

东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告 (摘要)

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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 26 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告由董事长签发。

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 3 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2015 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	东方红新动力混合
基金主代码	000480
前端交易代码	000480
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 1 月 28 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
报告期末基金份额总额	648,247,688.99 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	把握中国经济转型期的一些大趋势，深入挖掘隐藏在大趋势下的投资机会，严控风险，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	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稳定增值。 管理人通过定性和半定量的比较大类资产之间的风险收益比，在符合基金合同的情况下，在大类资产之间做一个相对最优的配置。
业绩比较基准	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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海东方证券资产管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	唐涵颖	蒋松云
	联系电话	021-63325888	010-66105799
	电子邮箱	service@dfham.com	custody@icbc.com.cn

客户服务电话	4009200808	95588
传真	021-63326981	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.dfham.com
基金年度报告备置地点	上海东方证券资产管理有限公司 上海市中山南路 318 号 2 号楼 31 层 中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门 内大街 55 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年	2014 年 1 月 28 日(基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	576,223,554.26	115,266,679.24
本期利润	607,730,316.42	212,919,258.35
加权平均基金份额本期利润	0.7467	0.2576
本期基金份额净值增长率	47.51%	43.00%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.7749	0.2415
期末基金资产净值	1,285,168,867.11	507,983,539.10
期末基金份额净值	1.983	1.430

注：（1）本基金合同于 2014 年 1 月 28 日生效。

（2）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（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（3）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 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	份额净值 增长率①	份额净值 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	18.67%	1.37%	12.26%	1.17%	6.41%	0.20%
过去六个月	-2.79%	2.15%	-10.10%	1.87%	7.31%	0.28%
过去一年	47.51%	2.08%	6.97%	1.74%	40.54%	0.34%
自基金合同 生效起至今	110.94%	1.63%	51.69%	1.38%	59.25%	0.25%

注：本基金合同于 2014 年 1 月 28 日生效。

自基金合同生效日起至今指 2014 年 1 月 28 日-2015 年 12 月 31 日。

根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定，本基金的业绩比较基准=沪深 300 指数收益率*70%+中国债券总指数收益率*30%。本基金股票投资部分的业绩比较基准采用沪深 300 指数，债券投资部分的业绩比较基准采用中国债券总指数。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，t 日收益率（ $benchmark_t$ ）按下列公式计算：

$$benchmark_t = 70\% * [t \text{ 日沪深 300 指数} / (t-1 \text{ 日沪深 300 指数}) - 1] + 30\% * [t \text{ 日中国债券总指数} / (t-1 \text{ 日中国债券总指数}) - 1];$$

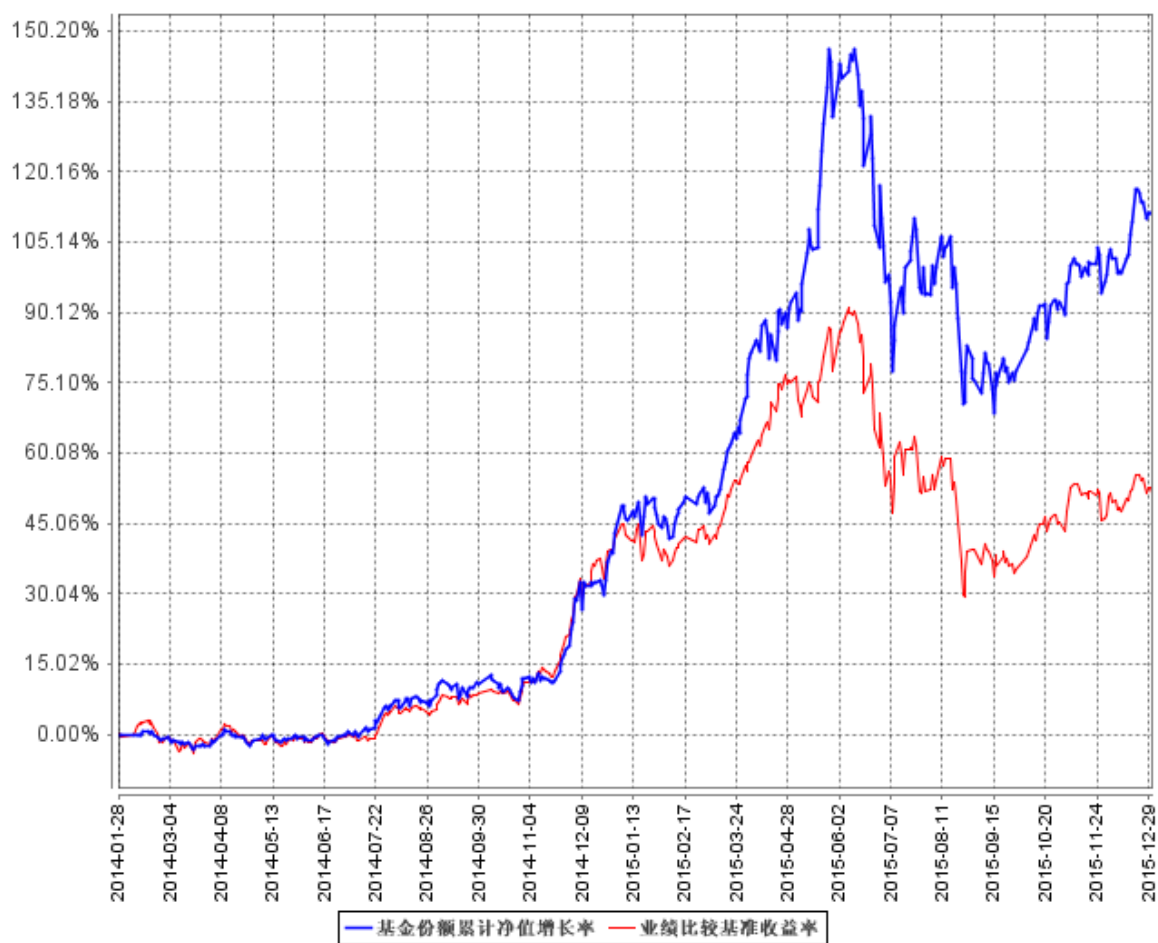
其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ，T 表示时间截至日；

