东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016年6月30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7月19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7月15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4月1日起至6月30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4月1日 - 2016年6月30日)
1.本期已实现收益	14,330,864.72
2.本期利润	63,986,329.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.0397
4.期末基金资产净值	1,807,419,381.76
5.期末基金份额净值	1.123

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。

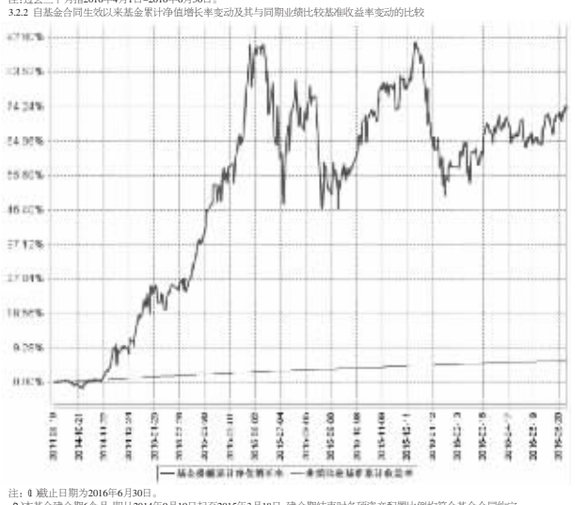
3.2 基金净值表现

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	3.69%	1.05%	0.65%	0.01%	3.04%	1.04%

注:过去三个月指2016年4月1日-2016年6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2016年6月30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董事总经理、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、东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金、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、上海东方证券资产管理有限公司执行董事;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、东方红优势精选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、睿阳混合基金经理、睿元混合基金经理、策略精选混合、东方红优势精选混合、东方红睿轩沪港深混合基金经理。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	-	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。

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》等规定。

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业绩表现

2016年二季度,国内实体经济依然在底部徘徊,海外局势愈加复杂。英国"脱欧"给全球的经济局势增加了更多的不确定性,黄金等避险资产的上涨也表明了全球风险偏好的下降。国内经济结构的调整在艰难进行,需求侧的不景气倒逼供给侧的改革,然而复杂的外部环境、人民币汇率的贬值、人口红利的下降等因素也构成较大的压力,我们对短期的经济抬持谨慎的态度。

而另一方面,短期美联储加息预期延后、国内通胀预期下降,也给市场提供了相对宽松的货币环境。几轮调整之后,目前的指数水平已经释放了较大的市场风险,估值泡沫的消化较为充分。我们认为可以在重点行业精选个股、长期布局。在一些细分领域,如大消费、新能源等行业,反映了经济结构调整的方向,也出现了一批具备核心竞争力和护城河的公司,我们相信他们代表产业方向、具备企业家精神、能够穿越经济周期。在人民币贬值的中长期趋势下,我们也相信会有一批国内企业走向全球,成为世界级的企业。市场情绪的短期波动难以预测,但我们相信与这些优秀企业为伴,一定能给投资者带来良好的回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2016年6月30日,本基金份额净值为1.123元,份额累计净值为1.692元。报告期内,本基金份额净值增长率为3.69%,同期业绩比较基准收益率为0.65%。

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	1,535,414,171.12	84.72
	其中:股票	1,535,414,171.12	84.72
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	267,179,927.09	14.74
8	其他资产	9,691,888.29	0.53
9	合计	1,812,285,986.50	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	30,715,258.26	1.70
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,351,856,780.55	74.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	775,274.28	0.04
F	批发和零售业	753,581.29	0.04
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	18,172,703.10	1.01
J	金融业	2,990.34	0.00
K	房地产业	133,117,457.20	7.37
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.00
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	1,535,414,171.12	84.95

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	8,294,647	178,003,124.62	9.85
2	000651	格力电器	6,475,527	142,914,880.89	7.91
3	600276	恒瑞医药	3,404,189	136,542,020.79	7.55
4	000002	万 科A	7,314,146	133,117,457.20	7.37
5	002475	立讯精密	6,152,466	120,895,956.90	6.69
6	600066	宇通客车	5,458,275	108,073,845.00	5.98
7	600519	贵州茅台	360,921	105,360,058.32	5.83
8	000538	云南白药	1,040,172	66,883,059.60	3.70
9	600557	康缘药业	3,772,075	61,597,984.75	3.41
10	600309	万华化学	3,556,648	61,530,010.40	3.40

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

本基金本报告期末未进行股指期货投资。

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	567,270.53
2	应收证券清算款	9,070,389.53
3	应收股利	-
4	应收利息	54,228.23
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,691,888.29

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	000651	格力电器	142,914,880.89	7.91	重大事项停牌
2	000002	万 科A	133,117,457.20	7.37	重大事项停牌

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7月19日

东方红收益增强债券型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016年6月30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7月19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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月15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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方红收益增强债券	
基金主代码	001862	
交易代码	001862	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年11月2日	
报告期末基金份额总额	1,555,879,545.98份	
投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为投资者提供高于业绩比较基准的长期稳定投资回报。	
投资策略	本基金将充分发挥基金管理人的投研能力,采取自上而下的方法对基金的大类资产进行动态配置,综合久期管理、收益率曲线配置等策略对个券进行精选,力争在严格控制基金风险的基础上,获取长期稳定超额收益。另外,本基金可投资于股票、权证等权益类资产,基金管理人将运用定性分析和定量分析相结合的方法选择估值合理、具有持续竞争优势和较大成长空间的个股进行投资,强化基金的获利能力,提高预期收益水平,以期达到收益增强的效果。	
业绩比较基准	中债综合指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%。	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	东方红收益增强债券A	东方红收益增强债券C
下属分级基金的交易代码	001862	001863
下属分级基金的前端交易代码	001862	001863
报告期末下属分级基金的份额总额	1,275,492,789.73份	280,386,756.25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4月1日 - 2016年6月30日)	
	东方红收益增强债券A	东方红收益增强债券C
1.本期已实现收益	13,017,430.36	1,936,644.77
2.本期利润	-12,464,224.32	1,215,995.53
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0073	0.0038
4.期末基金资产净值	1,304,600,223.94	286,050,502.40
5.期末基金份额净值	1.023	1.020

