

东方红纯债债券型发起式证券投资基金

[2015]第四季度报告

基金管理人:上海东方证券资产管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月20日

5.1 重要提示

上海东方证券资产管理有限公司董事会及监事会对本报告所载数据不存在虚假记载、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承诺本报告所载的财务数据、净值表现和投资组合报告等数据经其复核无误。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资人在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务数据未经审计。

基金合同生效日:2015年10月20日(基金合同生效日)起至2015年12月31日止。

2. 基本产品概况

基金简称	东方红纯债债券
基金主代码	001906
前场交易代码	001906
基金运作方式	契约型开放式,发起式
基金合同生效日	2015年10月20日
报告期末基金份额总额	512,066,741.88份
投资目标	本基金为纯债基金,主要通过分析影响债券市场的各类要素,对债券组合的久期、期限结构、类属品种进行有效配置,追求长周期内的投资回报。
投资策略	本基金将采取自上而下的方法,在充分分析本基金宏观经济形势、货币政策、利率走势、信用利差、信用风险、债券品种的流动性以及信用评级的基础上,综合考虑债券品种的收益性以及流动性特征,对不同行业、不同类型的债券品种进行配置,并根据市场变化适时调整配置比例。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:同期中国人民银行公布的-1年期定期存款利率(税后)+1.2%。
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于基金资产配置中的低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	上海东方证券资产管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

报告期(2015年10月20日-2015年12月31日)

1.本期实现收益 1,924,736.84

2.期初现金余额 4,279,006.27

3.期末现金及现金等价物余额 514,534,346.46

4.期末可供分配基金份额净值 1.006

5.期末可供分配利润 514,534,346.46

注:1)本基金于2015年10月20日生效,自合同生效日起至本报告期末不足一个季度。自基金合同生效日起至2015年10月20日-2015年12月31日。

2)本基金于2015年10月20日生效,自合同生效日起至本报告期末不足一个季度。

3)本基金建仓期个月,即从2015年10月20日起至2015年12月31日,至本报告期末,本基金尚未建仓。

4)管理人报告

3.2 本期基金净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金净值于2015年10月20日生效,其净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

报告期(2015年10月20日-2015年12月31日)

1.本期实现收益 1,924,736.84

2.期初现金余额 4,279,006.27

3.期末现金及现金等价物余额 514,534,346.46

4.期末可供分配基金份额净值 1.006

5.期末可供分配利润 514,534,346.46

注:1)本基金于2015年10月20日生效,自合同生效日起至本报告期末不足一个季度。自基金合同生效日起至2015年10月20日-2015年12月31日。

2)本基金于2015年10月20日生效,自合同生效日起至本报告期末不足一个季度。

3)本基金建仓期个月,即从2015年10月20日起至2015年12月31日,至本报告期末,本基金尚未建仓。

4)管理人报告

3.4 管理人报告

3.5 基金净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金净值于2015年10月20日生效,其净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.6 基金资产净值

3.7 基金资产净值

3.8 基金资产净值

3.9 基金资产净值

3.10 基金资产净值

3.11 基金资产净值

3.12 基金资产净值

3.13 基金资产净值

3.14 基金资产净值

3.15 基金资产净值

3.16 基金资产净值

3.17 基金资产净值

3.18 基金资产净值

3.19 基金资产净值

3.20 基金资产净值

3.21 基金资产净值

3.22 基金资产净值

3.23 基金资产净值

3.24 基金资产净值

3.25 基金资产净值

3.26 基金资产净值

3.27 基金资产净值

3.28 基金资产净值

3.29 基金资产净值

3.30 基金资产净值

3.31 基金资产净值

3.32 基金资产净值

3.33 基金资产净值

3.34 基金资产净值

3.35 基金资产净值

3.36 基金资产净值

3.37 基金资产净值

3.38 基金资产净值

3.39 基金资产净值

3.40 基金资产净值

3.41 基金资产净值

3.42 基金资产净值

3.43 基金资产净值

3.44 基金资产净值

3.45 基金资产净值

3.46 基金资产净值

3.47 基金资产净值

3.48 基金资产净值

3.49 基金资产净值

3.50 基金资产净值

3.51 基金资产净值

3.52 基金资产净值

3.53 基金资产净值

3.54 基金资产净值

3.55 基金资产净值

3.56 基金资产净值

3.57 基金资产净值

3.58 基金资产净值

3.59 基金资产净值

3.60 基金资产净值

3.61 基金资产净值

3.62 基金资产净值

3.63 基金资产净值

3.64 基金资产净值

3.65 基金资产净值

3.66 基金资产净值

3.67 基金资产净值

3.68 基金资产净值

3.69 基金资产净值

3.70 基金资产净值

3.71 基金资产净值

3.72 基金资产净值

3.73 基金资产净值

3.74 基金资产净值

3.75 基金资产净值

3.76 基金资产净值

3.77 基金资产净值

3.78 基金资产净值

3.79 基金资产净值

3.80 基金资产净值

3.81 基金资产净值

3.82 基金资产净值

3.83 基金资产净值

3.84 基金资产净值

3.85 基金资产净值

3.86 基金资产净值

3.87 基金资产净值

3.88 基金资产净值

3.89 基金资产净值

3.90 基金资产净值

3.91 基金资产净值

3.92 基金资产净值

3.93 基金资产净值

3.94 基金资产净值

3.95 基金资产净值

3.96 基金资产净值

3.97 基金资产净值

3.98 基金资产净值

3.99 基金资产净值

3.10 基金资产净值

3.11 基金资产净值

3.12 基金资产净值

3.13 基金资产净值

3.14 基金资产净值

3.15 基金资产净值

3.16 基金资产净值

3.17 基金资产净值

3.18 基金资产净值

3.19 基金资产净值

3.20 基金资产净值

3.21 基金资产净值

3.22 基金资产净值

3.23 基金资产净值

3.24 基金资产净值

3.25 基金资产净值

3.26 基金资产净值