

## 2015 年度公司旗下基金风险评价

根据《上海东方证券资产管理有限公司基金风险等级评价办法》，以 2015 年度各基金产品相关指标为主要参数，进行基金的风险评价，各基金的风险等级如下。评价日为 2016 年 3 月 31 日。

序号	产品名称	风险等级
1	东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金	中高风险
2	东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金	中高风险
3	东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金	中高风险
4	东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金	中高风险
5	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	中高风险
6	东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金	中高风险
7	东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金	中高风险
8	东方红稳健精选混合型证券投资基金 A	中风险
	东方红稳健精选混合型证券投资基金 C	中风险
9	东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金	中高风险
10	东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 A	中高风险
	东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 C	中高风险
11	东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金	中高风险
12	东方红优势精选灵活配置混合型发起式证券投资基金	中高风险
13	东方红收益增强债券型证券投资基金 A	中风险
	东方红收益增强债券型证券投资基金 C	中风险
14	东方红纯债债券型发起式证券投资基金	中低风险
15	东方红信用债债券型证券投资基金 A	中风险
	东方红信用债债券型证券投资基金 C	中风险
16	东方红睿轩沪港深灵活配置混合型证券投资基金	中高风险

## 目录

一、	东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金.....	1
二、	东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金.....	3
三、	东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金.....	5
四、	东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金.....	7
五、	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.....	9
六、	东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金.....	11
七、	东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金.....	13
八、	东方红稳健精选混合型证券投资基金.....	15
九、	东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金.....	19
十、	东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金.....	21
十一、	东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金.....	25
十二、	东方红优势精选灵活配置混合型发起式证券投资基金.....	27
十三、	东方红收益增强债券型证券投资基金.....	29
十四、	东方红纯债债券型发起式证券投资基金.....	30
十五、	东方红信用债债券型证券投资基金.....	31
十六、	东方红睿轩沪港深灵活配置混合型证券投资基金.....	32

## 一、 东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金

东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“东方红新动力混合”）成立于2014年1月28日，根据基金合同中各类资产的投资比例：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%；基金投资受益于新动力的股票不低于非现金基金资产的80%，属于其他混合型基金。

### 1. 股票平均仓位

由下表可见，东方红新动力混合的股票平均仓位为88.30%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2015年第1季度	1,547,938,004.48	1,646,821,730.54	94.00%
2015年第2季度	1,637,000,281.38	1,776,950,805.96	92.12%
2015年第3季度	835,947,420.91	1,069,669,772.58	78.15%
2015年第4季度	1,143,127,051.31	1,285,168,867.11	88.95%
平均股票仓位			<b>88.30%</b>

### 2. 净值波动率

经计算，自2015年第一季度起始日至2015年第四季报截止日，共经历4个完整的季报期间（即2015年1月1日-2015年12月31日），东方红新动力混合日收益率的标准差为1.99%。

### 3. 最大回撤率

经计算，自2015年第一季度起始日至2015年第四季报截止日，共经历4个完整的季报期间（即2015年1月1日-2015年12月31日），这4个季报期间内，东方红新动力混合的最大回撤为30.32%。

### 4. 产品历史规模

由下表可见，东方红新动力混合的产品历史规模为1,444,652,794.05元。

时间	期末基金资产净值
----	----------

2015 年第 1 季度	1,646,821,730.54
2015 年第 2 季度	1,776,950,805.96
2015 年第 3 季度	1,069,669,772.58
2015 年第 4 季度	1,285,168,867.11
<b>平均规模</b>	<b>1,444,652,794.05</b>

## 5. 违规次数

东方红新动力混合未出现过违规情况。

根据《上海东方证券资产管理有限公司基金风险等级评价办法》，其他混合型基金的指标评分标准如下表：

股票平均仓位	0	0~20%	20%(含)~40%	40%(含)~80%	80%(含)以上
风险分值	0	0.5	1	1.5	2
净值波动率	0~0.2%	0.2%(含)~0.5%	0.5%(含)~1%	1%(含)~1.5%	1.5%(含)以上
风险分值	0	0.5	1	1.5	2
最大回撤率	0(含)~5%	5% (含)~10%	10%(含)以上		
风险分值	0	0.5	1		
历史规模	1 亿元以上	1 亿元以下			
风险分值	0	0.5			
违规次数	0	1	>1		
风险分值	0	0.5	1		

将各风险指标分值求和，得到东方红新动力混合的总风险分值为 5，属于**中高风险**产品。

## 二、 东方红产业升级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（以下简称“东方红产业升级混合”）成立于 2014 年 6 月 6 日，根据基金合同中各类资产的投资比例：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%；基金投资于产业升级的证券不低于非现金基金资产的 80%，属于其他混合型基金。

### 1. 股票平均仓位

由下表可见，东方红产业升级混合的股票平均仓位为 88.85%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2015 年第 1 季度	1,168,529,714.28	1,200,749,647.21	97.32%
2015 年第 2 季度	671,744,952.71	732,152,849.26	91.75%
2015 年第 3 季度	463,314,598.72	598,682,806.51	77.39%
2015 年第 4 季度	583,799,032.62	656,378,597.98	88.94%
平均股票仓位			<b>88.85%</b>