t 日至 T 日的期间收益率（ $benchmark_t^T$ ）按下列公式计算：

$$benchmark_t^T = [\prod_{t=T}^T (1 + benchmark_t)] - 1$$

其中， $T=2, 3, 4, \dots$ ； $\prod_{t=T}^T (1 + benchmark_t)$ 表示 t 日至 T 日的 $(1 + benchmark_t)$ 数学连乘。

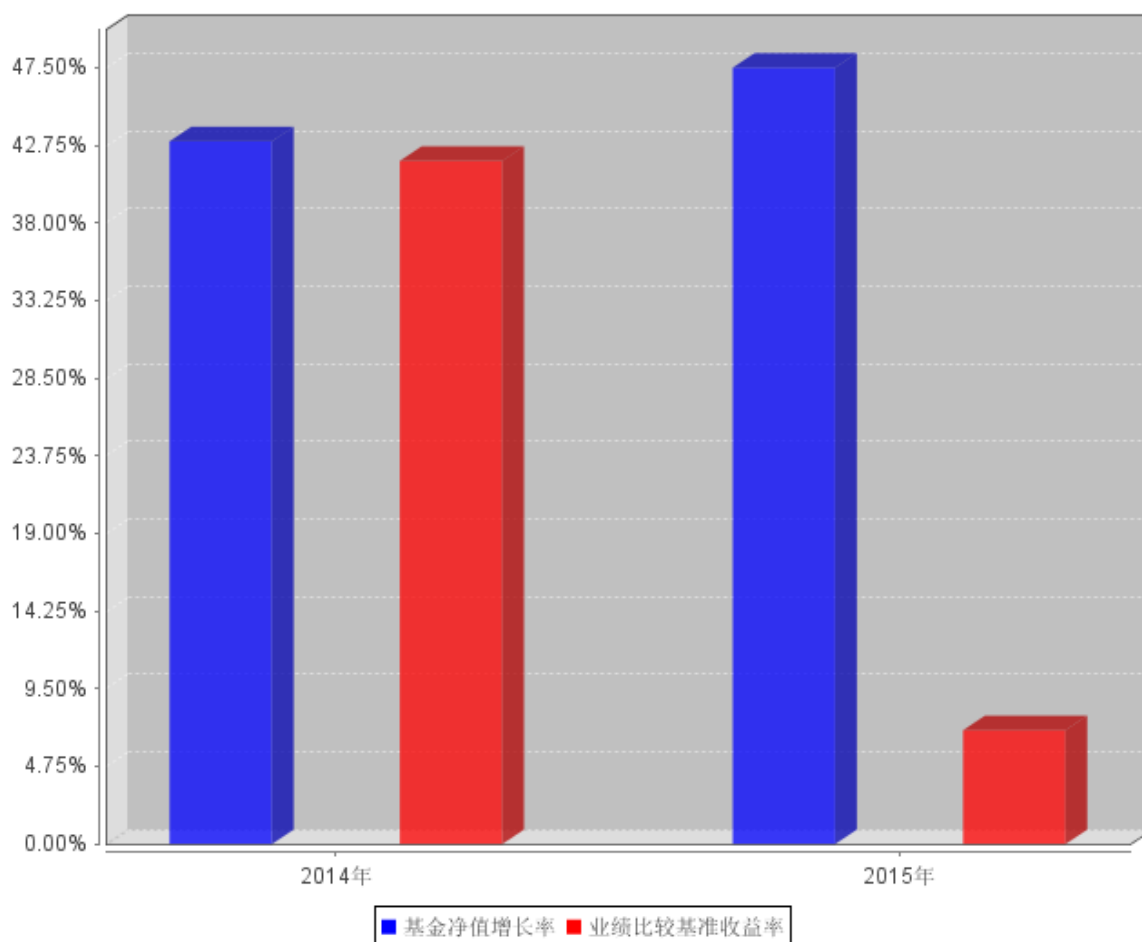
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：截止日期为 2015 年 12 月 31 日。

