分类标准(Global Industry Classification Standard, GICS)。

5.2 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

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量(股) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

5.4 报告期末按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

本基金本报告期末未进行股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未进行国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 投资组合报告附注

5.11.2 投资组合报告附注

5.11.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额(元) (Amount).

注:以上分类采用全球行业分类标准(Global Industry Classification Standard, GICS)。

5.2 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

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量(股) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

5.4 报告期末按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