### 2. 净值波动率

经计算，自 2015 年第一季度起始日至 2015 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2015 年 1 月 1 日~2015 年 12 月 31 日），东方红产业升级混合日收益率的标准差为 2.09%。

### 3. 最大回撤率

经计算，自 2015 年第一季度起始日至 2015 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2015 年 1 月 1 日~2015 年 12 月 31 日），这 4 个季报期间内，东方红产业升级混合的最大回撤为 32.05%。

### 4. 产品历史规模

由下表可见，东方红产业升级混合的产品历史规模为 796,990,975.24 元。

时间	期末基金资产净值
----	----------

2015年第1季度	1,200,749,647.21
2015年第2季度	732,152,849.26
2015年第3季度	598,682,806.51
2015年第4季度	656,378,597.98
<b>平均规模</b>	<b>796,990,975.24</b>

## 5. 违规次数

东方红产业升级混合未出现过违规情况。

根据《上海东方证券资产管理有限公司基金风险等级评价办法》，其他混合型基金的指标评分标准如下表：

股票平均仓位	0	0~20%	20%(含)~40%	40%(含)~80%	80%(含)以上
风险分值	0	0.5	1	1.5	2
净值波动率	0~0.2%	0.2%(含)~0.5%	0.5%(含)~1%	1%(含)~1.5%	1.5%(含)以上
风险分值	0	0.5	1	1.5	2
最大回撤率	0(含)~5%	5%(含)~10%	10%(含)以上		
风险分值	0	0.5	1		
历史规模	1亿元以上	1亿元以下			
风险分值	0	0.5			
违规次数	0	1	>1		
风险分值	0	0.5	1		

将各风险指标分值求和，得到东方红产业升级混合的总风险分值为5，属于**中高风险**产品。

### 三、 东方红睿丰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（以下简称“东方红睿丰混合”）于 2014 年 9 月 19 日成立。根据基金合同中各类资产的投资比例：本基金转换为上市开放式基金（LOF）后股票资产投资比例为基金资产的 0%—95%，封闭期内股票资产投资比例为基金资产的 0%—100%；权证投资比例为基金资产净值的 0%-3%；每个交易日日终，在扣除国债期货和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%，封闭期内不受上述 5%的限制，属于其他混合型基金。

#### 1. 股票平均仓位

由下表可见，东方红睿丰混合的股票平均仓位为 86.06%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2015 年第 1 季度	2,016,447,998.18	2,187,909,879.81	92.16%
2015 年第 2 季度	2,381,106,695.66	2,682,650,866.33	88.76%
2015 年第 3 季度	1,913,950,043.58	2,418,997,264.36	79.12%
2015 年第 4 季度	2,420,582,197.95	2,874,605,188.28	84.21%
平均股票仓位			<b>86.06%</b>

#### 2. 净值波动率

经计算，自 2015 年第一季度起始日至 2015 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2015 年 1 月 1 日~2015 年 12 月 31 日），东方红睿丰混合日收益率的标准差为 1.97%。

#### 3. 最大回撤率

经计算，自 2015 年第一季度起始日至 2015 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2015 年 1 月 1 日~2015 年 12 月 31 日），这 4 个季报期间内，东方红睿丰混合的最大回撤为 22.52%。

#### 4. 产品历史规模

由下表可见，东方红睿丰混合的产品历史规模为 2,541,040,799.70 元。

时间	期末基金资产净值
2015 年第 1 季度	2,187,909,879.81
2015 年第 2 季度	2,682,650,866.33
2015 年第 3 季度	2,418,997,264.36
2015 年第 4 季度	2,874,605,188.28
平均规模	<b>2,541,040,799.70</b>

## 5. 违规次数

东方红睿丰混合未出现过违规情况。

根据《上海东方证券资产管理有限公司基金风险等级评价办法》，其他混合型基金的指标评分标准如下表：

股票平均仓位	0	0~20%	20%(含)~40%	40%(含)~80%	80%(含)以上
风险分值	0	0.5	1	1.5	2
净值波动率	0~0.2%	0.2%(含)~0.5%	0.5%(含)~1%	1%(含)~1.5%	1.5%(含)以上
风险分值	0	0.5	1	1.5	2
最大回撤率	0(含)~5%	5% (含)~10%	10%(含)以上		
风险分值	0	0.5	1		
历史规模	1 亿元以上	1 亿元以下			
风险分值	0	0.5			
违规次数	0	1	>1		
风险分值	0	0.5	1		

将各风险指标分值求和，得到东方红睿丰混合的总风险分值为 5，属于中高风险产品。



## 四、 东方红睿阳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（以下简称“东方红睿阳混合”）于 2015 年 1 月 19 日成立。根据基金合同中各类资产的投资比例：本基金转换为上市开放式基金（LOF）后股票资产投资比例为基金资产的 0%—95%，封闭期内股票资产投资比例为基金资产的 0%—100%；权证投资比例为基金资产净值的 0%-3%；每个交易日日终，在扣除国债期货和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%，封闭期内不受上述 5%的限制，属于其他混合型基金。

