

2017 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 2017 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 2018 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（LOF）	中高风险
4	东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金（LOF）	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	东方红纯债债券型发起式证券投资基金	中低风险
14	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
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
17	东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金	中低风险

18	东方红汇阳债券型证券投资基金 A	中风险
	东方红汇阳债券型证券投资基金 C	中风险
	东方红汇阳债券型证券投资基金 Z	中风险
19	东方红汇利债券型证券投资基金 A	中风险
	东方红汇利债券型证券投资基金 C	中风险
20	东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金	中高风险
21	东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金	中高风险
22	东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金	中高风险
23	东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金 A	中风险
	东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金 C	中风险
24	东方红价值精选混合型证券投资基金 A	中风险
	东方红价值精选混合型证券投资基金 C	中风险
25	东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金	中高风险
26	东方红益鑫纯债债券型证券投资基金 A	中低风险
	东方红益鑫纯债债券型证券投资基金 C	中低风险
27	东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金	中高风险
28	东方红货币市场基金 A	低风险
	东方红货币市场基金 B	低风险
	东方红货币市场基金 E	低风险
29	东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金	中高风险
30	东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金	中风险

目录

一、 东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金.....	5
二、 东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金.....	7
三、 东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金 (LOF).....	9
四、 东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金 (LOF).....	11
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.....	13
六、 东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金.....	15
七、 东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金.....	17
八、 东方红稳健精选混合型证券投资基金.....	19
九、 东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金.....	23
十、 东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金.....	25
十一、 东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金.....	29
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.....	31
十三、 东方红纯债债券型发起式证券投资基金.....	33
十四、 东方红收益增强债券型证券投资基金.....	35
十五、 东方红信用债债券型证券投资基金.....	39
十六、 东方红睿轩沪港深灵活配置混合型证券投资基金.....	43
十七、 东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金.....	45
十八、 东方红汇阳债券型证券投资基金.....	47
十九、 东方红汇利债券型证券投资基金.....	52
二十、 东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金.....	56
二十一、 东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金.....	58
二十二、 东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金.....	60
二十三、 东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金.....	62
二十四、 东方红价值精选混合型证券投资基金.....	66
二十五、 东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金.....	70
二十六、 东方红益鑫纯债债券型证券投资基金.....	72
二十七、 东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金.....	75
二十八、 东方红货币市场基金.....	77

二十九、 东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金.....	80
三十、 东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金.....	81

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73.53%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2017年第1季度	1,955,258,445.50	2,961,645,829.86	66.02%
2017年第2季度	2,750,625,403.72	3,768,093,514.39	73.00%
2017年第3季度	3,079,778,618.70	4,128,505,342.23	74.60%
2017年第4季度	3,615,669,229.41	4,491,554,428.36	80.50%
平均股票仓位			73.53%

2. 净值波动率

经计算，自2017年第一季度起始日至2017年第四季报截止日，共经历4个完整的季报期间（即2017年1月1日-2017年12月31日），东方红新动力混合日收益率的标准差为0.57%。

3. 最大回撤率

经计算，自2017年第一季度起始日至2017年第四季报截止日，共经历4个完整的季报期间（即2017年1月1日-2017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7.12%。

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3,837,449,778.71元。

时间	期末基金资产净值
2017年第1季度	2,961,645,829.86
2017年第2季度	3,768,093,514.39
2017年第3季度	4,128,505,342.23
2017年第4季度	4,491,554,428.36
平均规模	3,837,449,778.71

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3，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 87.17%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2017 年第 1 季度	1,196,995,817.67	1,456,519,701.87	82.18%
2017 年第 2 季度	2,164,908,269.72	2,362,998,347.92	91.62%
2017 年第 3 季度	3,004,270,058.26	3,465,816,688.52	86.68%
2017 年第 4 季度	4,865,973,326.62	5,517,784,813.57	88.19%
平均股票仓位			87.17%

2. 净值波动率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），东方红产业升级混合日收益率的标准差为 0.75%。

3. 最大回撤率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 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 7.66%。

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 3,200,779,887.97 元。

时间	期末基金资产净值
2017年第1季度	1,456,519,701.87
2017年第2季度	2,362,998,347.92
2017年第3季度	3,465,816,688.52
2017年第4季度	5,517,784,813.57
平均规模	3,200,779,887.97

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**3.5**，属于**中高风险**

险产品。

三、东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(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, 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

由下表可见, 东方红睿丰混合的股票平均仓位为 78.33%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2017 年第 1 季度	1,754,343,054.59	2,072,854,412.85	84.63%
2017 年第 2 季度	2,097,606,842.74	2,400,032,576.07	87.40%
2017 年第 3 季度	6,854,383,057.88	12,302,416,187.63	55.72%
2017 年第 4 季度	11,011,325,581.76	12,871,007,060.08	85.55%
平均股票仓位			78.33%

2. 净值波动率

经计算, 自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日, 共经历 4 个完整的季报期间(即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日), 东方红睿丰混合日收益率的标准差为 0.78%。

3. 最大回撤率

经计算, 自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日, 共经历 4 个完整的季报期间(即 2017 年 1 月 1 日~2017 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 6.56%。

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 7,411,577,559.16 元。

时间	期末基金资产净值
2017 年第 1 季度	2,072,854,412.85
2017 年第 2 季度	2,400,032,576.07
2017 年第 3 季度	12,302,416,187.63
2017 年第 4 季度	12,871,007,060.08
平均规模	7,411,577,559.16

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 3，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(LOF)

东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(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, 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

由下表可见, 东方红睿阳混合的股票平均仓位为 88.29%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2017 年第 1 季度	576,861,474.00	657,064,076.38	87.79%
2017 年第 2 季度	669,611,020.20	748,890,827.74	89.41%
2017 年第 3 季度	723,624,721.91	843,709,364.86	85.77%
2017 年第 4 季度	817,182,117.20	906,024,009.87	90.19%
平均股票仓位			88.29%

2. 净值波动率

经计算, 自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日, 共经历 4 个完整的季报期间(即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日), 东方红睿阳混合日收益率的标准差为 0.82%。

3. 最大回撤率

经计算, 自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日, 共经历 4 个完整的季报期间(即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日), 这 4 个季报期间内, 东方红睿阳混合的最大回撤为 8.60%。

4. 产品历史规模

由下表可见，东方红睿阳混合的产品历史规模为 788,922,069.71 元。

时间	期末基金资产净值
2017 年第 1 季度	657,064,076.38
2017 年第 2 季度	748,890,827.74
2017 年第 3 季度	843,709,364.86
2017 年第 4 季度	906,024,009.87
平均规模	788,922,069.71

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 3.5，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

