

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

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
送出日期:2017年3月30日

1.1 重要提示
上海东方证券资产管理有限公司(以下简称“基金管理人”)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。本年度报告由董事组长签发。

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2017年3月21日复核了本报告中财务数据、净值数据、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。

上海东方证券资产管理有限公司承诺以诚实信用、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,也不保证基金本金不受损失。

基金的投资业绩并不代表其未来表现。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。

本年度报告自2016年10月01日起至2017年3月31日止,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

2.1 基金基本情况

基金名称	东方红睿元混合
基金代码	000970
基金运作方式	契约型,本基金以定期开放方式运作,即采取封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间开放的方式
基金合同生效日期	2016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	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	672,005,921.82份
基金合同的存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标
本基金以追求绝对收益为目标,在有效控制投资组合风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

投资策略
本基金在中国经济持续增长的大背景下,寻找符合经济结构调整方向,产业升级由传统制造业、人口老龄化等带来的投资机会,挖掘具有成长性的个股,并从中选取具有核心竞争优势的个股,分享中国经济增长带来的收益。在控制风险的前提下,本基金资产的中长期增值。

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为三年期银行定期存款(税后)。每个封闭期最后一个开放日的二年期定期存款利率(税后)。

风险收益特征
本基金属于一只中风险基金,属于股票型基金,预期风险收益高于货币型基金,预期风险收益高于债券型基金,预期风险收益高于货币型基金,预期风险收益高于货币型基金。

2.3 基金管理人及基金托管人

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	招商银行股份有限公司
姓名	杨小松	李建
联系电话	021-63228888	0755-83190064
电子邮箱	service@sh东方.com	yan_chang@china.com
客户服务电话	4000200008	95555
传真	021-63228001	0755-83190201

2.4 信息披露方式

基金年度报告报告正文的置备及互联网披露
基金年度报告报告正文的置备及互联网披露

基金年度报告报告正文的置备及互联网披露
基金年度报告报告正文的置备及互联网披露

3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要财务指标和基金净值表现

项目	2016年	2015年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2016年12月31日
本期实现收益	50,400,433.04	223,214,137.10	
本期利润	46,356,501.99	211,526,430.27	
加权平均基金份额本期利润	0.0690	0.4636	
本基金份额净值增长率	4.71%	46.40%	
1.2 期末基金份额净值	2016年末	2015年末	
期末可供分配基金份额利润	0.4072	0.3222	
期末基金资产净值	1,029,889,854.08	983,532,352.09	

注:1.中间的“期末”与报告期前最后一日,即12月31日;“本期”指2016年1月1日至2016年12月31日。

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、基金赎回费),计入费用后持有人的实际收益将低于上述指标。

3.本基金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

基金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	业绩比较基准收益率	1-3	2-4
过去三个月	3.02%	0.61%	0.60%	0.00%
过去六个月	11.07%	0.69%	1.36%	0.00%
过去一年	4.71%	1.22%	2.67%	0.01%
过去三年	53.30%	16.6%	5.90%	0.01%

注:1.本基金合同生效日起至2016年11月21日,2016年12月31日。

2.本基金合同中的有关规定,本基金的投资业绩比较基准为:三年期银行定期存款利率(税后)。其中,三年期银行定期存款利率是指中国人民银行公布并执行的金融机构三年期人民币存款基准利率。本基金以定期开放方式运作,每个封闭期最后一个开放日的二年期定期存款利率(税后)。

3.2.2 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

基金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	业绩比较基准收益率	1-3	2-4
过去三个月	3.02%	0.61%	0.60%	0.00%
过去六个月	11.07%	0.69%	1.36%	0.00%
过去一年	4.71%	1.22%	2.67%	0.01%
过去三年	53.30%	16.6%	5.90%	0.01%

注:1.截止日期为2016年12月31日。

2.本基金建仓期6个月,即从2015年1月21日至2015年7月20日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

基金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	业绩比较基准收益率	1-3	2-4
过去三个月	3.02%	0.61%	0.60%	0.00%
过去六个月	11.07%	0.69%	1.36%	0.00%
过去一年	4.71%	1.22%	2.67%	0.01%
过去三年	53.30%	16.6%	5.90%	0.01%

注:1.截止日期为2016年12月31日。

2.本基金建仓期6个月,即从2015年1月21日至2015年7月20日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

基金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	业绩比较基准收益率	1-3	2-4
过去三个月	3.02%	0.61%	0.60%	0.00%
过去六个月	11.07%	0.69%	1.36%	0.00%
过去一年	4.71%	1.22%	2.67%	0.01%
过去三年	53.30%	16.6%	5.90%	0.01%

注:1.截止日期为2016年12月31日。

2.本基金建仓期6个月,即从2015年1月21日至2015年7月20日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

基金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	业绩比较基准收益率	1-3	2-4
过去三个月	3.02%	0.61%	0.60%	0.00%
过去六个月	11.07%	0.69%	1.36%	0.00%
过去一年	4.71%	1.22%	2.67%	0.01%
过去三年	53.30%	16.6%	5.90%	0.01%

注:1.截止日期为2016年12月31日。

2.本基金建仓期6个月,即从2015年1月21日至2015年7月20日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

基金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	业绩比较基准收益率	1-3	2-4
过去三个月	3.02%	0.61%	0.60%	0.00%
过去六个月	11.07%	0.69%	1.36%	0.00%
过去一年	4.71%	1.22%	2.67%	0.01%
过去三年	53.30%	16.6%	5.90%	0.01%

注:1.截止日期为2016年12月31日。

2.本基金建仓期6个月,即从2015年1月21日至2015年7月20日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