### 1. 股票平均仓位

经计算，自成立日至 2015 年四季报截止日，共经历 3 个完整的季报期间（即 2015 年 4 月 1 日-2015 年 12 月 31 日），由下表可见，东方红睿阳混合的股票平均仓位为 82.56%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2015 年第 2 季度	639,027,576.13	727,288,574.85	87.86%
2015 年第 3 季度	498,977,935.76	655,294,571.64	76.15%
2015 年第 4 季度	650,974,706.52	778,106,561.05	83.66%
平均股票仓位			<b>82.56%</b>

### 2. 净值波动率

经计算，自成立日至 2015 年四季报截止日，共经历 3 个完整的季报期间（即 2015 年 4 月 1 日-2015 年 12 月 31 日），东方红睿阳混合日收益率的标准差为 2.19%。

### 3. 最大回撤率

经计算，自成立日至 2015 年四季报截止日，共经历 3 个完整的季报期间（即 2015 年 4 月 1 日-2015 年 12 月 31 日），这 3 个季报期间内，东方红睿阳混合的最大回撤为 22.79%。

### 4. 产品历史规模

经计算，自成立日至 2015 年四季报截止日，共经历 3 个完整的季报期间（即 2015 年 4 月 1 日-2015 年 12 月 31 日），由下表可见，东方红睿阳混合的产品历史规模为 720,229,902.51 元。

时间	期末基金资产净值
2015 年第 2 季度	727,288,574.85
2015 年第 3 季度	655,294,571.64
2015 年第 4 季度	778,106,561.05
平均规模	<b>720,229,902.51</b>

## 5. 违规次数

东方红睿阳混合未出现过违规情况。

根据《上海东方证券资产管理有限公司基金风险等级评价办法》，其他混合型基金的指标评分标准如下表：

股票平均仓位	0	0~20%	20%(含)~40%	40%(含)~80%	80%(含)以上
风险分值	0	0.5	1	1.5	2
净值波动率	0~0.2%	0.2%(含)~0.5%	0.5%(含)~1%	1%(含)~1.5%	1.5%(含)以上
风险分值	0	0.5	1	1.5	2
最大回撤率	0(含)~5%	5% (含)~10%	10%(含)以上		
风险分值	0	0.5	1		
历史规模	1 亿元以上	1 亿元以下			
风险分值	0	0.5			
违规次数	0	1	>1		
风险分值	0	0.5	1		

将各风险指标分值求和，得到东方红睿阳混合的总风险分值为 5，属于**中高风险**产品。

## 五、 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

东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“东方红睿元混合”）于2015年1月21日成立。根据基金合同中各类资产的投资比例：开放期内每个交易日日终，股票资产投资比例为基金资产的0%—95%，封闭期内每个交易日日终，股票资产投资比例为基金资产的0%—100%；权证投资比例为基金资产的0%-3%；开放期每个交易日日终，在扣除股指期货和国债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%，封闭期内不受上述5%的限制，但每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。属于其他混合型基金。

### 1. 股票平均仓位

经计算，自成立日至2015年四季报截止日，共经历3个完整的季报期间（即2015年4月1日-2015年12月31日），由下表可见，东方红睿元混合的股票平均仓位为83.68%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2015年第2季度	817,623,260.96	918,293,582.50	89.04%
2015年第3季度	639,795,657.01	826,603,813.43	77.40%
2015年第4季度	832,009,639.19	983,532,352.09	84.59%
平均股票仓位			<b>83.68%</b>

### 2. 净值波动率

经计算，自成立日至2015年四季报截止日，共经历3个完整的季报期间（即2015年4月1日-2015年12月31日），东方红睿元混合日收益率的标准差为2.22%。

### 3. 最大回撤率

经计算，自成立日至2015年四季报截止日，共经历3个完整的季报期间（即2015年4月11日-2015年12月31日），这3个季报期间内，东方红睿元混合的最大回撤为22.95%。

#### 4. 产品历史规模

经计算，自成立日至 2015 年四季报截止日，共经历 3 个完整的季报期间（即 2015 年 4 月 1 日-2015 年 12 月 31 日），由下表可见，东方红睿元混合的产品历史规模为 909,476,582.67 元。

时间	期末基金资产净值
2015 年第 2 季度	918,293,582.50
2015 年第 3 季度	826,603,813.43
2015 年第 4 季度	983,532,352.09
平均规模	909,476,582.67

#### 5. 违规次数

东方红睿元混合未出现过违规情况。

根据《上海东方证券资产管理有限公司基金风险等级评价办法》，其他混合型基金的指标评分标准如下表：

股票平均仓位	0	0~20%	20%(含)~40%	40%(含)~80%	80%(含)以上
风险分值	0	0.5	1	1.5	2
净值波动率	0~0.2%	0.2%(含)~0.5%	0.5%(含)~1%	1%(含)~1.5%	1.5%(含)以上
风险分值	0	0.5	1	1.5	2
最大回撤率	0(含)~5%	5%(含)~10%	10%(含)以上		
风险分值	0	0.5	1		
历史规模	1 亿元以上	1 亿元以下			
风险分值	0	0.5			
违规次数	0	1	>1		
风险分值	0	0.5	1		