由下表可见，东方红睿元混合的股票平均仓位为 87.54%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2017 年第 1 季度	1,002,925,173.67	1,163,917,780.45	86.17%
2017 年第 2 季度	1,176,934,098.97	1,333,744,739.09	88.24%
2017 年第 3 季度	1,249,611,579.59	1,426,543,868.73	87.60%
2017 年第 4 季度	1,430,561,536.28	1,623,006,997.47	88.14%
平均股票仓位			87.54%

2. 净值波动率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），东方红睿元混合日收益率的标准差为 0.87%。

3. 最大回撤率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），这 4 个季报期间内，东方红睿元混合的最大回撤为 8.68%。

4. 产品历史规模

由下表可见，东方红睿元混合的产品历史规模为 1,386,803,346.44 元。

时间	期末基金资产净值
2017 年第 1 季度	1,163,917,780.45
2017 年第 2 季度	1,333,744,739.09
2017 年第 3 季度	1,426,543,868.73
2017 年第 4 季度	1,623,006,997.47
平均规模	1,386,803,346.44

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 3.5，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

由下表可见，东方红中国优势混合的股票平均仓位为86.97%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2017年第1季度	3,384,947,079.11	3,985,015,066.10	84.94%
2017年第2季度	3,738,836,158.23	4,389,948,956.47	85.17%
2017年第3季度	4,287,547,734.06	4,846,629,727.09	88.46%
2017年第4季度	5,038,746,561.41	5,641,611,268.94	89.31%
平均股票仓位			86.97%

2. 净值波动率

经计算，自2017年第一季度起始日至2017年第四季报截止日，共经历4个完整的季报期间（即2017年1月1日~2017年12月31日），东方红中国优势混合日收益率的标准差为0.86%。

3. 最大回撤率

经计算，自2017年第一季度起始日至2017年第四季报截止日，共经历4个完整的季报期间（即2017年1月1日~2017年12月31日），这4个季报期间内，东方红中国优势混合的最大回撤为9.13%。

4. 产品历史规模

由下表可见，东方红中国优势混合的产品历史规模为4,715,801,254.65元。

时间	期末基金资产净值
2017年第1季度	3,985,015,066.10
2017年第2季度	4,389,948,956.47
2017年第3季度	4,846,629,727.09
2017年第4季度	5,641,611,268.94
平均规模	4,715,801,254.65

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 3.5，属于**中高风险**

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

由下表可见，东方红领先精选混合的股票平均仓位为 34.22%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2017 年第 1 季度	123,627,157.68	350,297,725.91	35.29%
2017 年第 2 季度	144,282,184.43	358,214,130.73	40.28%
2017 年第 3 季度	135,509,738.14	408,321,421.72	33.19%
2017 年第 4 季度	212,606,094.85	755,924,471.54	28.13%
平均股票仓位			34.22%

2. 净值波动率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），东方红领先精选混合日收益率的标准差为 0.31%。

3. 最大回撤率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），这 4 个季报期间内，东方红领先精选混合的最大回撤为 2.45%。

4. 产品历史规模

由下表可见，东方红领先精选混合的产品历史规模为 468,189,437.48 元。

时间	期末基金资产净值
2017年第1季度	350,297,725.91
2017年第2季度	358,214,130.73
2017年第3季度	408,321,421.72
2017年第4季度	755,924,471.54
平均规模	468,189,437.48

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 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

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

由下表可见，东方红稳健精选混合 A 的股票平均仓位为 24.64%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2017 年第 1 季度	131,900,907.05	592,990,105.66	22.24%
2017 年第 2 季度	172,986,572.06	614,189,090.68	28.17%
2017 年第 3 季度	137,835,013.68	633,193,085.17	21.77%
2017 年第 4 季度	167,717,318.55	635,765,911.02	26.38%
平均股票仓位			24.64%

注：股票仓位在此不区分基金份额类别。

2. 净值波动率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），东方红稳健精选混合 A 日收益率的标准差为 0.24%。

3. 最大回撤率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），这 4 个季报期间内，东方红稳健精选混合 A 的最大回撤为 1.98%。

4. 产品历史规模

由下表可见，东方红稳健精选混合 A 的产品历史规模为 615,449,453.49 元。

时间	期末基金资产净值
2017 年第 1 季度	589,350,948.79
2017 年第 2 季度	610,617,602.79
2017 年第 3 季度	629,496,368.19
2017 年第 4 季度	632,332,894.18
平均规模	615,449,453.49

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 2.5，属于**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

由下表可见，东方红稳健精选混合 C 的股票平均仓位为 24.64%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2017 年第 1 季度	131,900,907.05	592,990,105.66	22.24%
2017 年第 2 季度	172,986,572.06	614,189,090.68	28.17%
2017 年第 3 季度	137,835,013.68	633,193,085.17	21.77%
2017 年第 4 季度	167,717,318.55	635,765,911.02	26.38%
平均股票仓位			24.64%

注：股票仓位在此不区分基金份额类别。

2. 净值波动率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），东方红稳健精选混合 C 日收益率的标准差为 0.23%。

3. 最大回撤率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），这 4 个季报期间内，东方红稳健精选混合 C 的最大回撤为 1.94%。

4. 产品历史规模

由下表可见，东方红稳健精选混合 C 的产品历史规模为 3,585,094.65 元。

时间	期末基金资产净值
2017 年第 1 季度	3,639,156.87
2017 年第 2 季度	3,571,487.89
2017 年第 3 季度	3,696,716.98
2017 年第 4 季度	3,433,016.84
平均规模	3,585,094.65

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 3，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%，但在每个期间开放期的前 10 个工作日和后 10 个工作日、到期开放期的前 3 个月和后 3 个月以及开放期期间，基金投资不受前述比例限制；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 30.14%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2017 年第 1 季度	232,283,894.07	929,522,554.31	24.99%
2017 年第 2 季度	237,172,512.88	805,230,061.35	29.45%
2017 年第 3 季度	255,416,243.93	833,006,768.98	30.66%
2017 年第 4 季度	312,319,835.16	880,961,953.00	35.45%
平均股票仓位			30.14%

2. 净值波动率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），东方红睿逸混合日收益率的标准差为 0.38%。

3. 最大回撤率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），这 4 个季报期间内，东方红睿逸混合的最大回撤为 4.01%。

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 862,180,334.41 元。

时间	期末基金资产净值
2017 年第 1 季度	929,522,554.31
2017 年第 2 季度	805,230,061.35
2017 年第 3 季度	833,006,768.98
2017 年第 4 季度	880,961,953.00
平均规模	862,180,334.41

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 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。

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 13.45%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2017 年第 1 季度	121,964,682.66	969,389,597.21	12.58%
2017 年第 2 季度	122,632,104.45	886,500,301.66	13.83%
2017 年第 3 季度	123,677,522.83	905,704,745.73	13.66%
2017 年第 4 季度	122,537,565.55	892,094,622.97	13.74%
平均股票仓位			13.45%

注：股票仓位在此不区分基金份额类别。

2. 净值波动率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），东方红策略精选混合 A 日收益率的标准差为 0.12%。