本基金建仓期 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均符合基金合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：1. 本基金合同生效日为 2014 年 1 月 28 日。

2. 合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2015	0.8800	57,684,275.30	8,041,185.02	65,725,460.32	
2014	-	-	-	-	
合计	0.8800	57,684,275.30	8,041,185.02	65,725,460.32	

注：本基金自 2014 年 1 月 28 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上海东方证券资产管理有限公司成立于 2010 年 7 月 28 日，是国内首家获中国证监会批准设

立的券商系资产管理公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准东方证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可[2010]518 号）批准，由东方证券股份有限公司出资 3 亿元在原东方证券资产管理业务总部的基础上成立。2013 年 8 月，公司成为首家获得“公开募集证券投资基金管理业务资格”的证券公司。公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。截至 2015 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金、东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金、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、东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金、东方红优势精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红纯债债券型发起式证券投资基金、东方红收益增强债券型证券投资基金、东方红信用债债券型证券投资基金十五只证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨达治	公司董事总经理、权益研究部总监，兼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、东方红京东大数据灵活配置混合型证券	2014 年 1 月 28 日	2015 年 12 月 9 日	14 年	硕士，曾任东方证券股份有限公司证券投资业务总部研究员；东方基金有限责任公司研究部研究员；东方证券股份有限公司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投资部

	投资基金 基金经理				投 资 经 理、研究 部副总监 兼投资经 理、执行 董事；现 任公司董 事 总 经 理、权益 研究部总 监兼东方 红中国优 势混合、 东方红睿 元混合、 东方红京 东大数据 混合基金 经理。具 有基金从 业资格， 中 国 国 籍。
周云	本基金基 金经理， 兼任东方 红京东大 数据灵活 配置混合 型证券投资 基金基金 经理。	2015 年 9 月 14 日	-	8 年	博士，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 研究员 / 投资主办 人，现任 东方红新 动 力 混 合、东方 红京东大 数据混合 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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了《上海东方证券资产管理有限公司公平交易制度》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；2、对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理，确保公平对待所有投资组合。

事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1 日、3 日、5 日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、集合及定向产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基

金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，合规与风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。

4.3.2 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。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年，A 股市场跌宕起伏，上半年在新增资金的推动下，上证指数由年初的 3300 点一路上涨到 6 月中旬的 5000 多点，绝大部分股票估值高企，泡沫严重。当股价明显脱离价值区域的时候，价格的上涨不过是后来者补贴先入者的旁氏骗局，股市上涨没有上限，但参与人数毕竟有上限，5 月最后一周 A 股新增账户数超过了 160 万户。泡沫破灭造成的股灾导致上证指数在两个多月的时间里跌了 45%。10 月份开始市场有所反弹，上证指数年末收于 3539 点，全年上涨 9.41%。

4.4.2 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 1.983 元，份额累计净值为 2.071 元。本报告期，本基金净值增长率为 47.51%，业绩比较基准收益率为 6.97%。

