东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第2季度报告

2020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: 2020年7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 2020 年 7 月 17 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2020年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	东方红京东大数据混合
基金主代码	001564
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年7月31日
报告期末基金份额总额	587, 762, 097. 70 份
投资目标	本基金根据公司大数据分析模型,进行行业配置和个股选择,力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金是一只灵活配置的混合型基金,采取主动管理的投资模式。在投资策略上,管理人先根据宏观分析和市场判断确定大类资产的配置,然后充分利用公司大数据研究平台的优势,通过对京东大数据(包括京东电商的销量、浏览量、点击量、客户评价、客户收藏量等基础数据)的分析研究,挖掘不同行业的敏感因子,提取合成不同行业的观察指标,结合管理人的线下研究进行行业配置和个券选择,构建合理的投资组合。
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(2020年4月1日-2020年6月30日)
1. 本期已实现收益	24, 434, 734. 35
2. 本期利润	136, 256, 683. 15
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 1994
4. 期末基金资产净值	895, 262, 826. 05
5. 期末基金份额净值	1. 523

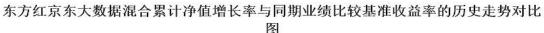
- 注: (1) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
- (2) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益) 扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	15. 47%	0.86%	8. 97%	0. 65%	6. 50%	0. 21%
过去六个月	4. 10%	1. 49%	3. 35%	1. 07%	0. 75%	0. 42%
过去一年	18. 43%	1. 20%	8. 90%	0.86%	9. 53%	0.34%
过去三年	15. 55%	1. 18%	9. 38%	0.88%	6. 17%	0.30%
自基金合同	52. 30%	1. 08%	3. 02%	0. 98%	49. 28%	0. 10%
生效起至今	52. 50%	1.00%	3.02%	0.96%	49. 20%	0.10%

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





§4 管理人报告

4.1基金经理(或基金经理小组)简介

扯力	1117 夕	任本基金的基金经理期限 任职日期 离任日期		证券从业年限	3H 11
姓名	职务			此分从业牛阪	说明
周云	上海有募部理基东产管司投经基理公资	2015年9月14日		12 年	上资公投理月红灵型金20至新置投经的年方深合基东管公部05年东晋基金15今动混资理月红灵型金5种混资理月8个红灵型金6年东灵型金6年东数混资理9方活证基2016年金量证有权总年东数混资理9方活证基2016年产置投经条限益经95方据合基、月红配券金年