3. 最大回撤率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），这 4 个季报期间内，东方红策略精选混合 A 的最大回撤为 1.25%。

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 911,692,393.81 元。

时间	期末基金资产净值
2017 年第 1 季度	969,179,801.79
2017 年第 2 季度	886,261,476.09
2017 年第 3 季度	905,266,000.64
2017 年第 4 季度	886,062,296.70
平均规模	911,692,393.81

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 0.5，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 13.45%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2017 年第 1 季度	121,964,682.66	969,389,597.21	12.58%
2017 年第 2 季度	122,632,104.45	886,500,301.66	13.83%
2017 年第 3 季度	123,677,522.83	905,704,745.73	13.66%
2017 年第 4 季度	122,537,565.55	892,094,622.97	13.74%
平均股票仓位			13.45%

注：股票仓位在此不区分基金份额类别。

2. 净值波动率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），东方红策略精选混合 C 日收益率的标准差为 0.12%。

3. 最大回撤率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），这 4 个季报期间内，东方红策略精选混合 C 的最大回撤为 1.24%。

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 1,729,923.09 元。

时间	期末基金资产净值
2017 年第 1 季度	209,795.42
2017 年第 2 季度	238,825.57
2017 年第 3 季度	438,745.09
2017 年第 4 季度	6,032,326.27
平均规模	1,729,923.09

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

由下表可见，东方红京东大数据混合的股票平均仓位为 72.47%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2017 年第 1 季度	1,701,054,720.20	2,882,193,400.29	59.02%
2017 年第 2 季度	2,256,566,945.60	3,055,583,783.25	73.85%
2017 年第 3 季度	2,351,883,995.61	3,117,337,162.42	75.45%
2017 年第 4 季度	2,639,539,779.89	3,236,310,232.81	81.56%
平均股票仓位			72.47%

2. 净值波动率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），东方红京东大数据混合日收益率的标准差为 0.56%。

3. 最大回撤率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），这 4 个季报期间内，东方红京东大数据混合的最大回撤为 7.44%。

4. 产品历史规模

由下表可见，东方红京东大数据混合的产品历史规模为 3,072,856,144.69 元。

时间	期末基金资产净值
2017年第1季度	2,882,193,400.29
2017年第2季度	3,055,583,783.25
2017年第3季度	3,117,337,162.42
2017年第4季度	3,236,310,232.81
平均规模	3,072,856,144.69

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3，属于**中高风险**

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 77.35%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2017 年第 1 季度	310,131,926.07	414,567,071.75	74.81%
2017 年第 2 季度	477,184,431.98	636,456,656.41	74.98%
2017 年第 3 季度	671,097,465.68	813,091,001.55	82.54%
2017 年第 4 季度	997,726,788.10	1,294,134,084.41	77.10%
平均股票仓位			77.35%

2. 净值波动率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），东方红优势精选混合日收益率的标准差为 0.73%。

3. 最大回撤率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），这 4 个季报期间内，东方红优势精选混合的最大回撤为 7.26%。

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 789,562,203.53 元。

时间	期末基金资产净值
2017年第1季度	414,567,071.75
2017年第2季度	636,456,656.41
2017年第3季度	813,091,001.55
2017年第4季度	1,294,134,084.41
平均规模	789,562,203.53

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。

1. 净值波动率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），东方红纯债债券日收益率的标准差为 0.07%。

2. 最大回撤率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），这 4 个季报期间内，东方红纯债债券的最大回撤为 0.50%。

3. 产品历史规模

由下表可见，东方红纯债债券的产品历史规模为 73,194,640.31 元。

时间	期末基金资产净值
2017 年第 1 季度	110,710,677.49
2017 年第 2 季度	60,540,054.07
2017 年第 3 季度	60,782,264.26
2017 年第 4 季度	60,745,565.42
平均规模	73,194,640.31

4. 违规次数

东方红纯债债券未出现过违规情况。

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》，纯债基金的指标评分标准如下表：

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	0(含)~1%	1%(含)~3%	3%(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，得到东方红纯债债券的总风险分值为 0.5，属于**中低风险**产品。

十四、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%；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

1. 股票平均仓位

由下表可见，东方红收益增强债券 A 的股票平均仓位为 19.13%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2017 年第 1 季度	203,598,847.38	1,039,078,731.31	19.59%
2017 年第 2 季度	182,987,519.30	948,247,928.17	19.30%
2017 年第 3 季度	236,194,934.02	1,298,803,910.91	18.19%
2017 年第 4 季度	237,233,936.64	1,218,912,296.90	19.46%
平均股票仓位			19.13%

注：股票仓位在此不区分基金份额类别。

2. 净值波动率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），东方红收益增强债券 A 日收益率的标准差为 0.25%。

3. 最大回撤率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），这 4 个季报期间内，东方红收益增强债券 A 的最大回撤为 2.77%。

4. 产品历史规模

由下表可见，东方红收益增强债券 A 的产品历史规模为 967,222,887.35 元。

时间	期末基金资产净值
2017 年第 1 季度	920,683,962.71
2017 年第 2 季度	845,678,965.63
2017 年第 3 季度	1,052,147,070.47
2017 年第 4 季度	1,050,381,550.57
平均规模	967,222,887.35

5. 违规次数

东方红收益增强债券 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》，除纯债基金外的债券型基金的指标评分标准如下表：

股票平均仓位	0	0~10%	10%(含)~15%	15%(含)以上	
风险分值	0	0.5	1	1.5	
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	0(含)~1%	1%(含)~3%	3%(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，得到东方红收益增强债券 A 的总风险分值为 3，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

1. 股票平均仓位

由下表可见，东方红收益增强债券 C 的股票平均仓位为 19.13%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2017 年第 1 季度	203,598,847.38	1,039,078,731.31	19.59%
2017 年第 2 季度	182,987,519.30	948,247,928.17	19.30%
2017 年第 3 季度	236,194,934.02	1,298,803,910.91	18.19%
2017 年第 4 季度	237,233,936.64	1,218,912,296.90	19.46%
平均股票仓位			19.13%

注：股票仓位在此不区分基金份额类别。

2. 净值波动率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），东方红收益增强债券 C 日收益率的标准差为 0.25%。

3. 最大回撤率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），这 4 个季报期间内，东方红收益增强债券 C 的最大回撤为 2.90%。

4. 产品历史规模

由下表可见，东方红收益增强债券 C 的产品历史规模为 159,037,829.48 元。

时间	期末基金资产净值
2017 年第 1 季度	118,394,768.60
2017 年第 2 季度	102,568,962.54
2017 年第 3 季度	246,656,840.44
2017 年第 4 季度	168,530,746.33
平均规模	159,037,829.48

5. 违规次数

东方红收益增强债券 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》，除纯债基金外的债券型基金的指标评分标准如下表：