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 年中国经济依然处于艰难的转型期，一方面，实体经济主动企稳向上的迹象不明显，很多行业可能都面临需求下滑的压力；另一方面，10 年期国债收益率跌破 3%，长期看房地产价格也处于较高的位置，各大类资产的回报率均在下降。综上，我们将从两个角度选择股票：

- 1, 成长性和估值匹配的, 受宏观经济影响较小的行业中优秀公司。
- 2, 盈利下滑已经充分反映在股价中, 且基本面有边际改善的公司。

市场方面, 16 年影响市场风险偏好的因素错综复杂, A 股上下波动幅度有可能非常巨大, 操作上, 除了持有估值合理的优质股票外, 我们会根据市场情况灵活调控仓位, 努力为基金持有人创造超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内, 本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定, 对基金所持有的投资品种进行估值, 本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金份额净值由基金管理人完成估值后, 经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务, 本基金管理人对估值和定价过程进行了严格的控制。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上, 确定本基金管理人采用的估值政策。本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历, 具有基金从业人员资格。同时, 公司设估值决策小组, 成员包括: 公司总经理、公司联席总经理、合规总监(督察长)、交易总监、运营总监、市场总监、投资经理、基金会计主管。基金经理不参与基金日常估值业务, 对于属于东证资管估值政策范围内的特殊估值变更可参与讨论, 但最终决策由估值决策小组讨论决策并联名审批。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署提供中债收益率曲线和中债估值的服务协议, 由其按约定提供银行间同业市场债券品种的估值数据。

本报告期内, 参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金的基金管理人于 2015 年 1 月 28 日公告 2015 年度第 1 次分红, 向截至 2015 年 1 月 30 日止在中国证券登记结算有限责任公司登记在册的全体持有人, 按每 10 份基金份额派发红利 0.88 元, 共计派发红利 65,725,460.32 元, 其中红利再投 8,041,185.02 元, 现金分红 57,684,275.30 元。

根据基金合同规定, 本基金的收益分配, 每年最多分配 6 次, 且每次基金收益分配比例不低

于截至收益分配基准日可供分配利润的 25%。截至收益分配基准日 2015 年 1 月 20 日, 本基金可供分配收益为 166, 795, 622. 06 元。本基金本期分红已符合相关法律法规及《基金合同》约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期, 中国工商银行股份有限公司在本基金的托管过程中, 严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定, 不存在损害基金份额持有人利益的行为, 完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内, 东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金的管理人——上海东方证券资产管理有限公司在东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对上海东方证券资产管理有限公司编制和披露的东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查, 以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

本报告期基金财务报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计, 注册会计师薛竞、

沈兆杰签字出具了普华永道中天审字(2016)第 21306 号标准无保留意见的审计报告。

投资者可通过本基金年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日： 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	82,774,530.29	14,059,874.50
结算备付金	60,250,431.63	12,590,305.13
存出保证金	4,055,011.39	581,861.74
交易性金融资产	1,143,127,051.31	482,518,241.92
其中：股票投资	1,143,127,051.31	482,518,241.92
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	306,009.48	3,437,009.56
应收利息	94,504.27	50,478.31
应收股利	-	-
应收申购款	3,264,850.02	4,699,995.13
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,293,872,388.39	517,937,766.29
负债和所有者权益	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	1,607,526.75

应付赎回款	4,987,544.87	6,665,417.56
应付管理人报酬	1,697,096.15	627,679.84
应付托管费	282,849.35	104,613.27
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,220,805.99	536,306.96
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	515,224.92	412,682.81
负债合计	8,703,521.28	9,954,227.19
所有者权益：		
实收基金	648,247,688.99	355,352,510.64
未分配利润	636,921,178.12	152,631,028.46
所有者权益合计	1,285,168,867.11	507,983,539.10
负债和所有者权益总计	1,293,872,388.39	517,937,766.29

注：(1) 本基金于 2014 年 1 月 28 日成立

(2) 报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.983 元，基金份额总额 648,247,688.99 份。

7.2 利润表

会计主体：东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 28 日(基金合同生 效日)至 2014 年 12 月 31 日
一、收入	645,359,556.75	236,096,088.50
1. 利息收入	1,633,612.43	4,395,716.55
其中：存款利息收入	1,628,179.53	1,753,199.99
债券利息收入	432.92	698,347.67
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	4,999.98	1,944,168.89
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	598,941,603.38	132,535,603.59
其中：股票投资收益	535,000,283.95	100,373,821.26
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,187,412.08	23,936,712.61
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-