将各风险指标分值求和，得到东方红睿元混合的总风险分值为 5，属于**中高风险**产品。

## 六、 东方红中国优势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（以下简称“东方红中国优势混合”）于2015年4月7日成立。根据基金合同中各类资产的投资比例：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和国债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%；基金投资于中国优势相关的证券不低于非现金基金资产的80%，属于其他混合型基金。

### 1. 股票平均仓位

经计算，自成立日至2015年四季报截止日，共经历2个完整的季报期间（即2015年7月1日-2015年12月31日），由下表可见，东方红中国优势混合的股票平均仓位为80.62%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2015年第3季度	5,086,478,050.24	7,133,950,010.51	71.30%
2015年第4季度	5,579,313,231.82	6,203,834,366.01	89.93%
平均股票仓位			<b>80.62%</b>

### 2. 净值波动率

经计算，自成立日至2015年四季报截止日，共经历2个完整的季报期间（即2015年7月1日-2015年12月31日），东方红中国优势混合日收益率的标准差为1.83%。

### 3. 最大回撤率

经计算，自成立日至2015年四季报截止日，共经历2个完整的季报期间（即2015年7月1日-2015年12月31日），这2个季报期间内，东方红中国优势混合的最大回撤为24.14%。

### 4. 产品历史规模

经计算，自成立日至2015年四季报截止日，共经历2个完整的季报期间（即2015年7月1日-2015年12月31日），由下表可见，东方红中国优势混合的产品历史规模为6,668,892,188.26元。

时间	期末基金资产净值
----	----------

2015 年第 3 季度	7,133,950,010.51
2015 年第 4 季度	6,203,834,366.01
平均规模	<b>6,668,892,188.26</b>

## 5. 违规次数

东方红中国优势混合未出现过违规情况。

根据《上海东方证券资产管理有限公司基金风险等级评价办法》，其他混合型基金的指标评分标准如下表：

股票平均仓位	0	0~20%	20%(含)~40%	40%(含)~80%	80%(含)以上
风险分值	0	0.5	1	1.5	2
净值波动率	0~0.2%	0.2%(含)~0.5%	0.5%(含)~1%	1%(含)~1.5%	1.5%(含)以上
风险分值	0	0.5	1	1.5	2
最大回撤率	0(含)~5%	5% (含)~10%	10%(含)以上		
风险分值	0	0.5	1		
历史规模	1 亿元以上	1 亿元以下			
风险分值	0	0.5			
违规次数	0	1	>1		
风险分值	0	0.5	1		

将各风险指标分值求和，得到东方红中国优势混合的总风险分值为 5，属于**中高风险**产品。

## 七、 东方红领先精选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（以下简称“东方红领先精选混合”）于 2015 年 4 月 17 日成立。根据基金合同中各类资产的投资比例：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和国债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%，属于其他混合型基金。

### 1. 股票平均仓位

经计算，自成立日至 2015 年四季报截止日，共经历 2 个完整的季报期间（即 2015 年 7 月 1 日-2015 年 12 月 31 日），由下表可见，东方红领先精选混合的股票平均仓位为 17.45%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2015 年第 3 季度	140,713,533.78	879,806,588.31	15.99%
2015 年第 4 季度	133,539,626.56	706,325,413.83	18.91%
平均股票仓位			<b>17.45%</b>

### 2. 净值波动率

经计算，自成立日至 2015 年四季报截止日，共经历 2 个完整的季报期间（即 2015 年 7 月 1 日-2015 年 12 月 31 日），东方红领先精选混合日收益率的标准差为 0.55%。

### 3. 最大回撤率

经计算，自成立日至 2015 年四季报截止日，共经历 2 个完整的季报期间（即 2015 年 7 月 1 日-2015 年 12 月 31 日），这 2 个季报期间内，东方红领先精选混合的最大回撤为 6.16%。

### 4. 产品历史规模

经计算，自成立日至 2015 年四季报截止日，共经历 2 个完整的季报期间（即 2015 年 7 月 1 日-2015 年 12 月 31 日），由下表可见，东方红领先精选混合的产品历史规模为 793,066,001.07 元。

时间	期末基金资产净值
2015 年第 3 季度	879,806,588.31
2015 年第 4 季度	706,325,413.83

平均规模	793,066,001.07
------	----------------

## 5. 违规次数

东方红领先精选混合未出现过违规情况。

根据《上海东方证券资产管理有限公司基金风险等级评价办法》，其他混合型基金的指标评分标准如下表：

股票平均仓位	0	0~20%	20%(含)~40%	40%(含)~80%	80%(含)以上
风险分值	0	0.5	1	1.5	2
净值波动率	0~0.2%	0.2%(含)~0.5%	0.5%(含)~1%	1%(含)~1.5%	1.5%(含)以上
风险分值	0	0.5	1	1.5	2
最大回撤率	0(含)~5%	5%(含)~10%	10%(含)以上		
风险分值	0	0.5	1		
历史规模	1亿元以上	1亿元以下			
风险分值	0	0.5			
违规次数	0	1	>1		
风险分值	0	0.5	1		

