天弘安康养老混合型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3月31日

基金管理人:天弘基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2016年4月21日

§1 重要提示及目录

1.1 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2016年4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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至2016年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	天弘安康养老混合
基金主代码	420009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年11月28日
报告期末基金份额总额	1,935,659,998.11份
投资目标	本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具,辅助投资于精选的价值型股票,通过灵活的资产配置与严谨的风险管理,力求实现基金资产持续稳定增值,为投资者提供稳健的养老理财工具。
投资策略	本基金采取稳健的投资策略,通过债券等固定收益类资产的投资获取平稳收益,并适度参与股票等权益类资产的投资增强回报,在灵活配置各类资产以及严格的风险管理基础上,力争实现基金资产的持续稳定增值。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率(税后)+0.75%
风险收益特征	本基金为债券投资为主的混合型基金,属于中低风险、中低收益预期的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。
基金管理人	天弘基金管理有限公司
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1月1日-2016年3月31日)
1.本期已实现收益	14,467,566.03
2.本期利润	-35,079,498.64
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0177
4.期末基金资产净值	2,672,995,005.09
5.期末基金份额净值	1.381

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。

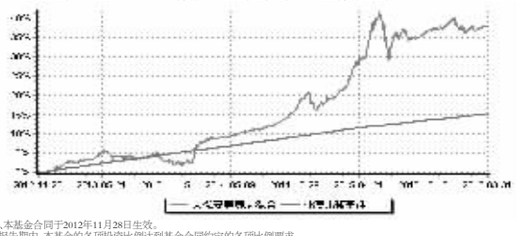
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-1.15%	0.25%	0.77%	0.01%	-1.92%	0.24%

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、本基金合同于2012年11月28日生效。

2、本报告期内,本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

§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		
梁晓丽	本基金基金经理。	2013年1月	-	7年	女,经济学硕士。历任本公司债券研究员兼债券交易员;光大永明人寿保险有限公司债券研究员兼交易员;本公司固定收益研究员,基金经理助理等。
钱文成	本基金基金经理。	2014年1月	-	10年	男,理学硕士。2007年5月加盟本公司,历任行业研究员、高级研究员、策略研究员、研究主管助理、研究部副主管、研究副总监、研究总监、股票投资部副总经理、基金经理助理等。

注:1、上述任职日期为本基金管理人对外披露的任职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《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

本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作,不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况包括:建立统一的研究平台和公共信息平台,保证各组合得到公平的投资资讯;公平对待不同投资组合,禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动;在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,严格执行授权审批程序;实行集中交易制度和公平交易分配制度;建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度,保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离;加强对投资交易行为的监察稽核力度,建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

报告期内,公司公平交易程序运作良好,未出现异常情况;场外、网下业务公平交易制度执行情况良好,未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析,对各投资组合不同时间窗口(1日、3日、5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

本报告期内,未出现违反公平交易制度的情况,公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为,公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为,公平对待投资组合,制定《异常交易监控和报告办法》对可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等交易行为异常和交易价格异常的情形进行界定,拟定相应的监控、分析和防控措施。

本报告期内,严格控制同一基金或不同基金组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易;针对非公开发行股票申购,以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控,保证分配结果符合公平交易原则。未发现本基金存在异常交易行为。

本基金本报告期内未发生同一基金或不同基金组合之间在同一交易日内进行反向交易及其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2016年一季度,经济基本面短期出现企稳反弹迹象,尤其是工业生产方面的数据逐步好转,意味着二季度工业增速将有所恢复,经济改善的动力主要来自于稳增长政府基建投资拉动、企业主动补库存以及房地产投资有见底迹象,以蔬菜价格和猪肉价格为代表的食品价格上行也加剧了市场的通胀担忧。政策面方面,基建投资作为稳增长主要的抓手,在专项建设基金的支持下维持较高增速,对经济增长起托底作用,货币政策整体维持稳健,于二月未进行了一次降准,但性质上属于中性操作,主要用于降低央行的货币政策操作成本。资金面方面,由于金融体系加杠杆较为普遍,因此对超储压力较大,年初以来资金面波动率出现明显回升。虽然基本面、政策面和资金面都存在一定的不利因素,但债券市场全势出现分化,长端利率债以震荡行情为主,而中高等级、中短期限信用债受益于配置需求旺盛,收益率进一步下行。从股票市场来看,年初出现大幅调整,两次探底之后都出现了一波反弹行情,三月下旬呈现震荡行情。