衍生工具收益	40,659,680.00	94,260.00
股利收益	21,094,227.35	8,130,809.72
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	31,506,762.16	97,652,579.11
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	13,277,578.78	1,512,189.25
减：二、费用	37,629,240.33	23,176,830.15
1. 管理人报酬	21,563,781.78	11,908,849.40
2. 托管费	3,593,963.63	1,984,808.20
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	12,050,152.92	8,837,875.52
5. 利息支出	-	53,956.53
其中：卖出回购金融资产支出	-	53,956.53
6. 其他费用	421,342.00	391,340.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	607,730,316.42	212,919,258.35
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	607,730,316.42	212,919,258.35

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	355,352,510.64	152,631,028.46	507,983,539.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	607,730,316.42	607,730,316.42
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	292,895,178.35	-57,714,706.44	235,180,471.91
其中：1. 基金申购款	2,268,482,370.64	1,561,942,478.28	3,830,424,848.92
2. 基金赎回款	-1,975,587,192.29	-1,619,657,184.72	-3,595,244,377.01
四、本期向基金份额持有	-	-65,725,460.32	-65,725,460.32

人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	648,247,688.99	636,921,178.12	1,285,168,867.11
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 28 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,145,371,169.07	-	1,145,371,169.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	212,919,258.35	212,919,258.35
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-790,018,658.43	-60,288,229.89	-850,306,888.32
其中：1. 基金申购款	58,181,365.23	11,885,513.17	70,066,878.40
2. 基金赎回款	-848,200,023.66	-72,173,743.06	-920,373,766.72
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	355,352,510.64	152,631,028.46	507,983,539.10

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>陈光明</u>	<u>任莉</u>	<u>詹朋</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2013]1527 号文)核准,由上海东方证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售,基金

合同于 2014 年 1 月 28 日生效。本基金为契约型开放式, 存续期限不定。本基金的基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司, 基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金于 2013 年 12 月 30 日至 2014 年 1 月 22 日向社会公开募集, 扣除认购费后的有效认购资金 1,144,927,618.60 元, 利息转份额 443,550.47 元, 募集规模为 1,145,371,169.07 份。上述募集资金已由立信会计师事务所(特殊普通合伙)验证, 并出具了验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定, 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、债券(含中小企业私募债)、中期票据、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的 0%—95%; 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%; 基金投资收益于新动力的股票不低于非现金基金资产的 80%。

本基金的业绩比较基准为: 沪深 300 指数收益率*70%+中国债券总指数收益率*30%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制, 同时, 对于在具体会计核算和信息披露方面, 也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金于 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情

况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策与最近一期年度报告一致，所采用的会计估计完全一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》，对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，自 2015 年 3 月 30 日起，采用第三方估值机构提供的价格数据结果确定公允价值。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税;

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税;

(3) 对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时代扣代缴个人所得税。持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息、红利收入全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25%计入应纳税所得额,自 2015 年 9 月 8 日起,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。对基

金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税，暂不征收企业所得税；

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
上海东方证券资产管理有限公司	基金管理人、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 28 日 (基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
东方证券	5,762,954,680.75	69.22%	5,852,183,808.10	100.00%

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 28 日 (基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例
东方证券	7,125,845.00	100.00%	771,965,793.20	100.00%

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 28 日 (基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
东方证券	60,000,000.00	100.00%	4,141,100,000.00	100.00%

7.4.8.1.4 权证交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
东方证券	5,129,866.88	72.61%	758,408.93	62.12%
关联方名称	上年度可比期间 2014 年 1 月 28 日 (基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例 (%)
东方证券	5,327,824.44	100.00%	536,306.96	100.00%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

2、本公司因作为证券公司子公司尚未获得在上海交易所租用其他券商交易单元的资格；截至报告期末，本公司已在深证交易所获得租用券商交易单元的资格，并已按公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 28 日 (基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付	21,563,781.78	11,908,849.40

的管理费		
其中：支付销售机构的客户维护费	9,645,846.57	4,582,666.06

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

2、实际支付销售机构的客户维护费以本基金管理人和销售机构对账确认的金额为准。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 28 日 (基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,593,963.63	1,984,808.20

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		2014 年 1 月 28 日 (基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	82,774,530.29	1,286,465.95	14,059,874.50	1,624,118.31