将各风险指标分值求和，得到东方红领先精选混合的总风险分值为2，属于**中高风险**产品。



## 八、 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（以下简称“东方红稳健精选混合”）于 2015 年 4 月 17 日成立。根据基金合同中各类资产的投资比例：股票资产投资比例为基金资产的 0%—30%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债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%，属于偏债混合型基金。

### （一）东方红稳健精选混合型证券投资基金 A

#### 1. 股票平均仓位

经计算，自成立日至 2015 年四季报截止日，共经历 2 个完整的季报期间（即 2015 年 7 月 1 日-2015 年 12 月 31 日），由下表可见，东方红稳健精选混合 A 的股票平均仓位为 1.85%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2015 年第 3 季度	-	3,167,174,359.30	-
2015 年第 4 季度	76,601,150.91	4,143,098,332.79	1.85%
平均股票仓位			1.85%

#### 2. 净值波动率

经计算，自成立日至 2015 年四季报截止日，共经历 2 个完整的季报期间（即 2015 年 7 月 1 日-2015 年 12 月 31 日），东方红稳健精选混合 A 日收益率的标准差为 0.09%。

#### 3. 最大回撤率

经计算，自成立日至 2015 年四季报截止日，共经历 2 个完整的季报期间（即 2015 年 7 月 1 日-2015 年 12 月 31 日），这 2 个季报期间内，东方红稳健精选混合 A 的最大回撤为 0.47%。

#### 4. 产品历史规模

经计算，自成立日至 2015 年四季报截止日，共经历 2 个完整的季报期间（即 2015 年 7 月 1 日-2015 年 12 月 31 日），由下表可见，东方红稳健精选混合 A 的产品历史规模为 3,496,557,823.39 元。

时间	期末基金资产净值
2015 年第 3 季度	3,161,122,479.62
2015 年第 4 季度	3,831,993,167.15
平均规模	<b>3,496,557,823.39</b>

## 5. 违规次数

东方红稳健精选混合 A 未出现过违规情况。

根据《上海东方证券资产管理有限公司基金风险等级评价办法》，偏债混合型基金的指标评分标准如下表：

股票平均仓位	0	0~20%	20%(含)~30%		
风险分值	0	0.5	1		
净值波动率	0~0.1%	0.1%(含)~0.2%	0.2%(含)~0.5%	0.5%(含)~1%	1%(含)以上
风险分值	0	0.5	1	1.5	2
最大回撤率	0(含)~1%	1% (含)~5%	5%(含)以上		
风险分值	0	0.5	1		
历史规模	1 亿元以上	1 亿元以下			
风险分值	0	0.5			
违规次数	0	1	>1		
风险分值	0	0.5	1		

将各风险指标分值求和，得到东方红稳健精选混合 A 的总风险分值为 0.5，属于中低风险产品，鉴于已成立基金的风险等级在原则上不低于初始风险，因此，人工调整至**中风险**产品。

## (二) 东方红稳健精选混合型证券投资基金 C

### 1. 股票平均仓位

经计算，自成立日至 2015 年四季报截止日，共经历 2 个完整的季报期间（即 2015 年 7 月 1 日-2015 年 12 月 31 日），由下表可见，东方红稳健精选混合 C 的股票平均仓位为 1.85%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2015 年第 3 季度	-	3,167,174,359.30	-

2015 年第 4 季度	76,601,150.91	4,143,098,332.79	1.85%
平均股票仓位			<b>1.85%</b>

## 2. 净值波动率

经计算，自成立日至 2015 年四季报截止日，共经历 2 个完整的季报期间（即 2015 年 7 月 1 日-2015 年 12 月 31 日），东方红稳健精选混合 C 日收益率的标准差为 0.28%。

## 3. 最大回撤率

经计算，自成立日至 2015 年四季报截止日，共经历 2 个完整的季报期间（即 2015 年 7 月 1 日-2015 年 12 月 31 日），这 2 个季报期间内，东方红稳健精选混合 C 的最大回撤为 0.55%。

## 4. 产品历史规模

经计算，自成立日至 2015 年四季报截止日，共经历 2 个完整的季报期间（即 2015 年 7 月 1 日-2015 年 12 月 31 日），由下表可见，东方红稳健精选混合 C 的产品历史规模为 158,578,522.66 元。

时间	期末基金资产净值
2015 年第 3 季度	6,051,879.68
2015 年第 4 季度	311,105,165.64
平均规模	<b>158,578,522.66</b>

## 5. 违规次数

东方红稳健精选混合 C 未出现过违规情况。

根据《上海东方证券资产管理有限公司基金风险等级评价办法》，偏债混合型基金的指标评分标准如下表：

股票平均仓位	0	0~20%	20%(含)~30%		
风险分值	0	0.5	1		
净值波动率	0~0.1%	0.1%(含)~0.2%	0.2%(含)~0.5%	0.5%(含)~1%	1%(含)以上