股票平均仓位	0	0~10%	10%(含)~15%	15%(含)以上	
风险分值	0	0.5	1	1.5	
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	0(含)~1%	1%(含)~3%	3%(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，得到东方红收益增强债券 C 的总风险分值为 3，属于**中风险**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%，属于除纯债基金外的债券型基金。

（一）东方红信用债债券型证券投资基金 A

1. 股票平均仓位

由下表可见，东方红信用债债券 A 的股票平均仓位为 0.00%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2017 年第 1 季度	0.00	433,485,330.55	0.00%
2017 年第 2 季度	0.00	322,336,593.45	0.00%
2017 年第 3 季度	0.00	319,363,155.07	0.00%
2017 年第 4 季度	0.00	174,345,929.88	0.00%
平均股票仓位			0.00%

注：股票仓位在此不区分基金份额类别。

2. 净值波动率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），东方红信用债债券 A 日收益率的标准差为 0.07%。

3. 最大回撤率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），这 4 个季报期间内，东方红信用债债券 A 的最大回撤为 1.21%。

4. 产品历史规模

由下表可见，东方红信用债债券 A 的产品历史规模为 182,714,691.87 元。

时间	期末基金资产净值
2017 年第 1 季度	251,637,415.54
2017 年第 2 季度	174,671,322.45
2017 年第 3 季度	171,795,034.16
2017 年第 4 季度	132,754,995.34
平均规模	182,714,691.87

5. 违规次数

东方红信用债债券 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》，除纯债基金外的债券型基金的指标评分标准如下表：

股票平均仓位	0	0~10%	10%(含)~15%	15%(含)以上	
风险分值	0	0.5	1	1.5	
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	0(含)~1%	1%(含)~3%	3%(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，得到东方红信用债债券 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）东方红信用债债券型证券投资基金 C

1. 股票平均仓位

由下表可见，东方红信用债债券 C 的股票平均仓位为 0.00%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2017 年第 1 季度	0.00	433,485,330.55	0.00%
2017 年第 2 季度	0.00	322,336,593.45	0.00%
2017 年第 3 季度	0.00	319,363,155.07	0.00%
2017 年第 4 季度	0.00	174,345,929.88	0.00%
平均股票仓位			0.00%

注：股票仓位在此不区分基金份额类别。

2. 净值波动率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），东方红信用债债券 C 日收益率的标准差为 0.07%。

3. 最大回撤率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），这 4 个季报期间内，东方红信用债债券 C 的最大回撤为 1.32%。

4. 产品历史规模

由下表可见，东方红信用债债券 C 的产品历史规模为 129,668,060.37 元。

时间	期末基金资产净值
2017 年第 1 季度	181,847,915.01
2017 年第 2 季度	147,665,271.00
2017 年第 3 季度	147,568,120.91
2017 年第 4 季度	41,590,934.54
平均规模	129,668,060.37

5. 违规次数

东方红信用债债券 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》，除纯债基金外的债券型基金的指标评分标准如下表：

股票平均仓位	0	0~10%	10%(含)~15%	15%(含)以上	
风险分值	0	0.5	1	1.5	
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	0(含)~1%	1%(含)~3%	3%(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，得到东方红信用债债券 C 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。

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“东方红睿轩沪港深混合”）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：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%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-50%），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%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-100%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 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%，在封闭期内，本基金不受上述 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，东方红睿轩沪港深混合的股票平均仓位为 87.70%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2017 年第 1 季度	969,697,842.11	1,205,079,648.91	80.47%
2017 年第 2 季度	1,218,770,627.35	1,376,889,750.72	88.52%
2017 年第 3 季度	1,402,923,552.21	1,506,489,058.83	93.13%
2017 年第 4 季度	1,504,676,102.59	1,696,618,377.03	88.69%
平均股票仓位			87.70%

2. 净值波动率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），东方红睿轩沪港深混合日收益率的标准差为 0.82%。

3. 最大回撤率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），这 4 个季报期间内，东方红睿轩沪港

深混合的最大回撤为 9.39%。

4. 产品历史规模

由下表可见，东方红睿轩沪港深混合的产品历史规模为 1,446,269,208.87 元。

时间	期末基金资产净值
2017 年第 1 季度	1,205,079,648.91
2017 年第 2 季度	1,376,889,750.72
2017 年第 3 季度	1,506,489,058.83
2017 年第 4 季度	1,696,618,377.03
平均规模	1,446,269,208.87

5. 违规次数

东方红睿轩沪港深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，得到东方红睿轩沪港深混合的总风险分值为 3.5，属于**中高**风险产品。

十七、东方红稳添利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（以下简称“东方红稳添利纯债债券”）于 2016 年 5 月 13 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 80%；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。

1. 净值波动率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），东方红稳添利纯债债券日收益率的标准差为 0.06%。

2. 最大回撤率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），这 4 个季报期间内，东方红稳添利纯债债券的最大回撤为 1.01%。

3. 产品历史规模

由下表可见，东方红稳添利纯债债券的产品历史规模为 1,188,339,384.92 元。

时间	期末基金资产净值
2017 年第 1 季度	1,505,626,760.01
2017 年第 2 季度	1,517,874,245.89
2017 年第 3 季度	1,022,833,434.94
2017 年第 4 季度	707,023,098.82
平均规模	1,188,339,384.92

4. 违规次数

东方红稳添利纯债债券未出现过违规情况。

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》，纯债基金的指标评分

标准如下表：

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	0(含)~1%	1%(含)~3%	3%(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，得到东方红稳添利纯债债券的总风险分值为 0.5，属于**中低**

风险产品。

十八、东方红汇阳债券型证券投资基金

东方红汇阳债券型证券投资基金（以下简称“东方红汇阳债券”）于 2016 年 5 月 26 日成立。根据基金合同中各类资产的投资比例：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的市值不超过基金资产净值的 3%；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%，属于除纯债基金外的债券型基金。

（一）东方红汇阳债券型证券投资基金 A

1. 股票平均仓位

由下表可见，东方红汇阳债券 A 的股票平均仓位为 12.96%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2017 年第 1 季度	119,736,733.34	737,256,108.79	16.24%
2017 年第 2 季度	63,610,481.24	552,384,027.10	11.52%
2017 年第 3 季度	75,042,847.84	673,142,469.99	11.15%
2017 年第 4 季度	85,028,447.62	656,355,807.18	12.95%
平均股票仓位			12.96%

注：股票仓位在此不区分基金份额类别。

2. 净值波动率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），东方红汇阳债券 A 日收益率的标准差为 0.13%。

3. 最大回撤率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），这 4 个季报期间内，东方红汇阳债券 A 的最大回撤为 1.76%。

4. 产品历史规模

由下表可见，东方红汇阳债券 A 的产品历史规模为 479,710,161.69 元。

时间	期末基金资产净值
2017 年第 1 季度	624,702,522.90
2017 年第 2 季度	435,243,506.07
2017 年第 3 季度	426,422,215.32
2017 年第 4 季度	432,472,402.47
平均规模	479,710,161.69