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期及上年度可比期间均未发生其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截止本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000002	万科 A	2015 年 12 月 18 日	重大事项	24.43	-	-	4,500,000	66,324,700.58	109,935,000.00	-
600271	航天信息	2015 年 10 月 9 日	重大事项	71.46	-	-	741,500	31,622,984.48	52,987,590.00	-
002567	唐人神	2015 年 11 月 23 日	重大事项	12.84	2016 年 2 月 25 日	11.56	2,800,153	26,424,545.02	35,953,964.52	-

注：本基金截至 2015 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖

出回购证券款余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止, 本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次, 由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 944,250,496.79 元, 第二层次的余额为 198,876,554.52 元, 无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票, 若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况, 本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外), 本基金于 2015 年 3 月 30 日起改为采用第三方估值机构 根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注 7.4.5.2), 并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,143,127,051.31	88.35
	其中：股票	1,143,127,051.31	88.35
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	143,024,961.92	11.05
7	其他各项资产	7,720,375.16	0.60
8	合计	1,293,872,388.39	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	929,236,659.10	72.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供	57,150,000.00	4.45

	应业		
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	10,149,000.00	0.79
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	36,547,000.00	2.84
K	房地产业	109,935,000.00	8.55
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	109,392.21	0.01
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	1,143,127,051.31	88.95

8.2.2 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。

8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600887	伊利股份	7,000,000	115,010,000.00	8.95
2	000002	万科A	4,500,000	109,935,000.00	8.55
3	002304	洋河股份	1,524,820	104,511,162.80	8.13
4	600066	宇通客车	4,230,814	95,151,006.86	7.40
5	002415	海康威视	2,475,000	85,115,250.00	6.62

6	600557	康缘药业	2,920,090	73,060,651.80	5.68
7	002157	正邦科技	3,350,000	67,335,000.00	5.24
8	600703	三安光电	2,550,040	61,914,971.20	4.82
9	000651	格力电器	2,726,000	60,926,100.00	4.74
10	600271	航天信息	741,500	52,987,590.00	4.12

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于上海东方证券资产管理有限公司网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000002	万 科 A	254,715,121.61	50.14
2	600887	伊利股份	244,820,855.35	48.19
3	600036	招商银行	197,189,450.22	38.82
4	600066	宇通客车	168,964,060.63	33.26
5	601318	中国平安	151,946,078.62	29.91
6	002415	海康威视	130,905,441.93	25.77
7	002304	洋河股份	129,567,974.95	25.51
8	600703	三安光电	110,920,810.58	21.84
9	600535	天士力	107,026,204.32	21.07
10	600271	航天信息	106,694,728.86	21.00
11	601818	光大银行	105,999,456.27	20.87
12	601233	桐昆股份	103,771,496.76	20.43
13	601336	新华保险	96,080,670.96	18.91
14	600373	中文传媒	93,198,870.38	18.35
15	002251	步 步 高	86,778,623.00	17.08
16	600557	康缘药业	83,554,585.78	16.45
17	000538	云南白药	81,581,270.69	16.06
18	600690	青岛海尔	69,395,983.08	13.66
19	002157	正邦科技	68,590,707.18	13.50
20	600686	金龙汽车	64,721,251.60	12.74
21	600029	南方航空	60,060,152.30	11.82
22	000651	格力电器	57,471,227.14	11.31

23	601009	南京银行	55,068,269.88	10.84
24	002292	奥飞动漫	54,577,966.15	10.74
25	002041	登海种业	53,644,888.91	10.56
26	002604	龙力生物	52,548,225.02	10.34
27	600115	东方航空	50,942,487.85	10.03
28	002477	雏鹰农牧	48,721,463.77	9.59
29	300226	上海钢联	48,167,073.62	9.48
30	600585	海螺水泥	46,885,779.10	9.23
31	603699	纽威股份	45,709,371.02	9.00
32	002117	东港股份	44,590,663.09	8.78
33	600196	复星医药	44,058,353.72	8.67
34	002557	洽洽食品	41,768,639.30	8.22
35	600518	康美药业	41,414,586.03	8.15
36	600886	国投电力	41,217,176.23	8.11
37	000001	平安银行	40,572,539.95	7.99
38	000858	五 粮 液	38,596,803.44	7.60
39	000550	江铃汽车	36,529,962.75	7.19
40	002202	金风科技	36,358,248.26	7.16
41	600323	瀚蓝环境	35,959,730.51	7.08
42	300303	聚飞光电	35,762,831.92	7.04
43	600694	大商股份	35,447,739.80	6.98
44	600999	招商证券	32,843,054.77	6.47
45	002124	天邦股份	32,542,103.76	6.41
46	603288	海天味业	31,642,677.18	6.23
47	600422	昆药集团	30,588,374.18	6.02
48	600277	亿利洁能	30,053,687.94	5.92
49	002188	新 嘉 联	29,628,867.61	5.83
50	600976	健民集团	29,490,915.57	5.81
51	002008	大族激光	29,370,462.30	5.78
52	300017	网宿科技	28,117,347.13	5.54
53	002311	海大集团	28,022,149.29	5.52
54	601288	农业银行	26,587,082.00	5.23
55	002567	唐人神	26,424,545.02	5.20
56	600089	特变电工	26,292,911.10	5.18
57	002223	鱼跃医疗	23,657,950.10	4.66
58	002717	岭南园林	22,778,473.42	4.48