风险分值	0	0.5	1	1.5	2
最大回撤率	0(含)~1%	1% (含)~5%	5%(含)以上		
风险分值	0	0.5	1		
历史规模	1 亿元以上	1 亿元以下			
风险分值	0	0.5			
违规次数	0	1	>1		
风险分值	0	0.5	1		

将各风险指标分值求和，得到东方红稳健精选混合 C 的总风险分值为 1.5，属于**中风**

**险**产品。

## 九、 东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金

东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金(以下简称“东方红睿逸混合”)于 2015 年 6 月 3 日成立。根据基金合同中各类资产的投资比例: 本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 50%, 本基金投资于股票的比例不高于基金资产的 50%。在开放期, 每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后, 本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%, 在封闭期, 本基金不受前述 5%的限制, 属于其他混合型基金。

### 1. 股票平均仓位

由下表可见, 东方红睿逸混合的股票平均仓位为 21.58%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2015 年第 3 季度	204,754,857.53	1,035,129,075.86	19.78%
2015 年第 4 季度	258,898,513.01	1,107,261,851.09	23.38%
平均股票仓位			<b>21.58%</b>

### 2. 净值波动率

经计算, 自成立日至 2015 年四季报截止日, 共经历 2 个完整的季报期间(即 2015 年 7 月 1 日-2015 年 12 月 31 日), 东方红睿逸混合日收益率的标准差为 0.49%。

### 3. 最大回撤率

经计算, 自成立日至 2015 年四季报截止日, 共经历 2 个完整的季报期间(即 2015 年 7 月 1 日-2015 年 12 月 31 日), 这 2 个季报期间内, 东方红睿逸混合的最大回撤为 5.45%。

### 4. 产品历史规模

由下表可见, 东方红睿逸混合的产品历史规模为 1,071,195,463.48 元。

时间	期末基金资产净值
2015 年第 3 季度	1,035,129,075.86
2015 年第 4 季度	1,107,261,851.09
平均规模	<b>1,071,195,463.48</b>

## 5. 违规次数

东方红睿逸混合未出现过违规情况。

根据《上海东方证券资产管理有限公司基金风险等级评价办法》，其他混合型基金的指标评分标准如下表：

股票平均仓位	0	0~20%	20%(含)~40%	40%(含)~80%	80%(含)以上
风险分值	0	0.5	1	1.5	2
净值波动率	0~0.2%	0.2%(含)~0.5%	0.5%(含)~1%	1%(含)~1.5%	1.5%(含)以上
风险分值	0	0.5	1	1.5	2
最大回撤率	0(含)~5%	5%(含)~10%	10%(含)以上		
风险分值	0	0.5	1		
历史规模	1亿元以上	1亿元以下			
风险分值	0	0.5			
违规次数	0	1	>1		
风险分值	0	0.5	1		

将各风险指标分值求和，得到东方红睿逸混合的总风险分值为 2，属于**中高风险**产品。

## 十、 东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“东方红策略精选混合”)于 2015 年 6 月 5 日成立。根据基金合同中各类资产的投资比例: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及国债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%,属于其他混合型基金。

### (一) 东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 A

#### 1. 股票平均仓位

由下表可见,东方红策略精选混合 A 的股票平均仓位为 5.49%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2015 年第 3 季度	922,000.00	12,732,437.44	7.24%
2015 年第 4 季度	101,805,171.87	2,725,981,165.08	3.73%
平均股票仓位			<b>5.49%</b>

#### 2. 净值波动率

经计算,自成立日至 2015 年四季报截止日,共经历 2 个完整的季报期间(即 2015 年 7 月 1 日-2015 年 12 月 31 日),东方红策略精选混合 A 日收益率的标准差为 0.27%。

#### 3. 最大回撤率

经计算,自成立日至 2015 年四季报截止日,共经历 2 个完整的季报期间(即 2015 年 7 月 1 日-2015 年 12 月 31 日),这 2 个季报期间内,东方红策略精选混合 A 的最大回撤为 3.52%。

#### 4. 产品历史规模

由下表可见,东方红策略精选混合 A 的产品历史规模为 47,938,960.36 元。

时间	期末基金资产净值
2015 年第 3 季度	12,606,729.94
2015 年第 4 季度	83,271,190.78

平均规模	47,938,960.36
------	---------------

## 5. 违规次数

东方红策略精选混合 A 未出现过违规情况。

根据《上海东方证券资产管理有限公司基金风险等级评价办法》，其他混合型基金的指标评分标准如下表：

股票平均仓位	0	0~20%	20%(含)~40%	40%(含)~80%	80%(含)以上
风险分值	0	0.5	1	1.5	2
净值波动率	0~0.2%	0.2%(含)~0.5%	0.5%(含)~1%	1%(含)~1.5%	1.5%(含)以上
风险分值	0	0.5	1	1.5	2
最大回撤率	0(含)~5%	5%(含)~10%	10%(含)以上		
风险分值	0	0.5	1		
历史规模	1 亿元以上	1 亿元以下			
风险分值	0	0.5			
违规次数	0	1	>1		
风险分值	0	0.5	1		