5. 违规次数

东方红汇阳债券型 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》，除纯债基金外的债券型基金的指标评分标准如下表：

股票平均仓位	0	0~10%	10%(含)~15%	15%(含)以上	
风险分值	0	0.5	1	1.5	
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	0(含)~1%	1%(含)~3%	3%(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，得到东方红汇阳债券 A 的总风险分值为 2，属于**中风险**产品。

(二) 东方红汇阳债券型型证券投资基金 C

1. 股票平均仓位

由下表可见，东方红汇阳债券 C 的股票平均仓位为 12.96%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2017 年第 1 季度	119,736,733.34	737,256,108.79	16.24%
2017 年第 2 季度	63,610,481.24	552,384,027.10	11.52%
2017 年第 3 季度	75,042,847.84	673,142,469.99	11.15%
2017 年第 4 季度	85,028,447.62	656,355,807.18	12.95%
平均股票仓位			12.96%

注：股票仓位在此不区分基金份额类别。

2. 净值波动率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），东方红汇阳债券 C 日收益率的标准差为 0.13%。

3. 最大回撤率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），这 4 个季报期间内，东方红汇阳债券 C 的最大回撤为 1.82%。

4. 产品历史规模

由下表可见，东方红汇阳债券 C 的产品历史规模为 171,381,594.21 元。

时间	期末基金资产净值
2017 年第 1 季度	112,553,585.89
2017 年第 2 季度	117,140,521.03
2017 年第 3 季度	246,227,472.55
2017 年第 4 季度	209,604,797.35
平均规模	171,381,594.21

5. 违规次数

东方红汇阳债券 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》，除纯债基金外的债券型基金的指标评分标准如下表：

股票平均仓位	0	0~10%	10%(含)~15%	15%(含)以上	
风险分值	0	0.5	1	1.5	
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	0(含)~1%	1%(含)~3%	3%(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，得到东方红汇阳债券 C 的总风险分值为 2，属于**中风险**产品。

（三）东方红汇阳债券型证券投资基金 Z

1. 股票平均仓位

经计算，自成立日至 2017 年四季报截止日，共经历 1 个完整的季报期间（即 2017 年 10 月 1 日-2017 年 12 月 31 日），由下表可见，东方红汇阳债券 Z 的股票平均仓位为 12.95%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2017 年第 4 季度	85,028,447.62	656,355,807.18	12.95%

注：股票仓位在此不区分基金份额类别。

2. 净值波动率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 1 个完整的季报期间（即 2017 年 10 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），东方红汇阳债券 Z 日收益率的标准差为 0.17%。

3. 最大回撤率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 1 个完整的季

报期间（即 2017 年 10 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），这 1 个季报期间内，东方红汇阳债券 Z 的最大回撤为 1.76%。

4. 产品历史规模

由下表可见，东方红汇阳债券 Z 的产品历史规模为 14,278,607.36 元。

时间	期末基金资产净值
2017 年第 4 季度	14,278,607.36

5. 违规次数

东方红汇阳债券型 Z 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》，除纯债基金外的债券型基金的指标评分标准如下表：

股票平均仓位	0	0~10%	10%(含)~15%	15%(含)以上	
风险分值	0	0.5	1	1.5	
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	0(含)~1%	1%(含)~3%	3%(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，得到东方红汇阳债券 Z 的总风险分值为 2.5，属于**中风险**产品。

十九、东方红汇利债券型证券投资基金

东方红汇利债券型证券投资基金（以下简称“东方红汇利债券”）于 2016 年 6 月 13 日成立。根据基金合同中各类资产的投资比例：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的市值不超过基金资产净值的 3%；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%，属于除纯债基金外的债券型基金。

（一）东方红汇利债券型证券投资基金 A

1. 股票平均仓位

由下表可见，东方红汇利债券 A 的股票平均仓位为 12.65%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2017 年第 1 季度	175,642,044.52	1,130,213,949.73	15.54%
2017 年第 2 季度	109,649,963.63	995,616,936.40	11.01%
2017 年第 3 季度	56,571,500.00	519,157,598.56	10.90%
2017 年第 4 季度	58,966,500.00	448,542,261.76	13.15%
平均股票仓位			12.65%

注：股票仓位在此不区分基金份额类别。

2. 净值波动率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），东方红汇利债券 A 日收益率的标准差为 0.13%。

3. 最大回撤率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），这 4 个季报期间内，东方红汇利债券 A 的最大回撤为 1.78%。

4. 产品历史规模

由下表可见，东方红汇利债券 A 的产品历史规模为 560,945,124.40 元。

时间	期末基金资产净值
2017 年第 1 季度	821,386,875.77
2017 年第 2 季度	779,072,981.36
2017 年第 3 季度	366,485,858.69
2017 年第 4 季度	276,834,781.78
平均规模	560,945,124.40

5. 违规次数

东方红汇利债券型 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》，除纯债基金外的债券型基金的指标评分标准如下表：

股票平均仓位	0	0~10%	10%(含)~15%	15%(含)以上	
风险分值	0	0.5	1	1.5	
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	0(含)~1%	1%(含)~3%	3%(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，得到东方红汇利债券 A 的总风险分值为 2，属于**中风险**产品。

(二) 东方红汇利债券型证券投资基金 C

1. 股票平均仓位

由下表可见，东方红汇利债券 C 的股票平均仓位为 12.65%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2017 年第 1 季度	175,642,044.52	1,130,213,949.73	15.54%
2017 年第 2 季度	109,649,963.63	995,616,936.40	11.01%
2017 年第 3 季度	56,571,500.00	519,157,598.56	10.90%
2017 年第 4 季度	58,966,500.00	448,542,261.76	13.15%
平均股票仓位			12.65%

注：股票仓位在此不区分基金份额类别。

2. 净值波动率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），东方红汇利债券 C 日收益率的标准差为 0.13%。

3. 最大回撤率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），这 4 个季报期间内，东方红汇利债券 C 的最大回撤为 1.80%。

4. 产品历史规模

由下表可见，东方红汇利债券 C 的产品历史规模为 212,437,562.21 元。

时间	期末基金资产净值
2017 年第 1 季度	308,827,073.96
2017 年第 2 季度	216,543,955.04
2017 年第 3 季度	152,671,739.87
2017 年第 4 季度	171,707,479.98
平均规模	212,437,562.21

5. 违规次数

东方红汇利债券 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》，除纯债基金外的债券型基金的指标评分标准如下表：

股票平均仓位	0	0~10%	10%(含)~15%	15%(含)以上	
风险分值	0	0.5	1	1.5	
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	0(含)~1%	1%(含)~3%	3%(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，得到东方红汇利债券 C 的总风险分值为 2，属于**中风险**产品。