本基金在报告期内,认为利率债缺乏机会,主要择优配置信用债优良的中高等级、中短期限信用债受益于配置需求旺盛,收益率进一步下行。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	123,379,258.68	4.38
	其中:股票	123,379,258.68	4.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,595,085,528.25	92.02
	其中:债券	2,595,085,528.25	92.02
	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	19,716,149.31	0.70
8	其他资产	81,893,468.44	2.90
9	合计	2,820,074,404.68	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	64,021,435.84	2.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,397,327.35	0.50
E	建筑业	36,234.48	-
F	批发和零售业	14,732,300.00	0.55
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	-	-
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	31,191,961.01	1.17
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	123,379,258.68	4.62

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	300070	碧水源	799,999	31,191,961.01	1.17
2	002103	广博股份	999,994	30,519,816.88	1.14
3	603001	奥康国际	899,949	20,104,860.66	0.75
4	600153	建发股份	1,248,500	14,732,300.00	0.55
5	000669	金鸿能源	876,215	13,397,327.35	0.50
6	600660	福耀玻璃	871,200	12,972,168.00	0.49
7	002791	坚朗五金	3,973	149,345.07	0.01
8	002792	通宇通讯	3,081	135,440.76	0.01
9	603861	白云电器	4,056	96,735.60	0.00
10	300506	名家汇	1,819	36,234.48	0.00

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	150,045,000.00	5.61
	其中:政策性金融债	150,045,000.00	5.61
4	企业债券	1,933,910,578.55	72.35
5	企业短期融资券	160,750,000.00	6.01
6	中期票据	342,798,000.00	12.82
7	可转债(可交换债)	7,581,949.70	0.28
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,595,085,528.25	97.09

注:可转债项下包含可交换债6,842,386.10元。

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	150206	15国开06	1,500,000	150,045,000.00	5.61
2	1380231	13新郑德	1,000,000	105,500,000.00	3.95
3	011599500	15中油股SCP004	1,000,000	100,350,000.00	3.75
4	1280298	12奉化德	1,000,000	86,150,000.00	3.22
5	1080069	10愈大属债	800,000	82,464,000.00	3.09

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持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查,未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2 基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.11.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	168,522.55
2	应收证券清算款	4,683,067.81
3	应收股利	-
4	应收利息	76,026,963.49
5	应收申购款	1,014,914.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	81,893,468.44

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600153	建发股份	14,732,300.00	0.55	重大资产重组
2	000669	金鸿能源	13,397,327.35	0.50	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,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	2,080,056,562.43
报告期期间基金总申购份额	59,374,690.33
减:报告期期间基金总赎回份额	203,771,254.65
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	1,935,659,998.11

注:总申购份额含转换转入份额;总赎回份额含转换转出份额。

§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	90,771,558.25
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	90,771,558.25
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	4.69

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期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、中国证监会批准天弘安康养老混合型证券投资基金募集的文件

2、天弘安康养老混合型证券投资基金基金合同

3、天弘安康养老混合型证券投资基金招募说明书

4、天弘安康养老混合型证券投资基金托管协议

5、天弘基金管理有限公司批准成立批件及营业执照

8.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

8.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站或基金托管人的办公场所免费查阅备查文件,在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

公司网站:www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇一六年四月二十一日

东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016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
报告送出日期:2016年4月21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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4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1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方红睿丰混合
场内简称	东证睿丰
基金主代码	169101
前端交易代码	169101
基金运作方式	契约型,本基金合同生效后三年内封闭运作,在交易所上市交易,基金合同生效满三年后转为上市开放式。
基金合同生效日	2014年9月19日
报告期末基金份额总额	1,610,160,711.75份
投资目标	本基金以追求绝对收益为目标,在有效控制投资组合风险的前提下,追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	本基金在中国经济增长模式转型的大背景下,寻找符合经济发展趋势的行业,积极把握由新型城镇化、人口结构调整、资源环境约束、产业升级、商业模式创新等大趋势带来的投资机会,挖掘重点行业中的优势个股,自下而上精选具有核心竞争优势的企业,分享转型期中国经济增长的成果,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	本基金在封闭期内的业绩比较基准为:三年期银行定期存款利率(税后);本基金转换为上市开放式基金(LOF)后的业绩比较基准为: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,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	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1月1日-2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-52,114,162.81
2.本期利润	-297,108,885.19
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1845
4.期末基金资产净值	1,743,433,052.75
5.期末基金份额净值	1.083

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。

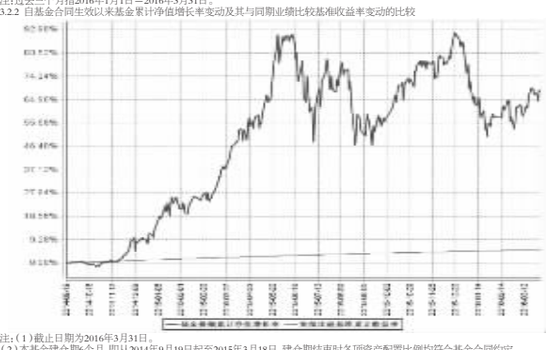
3.2 基金净值表现

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	-9.90%	2.03%	0.66%	0.01%	-10.56%	2.02%