将各风险指标分值求和，得到东方红策略精选混合 A 的总风险分值为 1.5，属于中风险产品，鉴于基金合同生效后，如当期评价低于该基金的初始风险等级，原则上适用初始风险等级，因此，人工调整至**中高风险**产品。

## (二) 东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 C

### 1. 股票平均仓位

由下表可见，东方红策略精选混合 C 的股票平均仓位为 5.49%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2015 年第 3 季度	922,000.00	12,732,437.44	7.24%
2015 年第 4 季度	101,805,171.87	2,725,981,165.08	3.73%
平均股票仓位			<b>5.49%</b>

### 2. 净值波动率



经计算，自成立日至 2015 年四季报截止日，共经历 2 个完整的季报期间（即 2015 年 7 月 1 日-2015 年 12 月 31 日），东方红策略精选混合 C 日收益率的标准差为 0.25%。

### 3. 最大回撤率

经计算，自成立日至 2015 年四季报截止日，共经历 2 个完整的季报期间（即 2015 年 7 月 1 日-2015 年 12 月 31 日），这 2 个季报期间内，东方红策略精选混合 C 的最大回撤为 4%。

### 4. 产品历史规模

由下表可见，东方红策略精选混合 C 的产品历史规模为 1,321,417,840.90 元。

时间	期末基金资产净值
2015 年第 3 季度	125,707.50
2015 年第 4 季度	2,642,709,974.30
平均规模	<b>1,321,417,840.90</b>

### 5. 违规次数

东方红策略精选混合 C 未出现过违规情况。

根据《上海东方证券资产管理有限公司基金风险等级评价办法》，其他混合型基金的指标评分标准如下表：

股票平均仓位	0	0~20%	20%(含)~40%	40%(含)~80%	80%(含)以上
风险分值	0	0.5	1	1.5	2
净值波动率	0~0.2%	0.2%(含)~0.5%	0.5%(含)~1%	1%(含)~1.5%	1.5%(含)以上
风险分值	0	0.5	1	1.5	2
最大回撤率	0(含)~5%	5%(含)~10%	10%(含)以上		
风险分值	0	0.5	1		
历史规模	1 亿元以上	1 亿元以下			
风险分值	0	0.5			
违规次数	0	1	>1		
风险分值	0	0.5	1		

将各风险指标分值求和，得到东方红策略精选混合 C 的总风险分值为 1，属于中风险产

品，鉴于基金合同生效后，如当期评价低于该基金的初始风险等级，原则上适用初始风险等级，因此，人工调整至**中高风险**产品。

## 十一、 东方红京东大数据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投资基金(以下简称“东方红京东大数据混合”)于 2015 年 7 月 31 日成立。根据基金合同中各类资产的投资比例: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和国债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%,属于其他混合型基金。

### 1. 股票平均仓位

经计算,自成立日至 2015 年四季报截止日,共经历 1 个完整的季报期间(即 2015 年 10 月 1 日-2015 年 12 月 31 日),由下表可见,东方红京东大数据混合的股票平均仓位为 64.62%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2015 年第 4 季度	643,990,396.20	996,577,796.32	64.62%
平均股票仓位			<b>64.62%</b>

### 2. 净值波动率

经计算,自成立日至 2015 年四季报截止日,共经历 1 个完整的季报期间(即 2015 年 10 月 1 日-2015 年 12 月 31 日),东方红京东大数据混合日收益率的标准差为 0.81%。

### 3. 最大回撤率

经计算,自成立日至 2015 年四季报截止日,共经历 1 个完整的季报期间(即 2015 年 10 月 1 日-2015 年 12 月 31 日),这 1 个季报期间内,东方红京东大数据混合的最大回撤为 2.51%。

### 4. 产品历史规模

经计算,自成立日至 2015 年四季报截止日,共经历 1 个完整的季报期间(即 2015 年 10 月 1 日-2015 年 12 月 31 日),由下表可见,东方红京东大数据混合的产品历史规模为 996,577,796.32 元。

时间	期末基金资产净值
----	----------

2015 年第 4 季度	996,577,796.32
平均规模	<b>996,577,796.32</b>

## 5. 违规次数

东方红京东大数据混合未出现过违规情况。

根据《上海东方证券资产管理有限公司基金风险等级评价办法》，其他混合型基金的指标评分标准如下表：

股票平均仓位	0	0~20%	20%(含)~40%	40%(含)~80%	80%(含)以上
风险分值	0	0.5	1	1.5	2
净值波动率	0~0.2%	0.2%(含)~0.5%	0.5%(含)~1%	1%(含)~1.5%	1.5%(含)以上
风险分值	0	0.5	1	1.5	2
最大回撤率	0(含)~5%	5%(含)~10%	10%(含)以上		
风险分值	0	0.5	1		
历史规模	1 亿元以上	1 亿元以下			
风险分值	0	0.5			
违规次数	0	1	>1		
风险分值	0	0.5	1		