二十、东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金

东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“东方红睿满沪港深混合”）于2016年6月28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%(其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的0-50%)，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%(其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的0-100%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的0-100%)；权证投资比例为基金资产净值的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%，在封闭期内，本基金不受上述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，东方红睿满沪港深混合的股票平均仓位为91.03%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2017年第1季度	1,163,724,459.10	1,311,852,863.40	88.71%
2017年第2季度	1,301,402,583.84	1,433,509,853.15	90.78%
2017年第3季度	1,481,247,200.26	1,626,376,516.24	91.08%
2017年第4季度	1,704,625,263.88	1,821,882,655.00	93.56%
平均股票仓位			91.03%

2. 净值波动率

经计算，自2017年第一季度起始日至2017年第四季报截止日，共经历4个完整的季报期间（即2017年1月1日~2017年12月31日），东方红睿满沪港深混合日收益率的标准差为0.77%。

3. 最大回撤率

经计算，自2017年第一季度起始日至2017年第四季报截止日，共经历4个完整的季报期间（即2017年1月1日~2017年12月31日），这4个季报期间内，东方红睿满沪港

深混合的最大回撤为 8.05%。

4. 产品历史规模

由下表可见，东方红睿满沪港深混合的产品历史规模为 1,548,405,471.95 元。

时间	期末基金资产净值
2017 年第 1 季度	1,311,852,863.40
2017 年第 2 季度	1,433,509,853.15
2017 年第 3 季度	1,626,376,516.24
2017 年第 4 季度	1,821,882,655.00
平均规模	1,548,405,471.95

5. 违规次数

东方红睿满沪港深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，得到东方红睿满沪港深混合的总风险分值为 3.5，属于**中高**风险产品。

二十一、东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金

东方红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 7 月 11 日成立。根据基金合同中各类资产的投资比例：本基金将基金资产的 0%-95% 投资于股票资产（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%），权证投资比例不超过基金资产净值的 3%，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，现金或到期日在一年以内的政府债券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，东方红沪港深混合的股票平均仓位为 84.86%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2017 年第 1 季度	2,625,867,200.66	3,254,572,432.50	80.68%
2017 年第 2 季度	3,664,662,771.95	4,224,616,713.52	86.75%
2017 年第 3 季度	4,282,730,322.36	5,173,175,247.98	82.79%
2017 年第 4 季度	5,679,141,944.77	6,364,310,251.49	89.23%
平均股票仓位			84.86%

2. 净值波动率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），东方红沪港深混合日收益率的标准差为 0.79%。

3. 最大回撤率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），这 4 个季报期间内，东方红沪港深混合的最大回撤为 8.69%。

4. 产品历史规模

由下表可见，东方红沪港深混合的产品历史规模为 4,754,168,661.37 元。

时间	期末基金资产净值
2017年第1季度	3,254,572,432.50
2017年第2季度	4,224,616,713.52
2017年第3季度	5,173,175,247.98
2017年第4季度	6,364,310,251.49
平均规模	4,754,168,661.37

5. 违规次数

东方红沪港深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，得到东方红沪港深混合的总风险分值为 3.5，属于**中高风险**产品。

二十二、东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金

东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“东方红睿华沪港深混合”）于2016年8月4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%(其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的0-50%)，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%(其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的0-100%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的0-100%)；权证投资比例为基金资产净值的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%，在封闭期内，本基金不受上述5%的限制；封闭期内每个交易日日终在扣除股指期货、国债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

由下表可见，东方红睿华沪港深混合的股票平均仓位为84.58%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2017年第1季度	5,867,103,488.48	7,216,437,216.27	81.30%
2017年第2季度	7,081,497,570.81	8,467,802,671.34	83.63%
2017年第3季度	8,014,759,507.13	9,419,885,346.96	85.08%
2017年第4季度	9,548,634,086.67	10,813,122,101.16	88.31%
平均股票仓位			84.58%

2. 净值波动率

经计算，自2017年第一季度起始日至2017年第四季报截止日，共经历4个完整的季报期间（即2017年1月1日~2017年12月31日），东方红睿华沪港深混合日收益率的标准差为0.82%。

3. 最大回撤率

经计算，自2017年第一季度起始日至2017年第四季报截止日，共经历4个完整的季

报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），这 4 个季报期间内，东方红睿华沪港深混合的最大回撤为 9.04%。

4. 产品历史规模

由下表可见，东方红睿华沪港深混合的产品历史规模为 8,979,311,833.93 元。

时间	期末基金资产净值
2017 年第 1 季度	7,216,437,216.27
2017 年第 2 季度	8,467,802,671.34
2017 年第 3 季度	9,419,885,346.96
2017 年第 4 季度	10,813,122,101.16
平均规模	8,979,311,833.93

5. 违规次数

东方红睿华沪港深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，得到东方红睿华沪港深混合的总风险分值为 3.5，属于**中高**风险产品。

二十三、东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金

东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金（以下简称“东方红战略精选沪港深混合”）于 2016 年 8 月 30 日成立。根据基金合同中各类资产的投资比例：本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的 0%—30%(其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-30%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-30%)；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%，属于偏债混合型基金。

（一）东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金 A

1. 股票平均仓位

由下表可见，东方红战略精选沪港深混合 A 的股票平均仓位 28.73%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2017 年第 1 季度	413,653,055.63	1,400,856,247.47	29.53%
2017 年第 2 季度	326,164,732.37	1,132,653,272.63	28.80%
2017 年第 3 季度	289,365,129.40	1,034,899,584.22	27.96%
2017 年第 4 季度	323,835,391.95	1,131,128,447.38	28.63%
平均股票仓位			28.73%

注：股票仓位在此不区分基金份额类别。

2. 净值波动率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），东方红战略精选沪港深混合 A 日收益率的标准差为 0.24%。

3. 最大回撤率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），这 4 个季报期间内，东方红战略精选沪港深混合 A 的最大回撤为 3.50%。

4. 产品历史规模

由下表可见，东方红战略精选沪港深混合 A 的产品历史规模为 1,065,876,644.72 元。

时间	期末基金资产净值
2017 年第 1 季度	1,269,591,709.10
2017 年第 2 季度	1,023,752,534.73
2017 年第 3 季度	930,448,455.53
2017 年第 4 季度	1,039,713,879.52
平均规模	1,065,876,644.72

5. 违规次数

东方红战略精选沪港深混合 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，得到东方红战略精选沪港深混合 A 的总风险分值为 2.5，属于中风险产品。

(二) 东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金 C

1. 股票平均仓位

由下表可见，东方红战略精选沪港深混合 C 的股票平均仓位为 28.73%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2017 年第 1 季度	413,653,055.63	1,400,856,247.47	29.53%
2017 年第 2 季度	326,164,732.37	1,132,653,272.63	28.80%
2017 年第 3 季度	289,365,129.40	1,034,899,584.22	27.96%
2017 年第 4 季度	323,835,391.95	1,131,128,447.38	28.63%
平均股票仓位			28.73%