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

东方红收益增强债券A

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	0.79%	0.24%	-0.64%	0.12%	1.43%	0.12%

东方红收益增强债券C

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	0.59%	0.24%	-0.64%	0.12%	1.23%	0.12%

注:过去三个月指2016年4月1日-2016年6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2016年6月30日。

(2)该基金合同于2015年11月2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11月2日起至2016年5月1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		
纪文静	本基金基金经理,兼任上海东方证券资产管理有限公司公募固定收益投资部副总监、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、东方红纯债债券型发起式证券投资基金、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基金经理	2015年11月2日	-	9年	硕士,曾任东海证券股份有限公司固定收益部债券交易员、德邦证券股份有限公司债券投资与交易部总经理、上海东方证券资产管理有限公司固定收益部副总监、东方红领先精选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、东方红纯债债券、东方红稳添利纯债、东方红汇阳债券、东方红汇利债券基金经理。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》等规定。

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

二季度权益市场震荡为主,上证综指下跌2.47%,深证成指上涨0.33%,沪深300下跌1.99%,创业板下跌0.47%,中小板上涨0.41%。从行业板块来看,国防军工、电子、汽车、食品饮料、有色金属等涨幅较大,传媒、钢铁、房地产等下跌明显。

二季度,受基本面数据好转以及信用风险显露等因素影响,4月债券市场出现了一波快速上行,调整幅度也较大,各品种收益率基本回到去年11月的水平,中债总财富指数单月下跌了0.8%。5月之后随着公布的4月经济数据有所回落,市场对前期下跌有所修复,但受制于美联储加息预期也下行有限。直到6月美联储加息推后、英国退欧公投黑天鹅事件的发生,全球避险情绪攀升,再加上半年末资金面并未出现紧张状态,债券收益率出现了快速的下行。

本产品在报票操作上,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6月30日,本基金A类份额净值为1.023元,份额累计净值为1.023元,C类份额净值为1.020元,份额累计净值为1.020元。报告期内,本基金A类份额净值增长率为0.79%,同期业绩比较基准收益率为-0.64%,C类份额净值增长率为0.59%,同期业绩比较基准收益率为-0.64%。

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	240,406,707.00	12.79
	其中:股票	240,406,707.00	12.79
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,554,851,361.70	82.73
	其中:债券	1,554,851,361.70	82.73
	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	40,521,329.30	2.16
8	其他资产	43,623,097.28	2.32
9	合计	1,879,402,495.28	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	202,347,812.71	12.72
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	11,158,557.29	0.70
J	金融业	2,135,700.00	0.13
K	房地产业	13,250,100.00	0.83
L	租赁和商务服务业	11,514,537.00	0.72
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	240,406,707.00	15.11

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	000651	格力电器	1,105,600	24,400,592.00	1.53
2	600519	贵州茅台	80,000	23,353,600.00	1.47
3	600079	人福医药	1,094,200	18,349,734.00	1.15
4	002475	立讯精密	900,000	17,685,000.00	1.11
5	300054	鼎龙股份	700,000	17,514,000.00	1.10
6	600066	宇通客车	880,000	17,424,000.00	1.10
7	002415	海康威视	619,765	13,300,156.90	0.84
8	600271	航天信息	500,000	11,900,000.00	0.75
9	002400	省广股份	814,900	11,514,537.00	0.72
10	300059	东方财富	500,000	11,100,000.00	0.70

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	192,553,000.00	12.11
	其中:政策性金融债	89,988,000.00	5.66
4	企业债券	1,067,269,300.00	67.10
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	282,105,000.00	17.74
7	可转债(可交换债)	12,924,061.70	0.81
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,554,851,361.70	97.75

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	1380038	13晋兴债	800,000	67,592,000.00	4.25
2	124358	13�although投	600,000	62,574,000.00	3.93
3	136024	15沪城开	600,000	60,828,000.00	3.82
4	136038	15兴杭01	600,000	60,648,000.00	3.81
5	160211	16国开11	600,000	59,988,000.00	3.77

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

本基金本报告期末未进行股指期货投资。

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,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,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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
公允价值变动总额合计(元)					-
国债期货投资本期收益(元)					53,500.00
国债期货投资本期公允价值变动(元)					-

注:本基金本报告期末无国债期货持仓。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期国债期货投资在一定程度上对冲了利率波动的风险,符合既定的投资政策和投资目标。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	718,517.79
2	应收证券清算款	13,784,081.91
3	应收股利	-
4	应收利息	29,120,497.58
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	43,623,097.28

5.10.4 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。

5.10.5 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	000651	格力电器	24,400,592.00	1.53	重大事项停牌

5.10.6 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

	东方红收益增强债券A	东方红收益增强债券C
报告期期初基金份额总额	2,686,624,635.51	354,157,726.43
报告期期间基金总申购份额	201,004,020.10	100,704.93
减:报告期期间基金总赎回份额	1,612,135,865.88	73,871,675.11
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	1,275,492,789.73	280,386,756.25

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

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、中国证监会准予注册东方红收益增强债券型证券投资基金的文件;

2、《东方红收益增强债券型证券投资基金基金合同》;

3、《东方红收益增强债券型证券投资基金托管协议》;

4、投资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。

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7月19日

东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016年6月30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
报告送出日期:2016年7月19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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月15日复核了本报告中的财务指