理、2017年 04 月至 2019年 11 月任东方红 智逸沪港深定 期开放证基金型 发基金基金型 发基金基金型 理、2019年 11 月任东方红 睿泽三和置 报合型基金大士。 新公型基金大生生物任东定期 开放会型。清学博方理业员 查。高等有方理业员 一个管理,是一个管理,是一个管理,是一个管理,是一个管理,是一个管理,是一个管理,是一个可可,是一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个			
11月任东方红智逸沪港深定期开放混合型发起金基金经理、2018年01月至2019年 11月任东方红睿泽三年定期开放产品配置和大学三年和时,在一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,在一个工作,是一个工作,工作,也可以工作,也可以工作,是一个工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,可以工作,可以工作,也可以工作,可以工作,可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,可以工作,可以工作,可以工作,可以工作,可以工作,可以工作,可以工作,			•
智逸沪港深定 期开放混合型 发起或基金经 理、2018 年 01 月至 2019 年 11 月任东方红 睿泽三年定期 开放灵型证券投 资基金基金经 理。清华大学 生物年东方证等 资产部研究员、 上海产管研究员、 大政研究局、 投资主办人。 具备 证券投资基金 证券投资			
期开放混合型发起或证券投资基金基金经理、2018年01月至2019年11月至2019年11月任东方红春泽三年定期开放灵型证券投资基金基金经理。对学博士。对于中国的政策的关系,是有关的政策的关系,是有关的政策的关系,是对于中国的政策的关系,是对于中国的政策的关系,对对对政策的关系,对对政策的关系,对对对政策的关系,对对对政策的关系,对对对政策的关系,对对对政策的关系,对对对对对对对对对对对对对对对对对对对对对对对对对对对对对对对对对对对对			11 月任东方红
发起式证券投资基金经理、2018年01月至2019年11月至2019年11月至2019年11月至2019年11月至三月期开放司工商。			智逸沪港深定
资基金基金经理、2018年01月至2019年11月至2019年11月任东方红睿泽灵活证期开放型证务上海三活配为投资基金基大学生物学基金经理。清学博方证券资产管理公司研究方证券资产部研究方证等农产等和研究方证,从方面,投资主办人,权益研究部、投资主办人。具备证券投资基金证券投资基金证券投资基金证券投资基金证券投资基金			期开放混合型
理、2018年01 月至 2019年 11 月在东方红 睿泽三年定期 开放灵证券投 资基金基金投 变基金基金学 生物学有当所的一个。 上海东方理观员, 上海东方可研究员、为 资产可研究员、人, 高高级研究员、,权 益研究员、,权 益研究员、,具备 证券投资基金			发起式证券投
月至 2019 年 11 月任东方红 睿泽三年定期 开放灵活配置 混合型证券投资基金基华大会 理。清详也有一个。 历任管理允子 资产管理允子 资产等理允子 资产等理有高。 级子, 经产可研究员、, 校产可研究员、, 经产可研究员、, 经产可研究员、, 经产可可完, 权 益研究员、, 权 益研究员、, 权 证券投资基金 证券投资基金			资基金基金经
11月任东方红 睿泽三年定期 开放灵活。对 强全基金基投 资基。清华大会 理。清学有一部一个 资产。 一种一个, 一种一个, 一种一个。 一种一一。 一种一一。 一种一。 一种			理、2018年 01
春泽三年定期 开放灵活新投资基金基业经理。清华基金经理。清华十二。 历任东方证券资产管理小务。总部研究员, 上海产管理和员, 上海产管理和贸公司研究员、投资主办人,权益研究员、投资主办人,权益研究员、权益研究员、以及资主办人。具备证券投资基金			月至 2019 年
开放灵活配置 混合型证券投资基金基经 理。清华大学 生物学博士。 历任东方证券 资产管理业务 总部研究员, 上海东宣理有限 公司研究员、投 资主办人,权 益研究员、权 益研究员、投资主办人。具备 证券投资基金			11 月任东方红
混合型证券投资基金基金经理。清华大学生物学博士。 历任东方证券资产管理业务 总部研究员, 上海东方证券资产管理和务 总部研究员、投资主办人, 权益研究员、投资主办人, 权益研究员、投资主办人。具备证券投资基金			睿泽三年定期
资基金基金经理。清华大学生物学博士。 历任东方证券资产管理业务总部研究员,上海东方证券资产管理自限公司研究部高级研究员、投资主办人,权益研究部高级研究员、投资主办人。具备证券投资基金			开放灵活配置
理。清华大学生物学博士。 历任东方证券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员、投资主办人,权益研究部高级研究员、投资主办人。具备证券投资基金			混合型证券投
生物学博士。 历任东方证券资产管理业务 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、投资主办人,权 益研究部高级 研究员、投资主办人。具备 证券投资基金			资基金基金经
历任东方证券 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 资主办人,权 益研究部高级 研究员、投资 主办人。具备 证券投资基金			理。清华大学
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 资主办人,权 益研究部高级 研究员、投资 主办人。具备 证券投资基金			生物学博士。
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、投资主办人, 权益研究部高级研究员、投资主办人。具备证券投资基金			历任东方证券
上海东方证券资产管理有限公司研究部高级研究员、投资主办人,权益研究部高级研究员、投资主办人。具备证券投资基金			资产管理业务
资产管理有限 公司研究部高 级研究员、投 资主办人,权 益研究部高级 研究员、投资 主办人。具备 证券投资基金			总部研究员,
公司研究部高 级研究员、投 资主办人,权 益研究部高级 研究员、投资 主办人。具备 证券投资基金			上海东方证券
级研究员、投资主办人,权 益研究部高级 研究员、投资 主办人。具备 证券投资基金			资产管理有限
资主办人,权 益研究部高级 研究员、投资 主办人。具备 证券投资基金			公司研究部高
益研究部高级 研究员、投资 主办人。具备 证券投资基金			级研究员、投
益研究部高级 研究员、投资 主办人。具备 证券投资基金			资主办人,权
主办人。具备证券投资基金			
证券投资基金			研究员、投资
			主办人。具备
从业资格。			证券投资基金
			从业资格。