注：股票仓位在此不区分基金份额类别。

2. 净值波动率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），东方红战略精选沪港深混合 C 日收益率的标准差为 0.24%。

3. 最大回撤率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），这 4 个季报期间内，东方红战略精选沪港深混合 C 的最大回撤为 3.53%。

4. 产品历史规模

由下表可见，东方红战略精选沪港深混合 C 的产品历史规模为 109,007,743.21 元。

时间	期末基金资产净值
2017 年第 1 季度	131,264,538.37
2017 年第 2 季度	108,900,737.90
2017 年第 3 季度	104,451,128.69
2017 年第 4 季度	91,414,567.86
平均规模	109,007,743.21

5. 违规次数

东方红战略精选沪港深混合 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，得到东方红战略精选沪港深混合 C 的总风险分值为 2.5，属于

中风险产品。

二十四、东方红价值精选混合型证券投资基金

东方红价值精选混合型证券投资基金（以下简称“东方红价值精选混合”）于 2016 年 9 月 23 日成立。根据基金合同中各类资产的投资比例：本基金投资组合中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%，属于偏债混合型基金。

（一）东方红价值精选混合型证券投资基金 A

1. 股票平均仓位

由下表可见，东方红价值精选混合 A 的股票平均仓位为 26.05%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2017 年第 1 季度	317,631,938.91	1,286,209,948.76	24.70%
2017 年第 2 季度	311,403,100.02	1,173,228,691.68	26.54%
2017 年第 3 季度	264,944,315.84	1,138,702,143.42	23.27%
2017 年第 4 季度	281,144,825.91	947,124,684.12	29.68%
平均股票仓位			26.05%

注：股票仓位在此不区分基金份额类别。

2. 净值波动率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），东方红价值精选混合 A 日收益率的标准差为 0.22%。

3. 最大回撤率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），这 4 个季报期间内，东方红价值精选混合 A 的最大回撤为 2.28%。

4. 产品历史规模

由下表可见，东方红价值精选混合 A 的产品历史规模为 988,332,980.17 元。

时间	期末基金资产净值
2017 年第 1 季度	1,091,774,982.22
2017 年第 2 季度	1,011,442,598.16
2017 年第 3 季度	998,767,153.95
2017 年第 4 季度	851,347,186.35
平均规模	988,332,980.17

5. 违规次数

东方红价值精选混合 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，得到东方红价值精选混合 A 的总风险分值为 2.5，属于**中风险**产品。

(二) 东方红价值精选混合型证券投资基金 C

1. 股票平均仓位

由下表可见，东方红价值精选混合 C 的股票平均仓位为 26.05%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2017 年第 1 季度	317,631,938.91	1,286,209,948.76	24.70%
2017 年第 2 季度	311,403,100.02	1,173,228,691.68	26.54%
2017 年第 3 季度	264,944,315.84	1,138,702,143.42	23.27%
2017 年第 4 季度	281,144,825.91	947,124,684.12	29.68%
平均股票仓位			26.05%

注：股票仓位在此不区分基金份额类别。

2. 净值波动率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），东方红价值精选混合 C 日收益率的标准差为 0.22%。

3. 最大回撤率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），这 4 个季报期间内，东方红价值精选混合 C 的最大回撤为 2.32%。

4. 产品历史规模

由下表可见，东方红价值精选混合 C 的产品历史规模为 147,983,386.83 元。

时间	期末基金资产净值
2017 年第 1 季度	194,434,966.54
2017 年第 2 季度	161,786,093.52
2017 年第 3 季度	139,934,989.47
2017 年第 4 季度	95,777,497.77
平均规模	147,983,386.83

5. 违规次数

东方红价值精选混合 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，得到东方红价值精选混合 C 的总风险分值为 2.5，属于**中风险**产品。

二十五、东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金

东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“东方红优享红利沪港深混合”）于 2016 年 10 月 31 日成立。根据基金合同中各类资产的投资比例：本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的 0%—95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%）；本基金投资于红利型证券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，东方红优享红利沪港深混合的股票平均仓位为 78.53%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2017 年第 1 季度	1,142,053,470.69	1,817,132,791.27	62.85%
2017 年第 2 季度	2,220,647,070.58	2,851,701,519.77	77.87%
2017 年第 3 季度	2,989,388,348.45	3,547,245,958.25	84.27%
2017 年第 4 季度	4,064,834,598.45	4,560,125,563.06	89.14%
平均股票仓位			78.53%

2. 净值波动率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），东方红优享红利沪港深混合日收益率的标准差为 0.71%。

3. 最大回撤率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），这 4 个季报期间内，东方红优享红利沪港深混合的最大回撤为 8.20%。

4. 产品历史规模

由下表可见，东方红优享红利沪港深混合的产品历史规模为 3,194,051,458.09 元。

时间	期末基金资产净值
2017 年第 1 季度	1,817,132,791.27
2017 年第 2 季度	2,851,701,519.77
2017 年第 3 季度	3,547,245,958.25
2017 年第 4 季度	4,560,125,563.06
平均规模	3,194,051,458.09

5. 违规次数

东方红优享红利沪港深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，得到东方红优享红利沪港深混合的总风险分值为 3，属于中

高风险产品。

二十六、东方红益鑫纯债债券型证券投资基金

东方红益鑫纯债债券型证券投资基金（以下简称“东方红益鑫纯债债券”）于 2016 年 11 月 28 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 80%；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。

（一）东方红益鑫纯债债券型证券投资基金 A

1. 净值波动率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），东方红益鑫纯债债券 A 日收益率的标准差为 0.05%。

2. 最大回撤率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），这 4 个季报期间内，东方红益鑫纯债债券 A 的最大回撤为 0.61%。

3. 产品历史规模

由下表可见，东方红益鑫纯债债券 A 的产品历史规模为 390,089,435.01 元。

时间	期末基金资产净值
2017 年第 1 季度	475,110,713.26
2017 年第 2 季度	429,195,277.21
2017 年第 3 季度	384,599,786.60
2017 年第 4 季度	271,451,962.95
平均规模	390,089,435.01

4. 违规次数

东方红益鑫纯债债券 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》，纯债基金的指标评分标准如下表：

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	0(含)~1%	1%(含)~3%	3%(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，得到东方红益鑫纯债债券 A 的总风险分值为 0，属于**中低风险**产品。

（二）东方红益鑫纯债债券型证券投资基金 C

1. 净值波动率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），东方红益鑫纯债债券 C 日收益率的标准差为 0.05%。

2. 最大回撤率

经计算，自 2017 年第一季度起始日至 2017 年第四季报截止日，共经历 4 个完整的季报期间（即 2017 年 1 月 1 日~2017 年 12 月 31 日），这 4 个季报期间内，东方红益鑫纯债债券 C 的最大回撤为 0.65%。