59	000869	张 裕 A	22,568,352.96	4.44
60	000931	中 关 村	22,458,109.23	4.42
61	300005	探路者	22,007,555.20	4.33
62	600309	万华化学	21,744,377.97	4.28
63	601628	中国人寿	20,858,719.91	4.11
64	600015	华夏银行	20,521,306.28	4.04
65	300028	金亚科技	19,919,922.60	3.92
66	000826	启迪桑德	18,517,545.68	3.65
67	600048	保利地产	18,124,047.40	3.57
68	000957	中通客车	16,642,999.92	3.28
69	002236	大华股份	13,992,886.22	2.75
70	300032	金龙机电	12,952,570.95	2.55
71	300498	温氏股份	12,465,479.29	2.45
72	600060	海信电器	11,243,661.35	2.21

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	217,651,621.23	42.85
2	601318	中国平安	205,170,173.35	40.39
3	000002	万 科 A	188,304,314.84	37.07
4	600271	航天信息	159,165,299.52	31.33
5	002251	步 步 高	143,972,224.11	28.34
6	002415	海康威视	143,654,330.09	28.28
7	601233	桐昆股份	134,863,377.51	26.55
8	600887	伊利股份	125,877,310.14	24.78
9	600066	宇通客车	124,384,635.81	24.49
10	600373	中文传媒	114,534,039.63	22.55
11	601818	光大银行	103,725,014.00	20.42
12	601336	新华保险	100,044,366.19	19.69
13	600690	青岛海尔	93,380,531.96	18.38
14	002041	登海种业	91,497,978.99	18.01
15	600535	天士力	86,847,952.91	17.10
16	002604	龙力生物	82,109,366.27	16.16

17	002223	鱼跃医疗	73,682,674.66	14.50
18	002292	奥飞动漫	69,528,038.24	13.69
19	600703	三安光电	69,011,360.14	13.59
20	002202	金风科技	66,558,154.76	13.10
21	600886	国投电力	64,353,202.57	12.67
22	002477	雏鹰农牧	64,023,988.72	12.60
23	603288	海天味业	63,478,241.02	12.50
24	300303	聚飞光电	63,279,137.49	12.46
25	600196	复星医药	63,004,085.09	12.40
26	600048	保利地产	62,404,765.11	12.28
27	600694	大商股份	60,894,399.87	11.99
28	600686	金龙汽车	59,761,896.60	11.76
29	601009	南京银行	59,394,463.36	11.69
30	300226	上海钢联	54,438,206.19	10.72
31	002304	洋河股份	52,981,850.01	10.43
32	600518	康美药业	51,325,785.47	10.10
33	600029	南方航空	51,264,794.58	10.09
34	603699	纽威股份	48,788,780.86	9.60
35	600115	东方航空	48,355,127.66	9.52
36	600585	海螺水泥	47,905,619.88	9.43
37	002117	东港股份	47,153,446.18	9.28
38	600015	华夏银行	45,217,428.57	8.90
39	000001	平安银行	41,866,131.84	8.24
40	000538	云南白药	41,443,651.60	8.16
41	300017	网宿科技	36,677,911.94	7.22
42	600999	招商证券	35,173,993.70	6.92
43	600277	亿利洁能	33,872,795.39	6.67
44	600422	昆药集团	30,749,916.00	6.05
45	002311	海大集团	30,712,372.28	6.05
46	002008	大族激光	30,065,773.16	5.92
47	000858	五 粮 液	28,138,205.00	5.54
48	002157	正邦科技	26,386,053.96	5.19
49	601288	农业银行	26,355,022.95	5.19
50	600089	特变电工	24,761,149.81	4.87
51	300028	金亚科技	24,126,840.10	4.75
52	000931	中 关 村	23,039,430.29	4.54
53	000869	张 裕 A	22,745,423.00	4.48
54	600976	健民集团	22,625,855.56	4.45