注:过去三个月指2016年1月1日-2016年3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3月31日。

(2)本基金建仓期6个月,即从2014年9月19日起至2015年3月18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		
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执行董事、公募权益投资部总监、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、东方红领先精选混合、东方红稳健精选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基金经理。	2014年9月25日	-	18年	硕士,曾任东方证券股份有限公司研究所研究员、资产管理业务总部投资经理;现任上海东方证券资产管理有限公司执行董事、公募权益投资部总监兼任东方红睿丰混合、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、东方红中国优势混合基金经理。具有基金从业资格,中国国籍。
刚登峰	本基金基金经理,兼任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、东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、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、东方红睿轩沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2015年5月5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,权益研究部高级研究员,现任东方红睿丰混合基金经理。具有基金从业资格,中国国籍。
韩冬	本基金基金经理	2016年1月22日	-	6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,权益研究部高级研究员,现任东方红睿丰混合基金经理。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

一季度权益市场波动较大,经过1月的大幅下跌后,2月开始市场情绪逐步修复,进入3月以来,市场稳步上涨。一季度上证综指下跌15.21%,深证成指下跌17.45%,沪深300下跌13.75%,创业板下跌17.53%,中小板下跌18.22%。从行业板块来看,建筑、银行、有色、食品饮料跌幅较小,公用事业、通信、房地产、非银金融跌幅较大。

一季度,社融及信贷数据放量、物价有所回升、房地产投资增速有所反弹,再叠加对货币政策宽松空间的担忧以及权益、大宗商品上涨带来的市场风险偏好的上升,机构对债券市场的看法出现了较大的分歧。1月中旬之后市场出现了较为明显的回调,而后虽然有2月末降准以及2月经济、金融数据的不及预期,市场也整体以震荡为主,收益率未下行至年初低点。本产品在股票操作上,仍坚持从公司基本面角度出发,选择估值水平和业绩成长性相匹配的公司;债券操作上,适时调仓,控制组合久期和杠杆,精选个券,获取稳定的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2016年3月31日,本基金A类份额净值为1.083元,份额累计净值为1.083元,C类份额净值为1.000元,份额累计净值为1.000元。报告期内,本基金A类份额净值增长率为-9.90%,同期业绩比较基准收益率为-10.56%,C类份额净值增长率为-9.90%,同期业绩比较基准收益率为-10.56%。

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	1,435,666,646.16	81.71
	其中:股票	1,435,666,646.16	81.71
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	320,246,599.75	18.23
8	其他资产	1,049,907.59	0.06
9	合计	1,756,963,153.50	100.00

注:本基金本报告期末未持有通过沪港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	15,991,174.50	0.92
B	采矿业	114,020.85	0.01
C	制造业	1,242,715,299.71	71.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	119,709.48	0.01
F	批发和零售业	39,146,695.68	2.25
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	659.68	0.00
K	房地产业	137,579,086.26	7.89
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	1,435,666,646.16	82.35

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港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	002415	海康威视	5,512,279	169,888,438.78	9.74
2	000002	万 科A	7,314,146	137,579,086.26	7.89
3	600276	恒瑞医药	2,836,824	133,983,197.52	7.69
4	000651	格力电器	6,475,527	132,035,995.53	7.57
5	600066	宇通客车	6,764,849	131,102,773.62	7.52
6	002475	立讯精密	3,973,344	116,220,312.00	6.67
7	600271	航天信息	1,807,427	105,192,251.40	6.03
8	600519	贵州茅台	305,021	75,535,400.44	4.33
9	002073	软控股份	6,774,353	70,197,145.25	4.03
10	000538	云南白药	1,084,372	66,472,003.60	3.81

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一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持有股指期货投资。

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	976,127.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	73,779.73
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,049,907.59

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	000002	万 科A	137,579,086.26	7.89	重大事项停牌
2	000651	格力电器	132,035,995.53	7.57	重大事项停牌
3	600271	航天信息	105,192,251.40	6.03	重大事项停牌
4	002073	软控股份	52,428,830.37	3.01	非公开发行

注:本基金本报告期末持有的软控股份(股票代码:002073)中5,388,369股为非公开发行方式购入,流通受限部分的公允价值为52,428,830.37元。

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	1,610,160,711.75
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	-
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	1,610,160,711.75

§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

本报告期,本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期,本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睿丰灵活配置混合型证券投资基金的文件;

2、《东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

4、东方红睿丰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
2016年4月21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 第一季度 报告

2016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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2016年4月21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4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。

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1月1日起至3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	1,658,229,223.00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	81,203,875.67份	1,577,025,347.33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1月1日-2016年3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	850,516.96	16,183,650.37
2.本期利润