基金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	业绩比较基准收益率	1-3	2-4
过去三个月	3.02%	0.61%	0.60%	0.00%
过去六个月	11.07%	0.69%	1.36%	0.00%
过去一年	4.71%	1.22%	2.67%	0.01%
过去三年	53.30%	16.6%	5.90%	0.01%

注:1.截止日期为2016年12月31日。

2.本基金建仓期6个月,即从2015年1月21日至2015年7月20日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

基金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	业绩比较基准收益率	1-3	2-4
过去三个月	3.02%	0.61%	0.60%	0.00%
过去六个月	11.07%	0.69%	1.36%	0.00%
过去一年	4.71%	1.22%	2.67%	0.01%
过去三年	53.30%	16.6%	5.90%	0.01%

注:1.截止日期为2016年12月31日。

2.本基金建仓期6个月,即从2015年1月21日至2015年7月20日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

基金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	业绩比较基准收益率	1-3	2-4
过去三个月	3.02%	0.61%	0.60%	0.00%
过去六个月	11.07%	0.69%	1.36%	0.00%
过去一年	4.71%	1.22%	2.67%	0.01%
过去三年	53.30%	16.6%	5.90%	0.01%

注:1.截止日期为2016年12月31日。

2.本基金建仓期6个月,即从2015年1月21日至2015年7月20日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

基金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	业绩比较基准收益率	1-3	2-4
过去三个月	3.02%	0.61%	0.60%	0.00%
过去六个月	11.07%	0.69%	1.36%	0.00%
过去一年	4.71%	1.22%	2.67%	0.01%
过去三年	53.30%	16.6%	5.90%	0.01%

注:1.截止日期为2016年12月31日。

2.本基金建仓期6个月,即从2015年1月21日至2015年7月20日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

基金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	业绩比较基准收益率	1-3	2-4
过去三个月	3.02%	0.61%	0.60%	0.00%
过去六个月	11.07%	0.69%	1.36%	0.00%
过去一年	4.71%	1.22%	2.67%	0.01%
过去三年	53.30%	16.6%	5.90%	0.01%

注:1.截止日期为2016年12月31日。

2.本基金建仓期6个月,即从2015年1月21日至2015年7月20日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

基金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	业绩比较基准收益率	1-3	2-4
过去三个月	3.02%	0.61%	0.60%	0.00%
过去六个月	11.07%	0.69%	1.36%	0.00%
过去一年	4.71%	1.22%	2.67%	0.01%
过去三年	53.30%	16.6%	5.90%	0.01%

注:1.截止日期为2016年12月31日。

2.本基金建仓期6个月,即从2015年1月21日至2015年7月20日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

基金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	业绩比较基准收益率	1-3	2-4
过去三个月	3.02%	0.61%	0.60%	0.00%
过去六个月	11.07%	0.69%	1.36%	0.00%
过去一年	4.71%	1.22%	2.67%	0.01%
过去三年	53.30%	16.6%	5.90%	0.01%

注:1.截止日期为2016年12月31日。

2.本基金建仓期6个月,即从2015年1月21日至2015年7月20日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

基金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	业绩比较基准收益率	1-3	2-4
过去三个月	3.02%	0.61%	0.60%	0.00%
过去六个月	11.07%	0.69%	1.36%	0.00%
过去一年	4.71%	1.22%	2.67%	0.01%
过去三年	53.30%	16.6%	5.90%	0.01%

注:1.截止日期为2016年12月31日。

2.本基金建仓期6个月,即从2015年1月21日至2015年7月20日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

基金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	业绩比较基准收益率	1-3	2-4
过去三个月	3.02%	0.61%	0.60%	0.00%
过去六个月	11.07%	0.69%	1.36%	0.00%
过去一年	4.71%	1.22%	2.67%	0.01%
过去三年	53.30%	16.6%	5.90%	0.01%

注:1.截止日期为2016年12月31日。

2.本基金建仓期6个月,即从2015年1月21日至2015年7月20日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

基金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	业绩比较基准收益率	1-3	2-4
过去三个月	3.02%	0.61%	0.60%	0.00%
过去六个月	11.07%	0.69%	1.36%	0.00%
过去一年	4.71%	1.22%	2.67%	0.01%
过去三年	53.30%	16.6%	5.90%	0.01%

注:1.截止日期为2016年12月31日。

2.本基金建仓期6个月,即从2015年1月21日至2015年7月20日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

基金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	业绩比较基准收益率	1-3	2-4
过去三个月	3.02%	0.61%	0.60%	0.00%
过去六个月	11.07%	0.69%	1.36%	0.00%
过去一年	4.71%	1.22%	2.67%	0.01%
过去三年	53.30%	16.6%	5.90%	0.01%

注:1.截止日期为2016年12月31日。

2.本基金建仓期6个月,即从2015年1月21日至2015年7月20日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

基金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	业绩比较基准收益率	1-3	2-4
过去三个月	3.02%	0.61%	0.60%	0.00%
过去六个月	11.07%	0.69%	1.36%	0.00%
过去一年	4.71%	1.22%	2.67%	0.01%
过去三年	53.30%	16.6%	5.90%	0.01%

注:1.截止日期为2016年12月31日。

2.本基金建仓期6个月,即从2015年1月21日至2015年7月20日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

基金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	业绩比较基准收益率	1-3	2-4
过去三个月	3.02%	0.61%	0.60%	0.00%
过去六个月	11.07%	0.69%	1.36%	0.00%
过去一年	4.71%	1.22%	2.67%	0.01%
过去三年	53.30%	16.6%	5.90%	0.01%

注:1.截止日期为2016年12月31日。

2.本基金建仓期6个月,即从2015年1月21日至2015年7月20日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 基金净值增长率及其与