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,海外疫情持续发展,但是对全球经济的冲击在可控范围之内,在巨额流动性释放的对冲下,股市的表现更加超预期,美股基本回到了疫情前的水平,纳斯达克指数甚至创了新高。A股的表现也相当优异,沪深 300 指数上涨 12.96%,创业板指上涨 30.25%。分行业看,休闲服务、食品饮料、医药生物、电子、传媒、电气设备等表现相对较好;建筑装饰、纺织服装、采掘、银行等行业收益依然为负。

展望未来,虽然经济方面的压力依然很大,但是最不确定的阶段已经过去。加上流动性的宽裕和国家对资本市场的定位重视,我们对未来并不悲观,投资上,我们会在适当的时候,加大对权重板块的配置,努力为投资者创造收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金份额净值为 1.523 元,份额累计净值为 1.523 元;本报告期间基金份额净值增长率为 15.47%,业绩比较基准收益率为 8.97%。

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	830, 193, 485. 05	90. 55
	其中: 股票	830, 193, 485. 05	90. 55
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	85, 683, 946. 57	9. 35
8	其他资产	921, 855. 80	0. 10
9	合计	916, 799, 287. 42	100.00

- 注:1、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。
 - 2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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	-	_
В	采矿业	-	_
С	制造业	505, 963, 713. 10	56. 52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应 业	12, 766. 32	0.00
Е	建筑业	-	_
F	批发和零售业	132, 848, 639. 00	14. 84
G	交通运输、仓储和邮政业	5, 593, 327. 12	0. 62
Н	住宿和餐饮业	_	_
Ι	信息传输、软件和信息技术服务业	5, 083, 731. 77	0. 57
J	金融业	_	_
K	房地产业	75, 527, 090. 00	8. 44
L	租赁和商务服务业	76, 652, 217. 74	8. 56
M	科学研究和技术服务业	_	_
N	水利、环境和公共设施管理业	28, 512, 000. 00	3. 18
0	居民服务、修理和其他服务业	_	_
Р	教育	_	_
Q	卫生和社会工作	_	_
R	文化、体育和娱乐业	_	_
S	综合	_	_

	A.H.	020 102 405 05	02 72
	台 订	830, 193, 485. 05	92.73

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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。

5.3 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	600976	健民集团	5, 098, 700	91, 623, 639. 00	10. 23
2	002415	海康威视	2, 687, 300	81, 559, 555. 00	9. 11
3	002027	分众传媒	11, 841, 865	65, 959, 188. 05	7. 37
4	600060	海信视像	4, 949, 800	60, 140, 070. 00	6. 72
5	600426	华鲁恒升	3, 148, 900	55, 672, 552. 00	6. 22
6	000002	万 科A	2, 040, 300	53, 333, 442. 00	5. 96
7	603001	奥康国际	6, 796, 600	52, 877, 548. 00	5. 91
8	600887	伊利股份	1, 411, 200	43, 930, 656. 00	4. 91
9	000333	美的集团	700, 000	41, 853, 000. 00	4. 67
10	600993	马应龙	1, 700, 000	41, 225, 000. 00	4. 60

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

本基金本报告期未进行国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

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,或在报告编制目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是否超出基金合同规定的备选股票库

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	225, 419. 62
2	应收证券清算款	_
3	应收股利	_
4	应收利息	9, 711. 81
5	应收申购款	686, 724. 37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	_
8	其他	-

9	合计	921, 855. 80
3	H VI	921, 000. 00

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

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

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	728, 042, 562. 68
报告期期间基金总申购份额	18, 466, 098. 00
减:报告期期间基金总赎回份额	158, 746, 562. 98
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	587, 762, 097. 70

§ 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	10, 006, 300. 00
基金份额	10, 000, 300. 00
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	10,006,200,00
基金份额	10, 006, 300. 0
报告期期末持有的本基金份	1.70
额占基金总份额比例(%)	1. /

本报告期,本基金管理人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

本报告期内,基金管理人不存在申购、赎回或交易本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予注册东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金的文件;
- 2、《东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
- 3、《东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
- 4、东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金财务报表及报表附注;
- 5、报告期内在规定媒介上披露的各项公告;
- 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。

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 2020 年 7 月 21 日