55	300005	探路者	21,937,201.54	4.32
56	600309	万华化学	21,213,098.75	4.18
57	002717	岭南园林	21,157,373.21	4.16
58	601628	中国人寿	20,230,389.95	3.98
59	000957	中通客车	16,565,376.96	3.26
60	000826	启迪桑德	16,249,370.25	3.20
61	300032	金龙机电	14,742,613.00	2.90
62	002236	大华股份	13,552,006.19	2.67
63	000553	沙隆达 A	12,835,332.28	2.53
64	300498	温氏股份	12,222,316.80	2.41
65	002188	新 嘉 联	11,096,280.40	2.18

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,209,998,402.79
卖出股票收入（成交）总额	4,116,188,639.51

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未进行贵金属投资。

8.9 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进行权证投资。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指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）	风险说明
IC1601	IC1601	-10	-14,798,000.00	-292,000.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-292,000.00
股指期货投资本期收益（元）					40,659,680.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-292,000.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,055,011.39
2	应收证券清算款	306,009.48
3	应收股利	—
4	应收利息	94,504.27
5	应收申购款	3,264,850.02
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	7,720,375.16

8.12.4 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。

8.12.5 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	000002	万科A	109,935,000.00	8.55	重大事项停牌
2	600271	航天信息	52,987,590.00	4.12	重大事项停牌

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
29, 578	21, 916. 55	59, 160, 573. 68	9. 13%	589, 087, 115. 31	90. 87%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1, 406, 506. 77	0. 2170%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2014 年 1 月 28 日 ）基金份额总额	1, 145, 371, 169. 07
本报告期期初基金份额总额	355, 352, 510. 64
本报告期基金总申购份额	2, 268, 482, 370. 64
减:本报告期基金总赎回份额	1, 975, 587, 192. 29
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	648, 247, 688. 99

注：1、本基金合同于 2015 年 4 月 17 日生效。

2、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）。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

本报告期本基金管理人于 2015 年 5 月 22 日发布公告，自 2015 年 5 月 21 日起免去钱慧同志公开募集基金业务合规负责人（督察长）的职务，由陈光明同志代行公开募集基金业务合规负责人（督察长）职责。

本报告期本基金管理人于 2015 年 8 月 18 日发布公告，自 2015 年 8 月 18 日起任命唐涵颖同志担任公开募集基金业务合规负责人（督察长）职责，公司总经理陈光明先生自 2015 年 8 月 18 日起不再代行公开募集基金管理业务合规负责人。

本报告期本基金管理人于 2015 年 12 月 28 日发布公告，自 2015 年 12 月 28 日起任命任莉同志担任基金管理人副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是普华永道中天会计师事务所有限公司。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今，本基金本年度支付给审计机构普华永道中天会计师事务所有限公司审计报酬为 10 万元人民币。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	3	5,817,797,688.53	69.88%	5,169,973.84	74.23%	-
广发证券	1	671,593,714.26	8.07%	477,101.24	6.85%	-
国金证券	1	577,451,192.30	6.94%	422,290.10	6.06%	-
长江证券	1	530,044,612.23	6.37%	376,543.60	5.41%	-
国泰君安	1	487,133,903.46	5.85%	347,409.91	4.99%	-
中信建投证券	1	241,980,522.92	2.91%	171,903.15	2.47%	-

注： 1. 本报告期内本基金租用交易单元的变更情况：新增东方证券、长江证券、国泰君安、广发证券、国金证券、中信建投证券 6 个交易单元。

2、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易（如有）而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

3、交易单元的选择标准和程序

（1）选择标准

券商财务状况良好、经营行为规范，最近一年无重大违规行；具有较强的研究服务能力；交易佣金收费合理。

（2）选择程序

基金管理人根据以上标准对不同券商进行综合评价，然后根据评价选择券商，与其签订协议租用交易单元。

4、截至本报告期末，本公司因作为证券公司子公司尚未获得在上海交易所租用其他券商交易单元的资格；本公司已在深证交易所获得租用券商交易单元的资格，并已按公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	7,125,845.00	100.00%	60,000,000.00	100.00%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-

上海东方证券资产管理有限公司
2016 年 3 月 26 日