华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金管理人:华润元大基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司
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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19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	华润元大中创100ETF
场内简称	中创100
交易代码	159942
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015年5月25日
报告期末基金份额总额	51,993,705.00份
投资目标	本基金采用被动式投资策略,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准表现相当,以便为投资者带来长期收益。
投资策略	本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,基金管理人会对投资组合进行适当调整,降低跟踪误差。 如有因受股票停牌、股票流动性或其他一些影响指数复制的市场因素的限制,使基金管理人无法依指数权重购买成份股,基金管理人可以根据市场情况,结合经验判断,对投资组合进行适当调整,以获得更接近标的指数的收益率。 定期调整:本基金股票组合根据所跟踪的中创100指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。 不定期调整:根据指数编制规则,中创100指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时,本基金将根据中创100指数在股权变动公告日次日发布的临时调整决定及其需调整的权重比例,进行相应调整。 本基金将采用货币市场工具对基金资产进行流动性管理,在满足安全性和保证流动性的基础上,本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略,有效利用基金资产,更好地实现跟踪标的指数的投资目标。同时,根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数。 为有效管理投资组合,基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生产品,如股指期货、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的衍生工具。基金投资于衍生工具的目标,是使得基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数,以便更好地实现基金的投资目标。基金投资于各种衍生工具的比例合计不超过基金资产总值的10%。基金拟投资于新推出的金融衍生产品的,需将有关投资方案通知基金托管人,并报告中国证监会备案后公告。在正常市场情况下,本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年跟踪误差不超过2%。
业绩比较基准	中创100指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,为证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。同时本基金为交易型开放式指数基金,采用完全复制法跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。
基金管理人	华润元大基金管理有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司

§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	486,036.48
2.本期利润	28,812,316.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.5105
4.期末基金资产净值	123,479,073.00
5.期末基金份额净值	2.375

注:1.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。

2.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。

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	24.93%	2.16%	23.94%	2.19%	0.99%	-0.03%

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:本基金合同于2015年5月25日生效,截至报告期末,本基金基金合同生效未满一年。按基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

§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		
杨伟	华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金基金经理、华润元大富时中国A50指数型证券投资基金基金经理、华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金基金经理、华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理	2015年5月25日	-	7年	曾任兴业证券股份有限公司风险管理专员、平安信托有限责任公司金融工程及量化投资研究员。2014年11月20日起担任华润元大富时中国A50指数型证券投资基金基金经理。2015年5月8日起担任华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金基金经理。2015年5月25日起担任华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015年12月23日起担任华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。中国、厦门大学经济学博士,具有基金从业资格。

注:1.基金经理任职日期和离任日期为公司作出决定后正式对外公告之日;担任新成立基金的基金经理,即基金的首任基金经理,其任职日期为基金合同生效日。

2.证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中的相关规定。

4.2 管理人对投资期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,基金管理人严格遵守法律法规及公司内部制度关于公平交易的相关规定,在投资管理活动中公平对待不同投资组合,公平交易制度执行情况良好,未发生违反公平交易制度的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年第四季度股票市场经过第三季度的大幅调整后迎来了反弹,以创业板为代表的小盘成长板块反弹幅度较大。创业板指数上涨30.32%,中小板指数上涨23.81%,上证综指上涨15.93%,沪深300指数上涨16.49%,上证50指数上涨12.80%,富时中国A50指数上涨14.82%,中信一级29个行业中综合(62.80%)、计算机(54.99%)、房地产(45.84%)板块较强,涨幅前三;而钢铁(6.54%)、银行(11.52%)、交通运输(12.02%)板块走势明显较弱,涨幅居后。

本基金作为被动指数型基金,报告期内,本基金采用完全复制法紧密跟踪中创100指数,取得与业绩比较基准基本一致的业绩表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为2.375元,本报告期份额净值增长率为24.93%,同期业绩比较基准收益率为23.94%;报告期内,本基金的日均跟踪偏离度为0.05%,在合同规定的目标控制范围之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年宏观经济依然面临较大的下行压力,为实现全年经济增长目标政策有望更加积极。一方面,货币政策将继续保持宽松,除常规降准降息之外,将继续通过地方政府债务置换、专项金融债以及城投债加速发行等推动社会融资总量扩张;另一方面,财政政策将有效发力,财政赤字率将突破3%。中央经济工作会已经确定"去产能、去库存、去杠杆、降成本、补短板"五大任务,供给侧改革将会逐步落地。下一步值得警惕的时间窗口期是3-4月,美联储加息、去产能去杠杆、注册制等各类不利影响集中出现。