3. 产品历史规模

由下表可见，东方红益鑫纯债债券 C 的产品历史规模为 74,409,343.03 元。

时间	期末基金资产净值
2017 年第 1 季度	108,451,564.74
2017 年第 2 季度	80,058,508.28
2017 年第 3 季度	81,078,637.39

2017年第4季度	28,048,661.69
平均规模	74,409,343.03

4. 违规次数

东方红益鑫纯债债券 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》，纯债基金的指标评分标准如下表：

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	0(含)~1%	1%(含)~3%	3%(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，得到东方红益鑫纯债债券 C 的总风险分值为 0.5，属于**中低风险**产品。

二十七、东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金

东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金（以下简称“东方红智逸沪港深混合”）于 2017 年 4 月 14 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%，但在每个期间开放期的前 10 个工作日和后 10 个工作日、到期开放期的前 3 个月和后 3 个月以及开放期期间，基金投资不受前述比例限制；本基金投资于股票的比例不高于基金资产的 50%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-50%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-50%）。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

经计算，自成立日至 2017 年四季报截止日，共经历 2 个完整的季报期间（即 2017 年 7 月 1 日-2017 年 12 月 31 日），由下表可见，东方红智逸沪港深混合的股票平均仓位为 35.57%。

时间	期末股票投资	期末基金资产净值	股票仓位
2017 年第 3 季度	538,120,330.12	1,631,806,471.06	32.98%
2017 年第 4 季度	651,978,977.20	1,708,195,630.37	38.17%
平均股票仓位			35.57%

2. 净值波动率

经计算，自成立日至 2017 年四季报截止日，共经历 2 个完整的季报期间（即 2017 年 7 月 1 日-2017 年 12 月 31 日），东方红智逸沪港深混合日收益率的标准差为 0.37%。

3. 最大回撤率

经计算，自成立日至 2017 年四季报截止日，共经历 2 个完整的季报期间（即 2017 年 7 月 1 日-2017 年 12 月 31 日），这 2 个季报期间内，东方红智逸沪港深混合的最大回撤为 3.41%。

4. 产品历史规模

经计算，自成立日至 2017 年四季报截止日，共经历 2 个完整的季报期间（即 2017 年 7 月 1 日-2017 年 12 月 31 日），由下表可见，东方红智逸沪港深混合的产品历史规模为 1,670,001,050.72 元。

时间	期末基金资产净值
2017 年第 3 季度	1,631,806,471.06
2017 年第 4 季度	1,708,195,630.37
平均规模	1,670,001,050.72

5. 违规次数

东方红智逸沪港深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，得到东方红智逸沪港深混合的总风险分值为 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。

二十八、东方红货币市场基金

东方红货币市场基金于 2017 年 8 月 25 日成立。根据基金合同中各类资产的投资比例：本基金主要投资于流动性高、信用风险低、价格波动小的短期金融工具，包括：现金；期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具，属于货币市场基金。

（一）东方红货币 A

1. 平均剩余期限

经计算，自成立日至 2017 年四季报截止日，共经历 1 个完整的季报期间（即 2017 年 10 月 1 日-2017 年 12 月 31 日），由下表可见，东方红货币 A 的平均剩余期限为 54 天。

时间	投资组合平均剩余期限（天）
2017 年第 4 季度	54

2. 产品历史规模

经计算，自成立日至 2017 年四季报截止日，共经历 1 个完整的季报期间（即 2017 年 10 月 1 日-2017 年 12 月 31 日），由下表可见，东方红货币 A 的产品历史规模为 18,942,137.48 元。

时间	期末基金资产净值
2017 年第 4 季度	18,942,137.48

3. 违规次数

东方红货币 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》，货币市场基金的指标评分标准如下表：

平均剩余期限（天）	0(含)~60	60(含)~90	
风险分值	0	1	
历史规模	1 亿元以上	1 亿元以下	

风险分值	0	1	
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，得到东方红货币 A 的总风险分值为 1，属于**低风险**产品。

（二）东方红货币 B

1. 平均剩余期限

经计算，自成立日至 2017 年四季报截止日，共经历 1 个完整的季报期间（即 2017 年 10 月 1 日-2017 年 12 月 31 日），由下表可见，东方红货币 B 的平均剩余期限为 54 天。

时间	投资组合平均剩余期限（天）
2017 年第 4 季度	54

2. 产品历史规模

经计算，自成立日至 2017 年四季报截止日，共经历 1 个完整的季报期间（即 2017 年 10 月 1 日-2017 年 12 月 31 日），由下表可见，东方红货币 B 的产品历史规模为 899,338,738.57 元。

时间	期末基金资产净值
2017 年第 4 季度	899,338,738.57

3. 违规次数

东方红货币 B 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》，货币市场基金的指标评分标准如下表：

平均剩余期限（天）	0(含)~60	60(含)~90	
风险分值	0	1	
历史规模	1 亿元以上	1 亿元以下	
风险分值	0	1	
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，得到东方红货币 B 的总风险分值为 0，属于**低风险**产品

(三) 东方红货币 E

1. 平均剩余期限

经计算，自成立日至 2017 年四季报截止日，共经历 1 个完整的季报期间（即 2017 年 10 月 1 日-2017 年 12 月 31 日），由下表可见，东方红货币 E 的平均剩余期限为 54 天。

时间	投资组合平均剩余期限（天）
2017 年第 4 季度	54

2. 产品历史规模

经计算，自成立日至 2017 年四季报截止日，共经历 1 个完整的季报期间（即 2017 年 10 月 1 日-2017 年 12 月 31 日），由下表可见，东方红货币 E 的产品历史规模为 25,601,178.49 元。

时间	期末基金资产净值
2017 年第 4 季度	25,601,178.49

3. 违规次数

东方红货币 E 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》，货币市场基金的指标评分标准如下表：

平均剩余期限（天）	0(含)~60	60(含)~90	
风险分值	0	1	
历史规模	1 亿元以上	1 亿元以下	
风险分值	0	1	
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，得到东方红货币 E 的总风险分值为 1，属于**低风险**产品。

二十九、东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金

东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金于 2017 年 11 月 15 日成立。根据基金合同中各类资产的投资比例：开放期内，股票资产投资比例为基金资产的 0%—95%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%），封闭期内，股票资产投资比例为基金资产的 0%—100%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%）。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%，在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，封闭期内每个交易日日终在扣除股指期货、国债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。

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》，东方红睿玺三年定期开放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。

三十、东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金

东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金于 2017 年 12 月 18 日成立。根据基金合同中各类资产的投资比例：本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的 0%—30%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%）；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%，在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，封闭期内每个交易日日终在扣除股指期货、国债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，属于偏债混合型基金。

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》，东方红目标优选三年定期开放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**中风险**产品。

上海东方证券资产管理有限公司

2018 年 5 月 18 日