

东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金 2017年第1季度报告

2017年3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:招商银行股份有限公司

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。

基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期末资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金份额总额 323,991,239.17份

本报告期末基金份额净值 1.004元

本报告期末基金份额持有人数量 1,000人

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

本报告期末基金资产净值 323,991,239.17元

0.06%。 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。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

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

Table with 3 columns: 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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, 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(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

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

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

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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.12 开放式基金份额变动

Table with 3 columns: 项目, 基金份额(份), 份额变动原因

注: (1) 上述表格内基金净值基金管理人“任职日期”指基金合同生效日,“离任日期”指根据基金合同规定确定的解聘日期; (2) 证券从业的认定遵从行业协会《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

本报告期内,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,无损害基金份额持有人利益的行为,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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

4.3.3 异常交易专项说明

4.3.4 异常交易专项说明

4.3.5 异常交易专项说明

4.3.6 异常交易专项说明

4.3.7 异常交易专项说明

4.3.8 异常交易专项说明

4.3.9 异常交易专项说明

东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金 2017年第1季度报告

2017年3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:招商银行股份有限公司

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。

基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期末资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金份额总额 1,391,040,870.93份

本报告期末基金份额净值 1.000元

本报告期末基金份额持有人数量 1,000人

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

本报告期末基金资产净值 1,391,040,870.93元

改组的预期,另外海外方面短期资金外流压力也有,但6月份会面临美联储是否再加息的考验。因此整体上,一季度的权益市场仍会有一些结构性的投资机会。未来仍然以长期稳健增长、估值合理的价值股,以及一些稳健分红的股票为主要配置方向,把握权益市场的投资机会。

一季度债券市场自央行于春节前上调公开市场操作利率开始进入了新一轮的调整,各期限品种均突破前期高点。从影响因素来看,主要如下:地产从一二线城市向三四线城市外溢明显,三四线城市量价齐升,火爆行情超预期,引起大家对地产投资增速快速下滑的担忧;PPI冲高,引发市场对通胀的担忧;货币政策收紧,利率中枢抬升,MPA考核从严引发市场担心;金融监管升级,去杠杆成为今年主题,市场对将要出台的监管新规较为担忧;美联储3月加息的冲击。本产品在操作上,前期也适时调整了仓位和久期。市场经历一季度持续调整后,绝对收益已具备较好的配置价值。展望二季度,经济数据的持续性有待检验,货币政策仍维持“稳健中性”,金融监管措施也将逐步落地,6月美联储加息或再次给市场带来扰动,短期内市场或仍维持区间震荡的走势,但市场机会或逐步呈现。操作上仍以稳健为主,精选个股,争取获取稳定的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2017年3月31日,本基金A类份额净值为1.0066元,份额累计净值为1.0066元,C类份额净值为1.0041元,份额累计净值为1.0041元。报告期内,本基金A类份额净值增长率为2.16%,同期业绩比较基准收益率为0.37%,C类份额净值增长率为2.05%,同期业绩比较基准收益率为0.37%。

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。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

注:通过港股通交易机制持有的港股期末公允价值为211,261,823.48元,占基金资产净值比例15.08%。

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

Table with 3 columns: 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

Table with 3 columns: 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

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, 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(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

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

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

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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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