2016年,机遇与风险并存的股票市场有望在曲折中震荡前行,资金面总体较为宽松有望推动无风险利率继续下行,这将有助于推动大类资产配置转向权益类市场,创新驱动有望推动中国经济加速转型,这些有利因素有望将对市场形成支撑;同时,实体经济仍面临较大的下行压力,在刚性兑付逐步打破的情况下信用风险存在蔓延可能,注册制推出可能加大市场供给压力,这些不利因素可能对市场形成压力。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金不存在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	122,271,560.02	98.68
	其中:股票	122,271,560.02	98.68
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,234,309.41	1.00
7	其他资产	406,475.48	0.33
8	合计	123,912,344.91	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	333,902.00	0.27
B	采矿业	-	-
C	制造业	63,798,990.00	51.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,002,961.00	3.24
F	批发和零售业	3,844,010.00	3.11
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	27,355,292.74	22.15
J	金融业	7,173,467.68	5.81
K	房地产业	808,144.00	0.65
L	租赁和商务服务业	5,176,846.84	4.19
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,026,232.00	2.45
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	676,902.36	0.55
R	文化、体育和娱乐业	6,074,811.40	4.92
S	综合	-	-
	合计	122,271,560.02	99.02

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	300059	东方财富	78,300	4,073,949.00	3.30
2	300104	乐视网	69,100	4,063,080.00	3.29
3	002024	苏宁云商	285,800	3,844,010.00	3.11
4	002450	康得新	87,900	3,348,990.00	2.71
5	002415	海康威视	92,700	3,187,953.00	2.58
6	002202	金风科技	110,700	2,522,853.00	2.04
7	300027	华谊兄弟	58,400	2,422,432.00	1.96
8	002594	比亚迪	36,700	2,363,480.00	1.91
9	300024	机器人	34,000	2,329,000.00	1.89
10	002673	西部证券	69,500	2,287,245.00	1.85

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注: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

注: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

注: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

注: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

注: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

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

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

注: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	405,584.55
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	890.93
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	406,475.48

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换债券。

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	300104	乐视网	4,063,080.00	3.29	重大资产重组

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,投资组合报告中数字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	61,493,705.00
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	9,500,000.00
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	51,993,705.00

§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

注:本报告期内基金管理人未持有本基金份额,且报告期内基金管理人持有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

注: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、中国证监会关于核准本基金募集的批复;

2、本基金基金合同;

3、本基金托管协议;

4、本报告期内在指定报刊上披露的各项公告。

8.2 存放地点

以上备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所。

8.3 查阅方式

基金持有人可在办公时间到基金管理人和基金托管人的办公场所或网站免费查阅。

华润元大基金管理有限公司
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

2015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.期末基金份额净值	1.046

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	4.91%	0.85%	13.81%	1.20%	-8.90%	-0.35%

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9月8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9月8日起至2016年3月7日,至本报告期末,本基金尚处于建仓期。

§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		
刚登峰	本基金基金经理,兼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、东方红优势精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理	2015年9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部高级研究员、投资经理助理,资深研究员、投资主办人;现任东方红睿丰混合、东方红睿阳混合、东方红睿元混合、东方红策略精选混合、东方红优势精选混合基金经理。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 管理人对投资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,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。

4.4 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杀鸡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。

我们将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	462,721,397.74	86.73
	其中:股票	462,721,397.74	86.73
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	70,324,706.72	13.18
8	其他资产	463,733.53	0.09
9	合计	533,509,837.99	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	16,418,016.00	3.13
B	采矿业	-	-
C	制造业	294,080,516.52	56.08
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	-	-
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	27,208,779.36	5.19
J	金融业	26,763,823.00	5.10
K	房地产业	98,140,870.65	18.71
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	109,392.21	0.02
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	462,721,397.74	88.23

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	000651	格力电器	2,191,700	48,984,495.00	9.34
2	600066	宇通客车	1,930,200	43,410,198.00	8.28
3	600048	保利地产	3,235,800	34,428,912.00	6.57
4	600887	伊利股份	1,913,250	31,434,697.50	5.99
5	600703	三安光电	1,244,786	30,223,404.08	5.76
6	002475	立讯精密	861,169	27,514,349.55	5.25
7	600325	华发股份	1,316,500	21,458,950.00	4.09
8	600804	鹏博士	774,300	18,366,396.00	3.50
9	600557	康缘药业	725,100	18,142,002.00	3.46
10	002415	海康威视	504,600	17,353,194.00	3.31

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	274,626.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	40,329.39
5	应收申购款	148,777.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	463,733.53

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	624,312,385.79
报告期期间基金总申购份额	13,210,830.84
减:报告期期间基金总赎回份额	135,933,553.59
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	501,589,663.04

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	10,011,251.12
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期末管理人持有的本基金份额	10,011,251.12
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	2.00

注:本报告期,管理有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	认购	2015年8月11日	10,011,251.12	10,001,000.00	-
合计			10,011,251.12	10,001,000.00	

注:上述基金管理人运用固有资金于2015年8月11日认购东方红优势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	10,011,251.12	2.00	10,011,251.12	2.00	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	10,011,251.12	2.00	10,011,251.12	2.00	3年

注:截止日期2015年12月31日。

§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优势精选灵活配置混合型发起式证券投资基金的文件;

2、《东方红优势精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》;

3、《东方红优势精选灵活配置混合型发起式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。

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
2016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

2015 第四季度 报告

2015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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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及其更新。

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	东方红策略精选混合	
场内简称	-	
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	2,739,005,317.80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
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	001405	001406
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	81,208,861.61份	2,657,796,456.19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