将各风险指标分值求和，得到东方红京东大数据混合的总风险分值为 2.5，属于**中高**

**风险**产品。

## 十二、 东方红优势精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

东方红优势精选灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“东方红优势精选混合”)于 2015 年 9 月 8 日成立。根据基金合同中各类资产的投资比例: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和国债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%,属于其他混合型基金。

### 1. 股票平均仓位

由下表可见,东方红优势精选混合的股票平均仓位为 88.23%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2015 年第 4 季度	462,721,397.74	524,426,781.34	88.23%

### 2. 净值波动率

经计算,自成立日至 2015 年四季报截止日,共经历 1 个完整的季报期间(即 2015 年 10 月 1 日-2015 年 12 月 31 日),东方红优势精选混合日收益率的标准差为 0.85%。

### 3. 最大回撤率

经计算,自成立日至 2015 年四季报截止日,共经历 1 个完整的季报期间(即 2015 年 10 月 1 日-2015 年 12 月 31 日),这 1 个季报期间内,东方红优势精选混合的最大回撤为 4.23%。

### 4. 产品历史规模

由下表可见,东方红优势精选混合的产品历史规模为 524,426,781.34 元。

时间	期末基金资产净值
2015 年第 4 季度	524,426,781.34

### 5. 违规次数

东方红优势精选混合未出现过违规情况。

根据《上海东方证券资产管理有限公司基金风险等级评价办法》，其他混合型基金的指标评分标准如下表：

股票平均仓位	0	0~20%	20%(含)~40%	40%(含)~80%	80%(含)以上
风险分值	0	0.5	1	1.5	2
净值波动率	0~0.2%	0.2%(含)~0.5%	0.5%(含)~1%	1%(含)~1.5%	1.5%(含)以上
风险分值	0	0.5	1	1.5	2
最大回撤率	0(含)~5%	5%(含)~10%	10%(含)以上		
风险分值	0	0.5	1		
历史规模	1亿元以上	1亿元以下			
风险分值	0	0.5			
违规次数	0	1	>1		
风险分值	0	0.5	1		

将各风险指标分值求和，得到东方红优势精选混合的总风险分值为3，属于**中高风险**产品。

### 十三、 东方红收益增强债券型证券投资基金

东方红收益增强债券型证券投资基金（以下简称“东方红收益增强债券”）于 2015 年 11 月 2 日成立。根据基金合同中各类资产的投资比例：基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%；投资于股票、权证等权益类资产的投资比例合计不超过基金资产的 20%，其中基金持有的全部权证市值不超过基金资产净值的 3%；每本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债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%，属于除纯债基金外的债券型基金。

#### （一）东方红收益增强债券型证券投资基金 A

根据《上海东方证券资产管理有限公司基金风险等级评价办法》，东方红收益增强债券型证券投资基金 A 是没有完整季报区间的除纯债基金外的债券型基金，基金风险等级取初始评级，属于**中风险**产品。

#### （二）东方红收益增强债券型证券投资基金 C

根据《上海东方证券资产管理有限公司基金风险等级评价办法》，东方红收益增强债券型证券投资基金 C 是没有完整季报区间的除纯债基金外的债券型基金，基金风险等级取初始评级，属于**中风险**产品。

#### 十四、 东方红纯债债券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（以下简称“东方红纯债债券”）于 2015 年 10 月 26 日成立。根据基金合同中各类资产的投资比例：投资债券的比例不低于基金资产的 80%；本基金不参与股票、权证等权益类资产的投资，可转债仅投资可分离交易可转债的纯债部分，本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，属于纯债基金。

根据《上海东方证券资产管理有限公司基金风险等级评价办法》，东方红纯债债券型发起式证券投资基金是没有完整季报区间的纯债基金，基金风险等级取初始评级，属于**中低风险**产品。



## 十五、 东方红信用债债券型证券投资基金

东方红信用债债券型证券投资基金（以下简称“东方红信用债债券”）于 2015 年 11 月 16 日成立。根据基金合同中各类资产的投资比例：本基金投资于债券的比例不低于 80%，投资于信用债的比例不低于非现金基金资产的 80%，本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券比例合计不低于基金资产净值的 5%，属于债券型基金。

### （一）东方红信用债债券型证券投资基金 A

根据《上海东方证券资产管理有限公司基金风险等级评价办法》，东方红信用债债券型证券投资基金 A 是没有完整季报区间的除纯债基金外的债券型基金，基金风险等级取初始评级，属于**中风险**产品。

### （二）东方红信用债债券型证券投资基金 C

根据《上海东方证券资产管理有限公司基金风险等级评价办法》，东方红信用债债券型证券投资基金 C 是没有完整季报区间的除纯债基金外的债券型基金，基金风险等级取初始评级，属于**中风险**产品。

## 十六、 东方红睿轩沪港深灵活配置混合型证券投资基金

东方红睿轩沪港深灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“东方红沪港深混合”）于2016年1月20日成立。根据基金合同中各类资产的投资比例：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和国债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%，属于其他混合型基金。

根据《上海东方证券资产管理有限公司基金风险等级评价办法》，东方红睿轩沪港深灵活配置混合型证券投资基金是没有完整季报区间的其他混合型基金，基金风险等级取初始评级，属于**中高风险**产品。