

东方红优势精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

2016年年度报告摘要

基金管理人：上海东方证券资产管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2017年3月30日

§1 重要提示

上海东方证券资产管理有限公司的董事会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的法律责任。本年度报告由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年3月27日复核了本报告中的财务资料、净值表现、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者有风险，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及其更新。

本报告自2016年1月1日起至2016年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称 东方红优势精选混合

基金代码 000712

前次申购日期 000712

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2016年9月8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 中国银行股份有限公司

报告期末基金份额总额 267,007,176.15

基金合同的存续期 不定期

2.2 基金产品说明

投资目标 本基金在严格控制风险的前提下，追求长期稳健增值，实现基金资产的长期增值。

投资策略 本基金遵循“自上而下”的资产配置策略，在充分把握宏观经济、政策、市场、行业、个股、债券、商品、衍生品、期货、期权、权证、结构化产品等投资机会的基础上，确定本基金管理人采用的投资策略。本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历，具有基金从业人员资格，同时，公司设有估值委员会，成员包括公司总经理、合规总监、首席风控官、首席运营官、基金会计等。基金经理不参与基金日常估值业务，对于属于东证资管估值政策范围内的特殊估值更可参与讨论，但必须快速由估值委员会讨论决定并报批。

业绩比较基准 本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及复核计算的职责。基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

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 中国银行股份有限公司

姓名 董建刚 王永民

联系电话 021-63292888 010-66060060

电子邮箱 021-63292888 010-66060060

注册地址 上海市浦东新区世纪大道1601号36楼 北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址 上海市浦东新区世纪大道1601号36楼 北京市西城区复兴门内大街2号

2.4 信息披露方式

信息披露网站 基金管理人网站 基金托管人网站

基金年度报告备置地点 基金管理人及基金托管人住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要财务数据和财务指标

基金单位：人民币元

3.1.1 期间回报率

2016年 2015年9月8日至2016年12月31日

本期已实现收益 -11,000,347.86 11,289,362.01

本期利润 -31,899,494.34 27,069,261.28

加权平均基金份额本期利润 -0.0712 0.0601

本期基金份额净值增长率 -0.54% 0.60%

3.1.2 期末基金份额净值 2016年末 2015年末

1.12 期末基金份额净值 1.0109 0.9994

期末基金份额净值增长率 363,076,517.84 624,438,793.34

期末基金份额净值 0.088 1.088

注：1.表中的“期末”均指报告期最后一日，且以2017年1月1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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.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。本期利润指基金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 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 份额净值增长率 业绩比较基准收益率 份额净值增长率与业绩比较基准收益率差额

过去三个月 0.41% 0.75% -0.32% 0.02% 0.02% 0.02%

过去六个月 0.48% 0.74% -0.23% 0.05% 2.36% 0.19%

过去一年 -0.54% 1.23% -0.42% 1.07% 3.89% 0.28%

自基金合同生效至今 -1.20% 1.21% 3.43% -1.03% 0.07%

注：1.自基金合同生效日起至2016年9月8日—2016年12月31日。

2.根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：中债3000指数收益率*70%+中国债总收益率*30%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，日收益率（按下列公式计算）：

$\text{日收益率} = \frac{\text{基金净值增长率} - \text{业绩比较基准收益率}}{\text{基金净值增长率}} \times 100\%$

注：1.自基金合同生效日起至2016年9月8日—2016年12月31日。

2.根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：中债3000指数收益率*70%+中国债总收益率*30%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，日收益率（按下列公式计算）：

$\text{日收益率} = \frac{\text{基金净值增长率} - \text{业绩比较基准收益率}}{\text{基金净值增长率}} \times 100\%$

注：1.自基金合同生效日起至2016年9月8日—2016年12月31日。

2.根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：中债3000指数收益率*70%+中国债总收益率*30%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，日收益率（按下列公式计算）：

$\text{日收益率} = \frac{\text{基金净值增长率} - \text{业绩比较基准收益率}}{\text{基金净值增长率}} \times 100\%$

注：1.自基金合同生效日起至2016年9月8日—2016年12月31日。

2.根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：中债3000指数收益率*70%+中国债总收益率*30%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，日收益率（按下列公式计算）：

$\text{日收益率} = \frac{\text{基金净值增长率} - \text{业绩比较基准收益率}}{\text{基金净值增长率}} \times 100\%$

注：1.自基金合同生效日起至2016年9月8日—2016年12月31日。

2.根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：中债3000指数收益率*70%+中国债总收益率*30%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，日收益率（按下列公式计算）：

$\text{日收益率} = \frac{\text{基金净值增长率} - \text{业绩比较基准收益率}}{\text{基金净值增长率}} \times 100\%$

注：1.自基金合同生效日起至2016年9月8日—2016年12月31日。

2.根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：中债3000指数收益率*70%+中国债总收益率*30%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，日收益率（按下列公式计算）：

$\text{日收益率} = \frac{\text{基金净值增长率} - \text{业绩比较基准收益率}}{\text{基金净值增长率}} \times 100\%$

注：1.自基金合同生效日起至2016年9月8日—2016年12月31日。

2.根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：中债3000指数收益率*70%+中国债总收益率*30%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，日收益率（按下列公式计算）：

$\text{日收益率} = \frac{\text{基金净值增长率} - \text{业绩比较基准收益率}}{\text{基金净值增长率}} \times 100\%$

注：1.自基金合同生效日起至2016年9月8日—2016年12月31日。

2.根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：中债3000指数收益率*70%+中国债总收益率*30%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，日收益率（按下列公式计算）：

$\text{日收益率} = \frac{\text{基金净值增长率} - \text{业绩比较基准收益率}}{\text{基金净值增长率}} \times 100\%$

注：1.自基金合同生效日起至2016年9月8日—2016年12月31日。

2.根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：中债3000指数收益率*70%+中国债总收益率*30%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，日收益率（按下列公式计算）：

$\text{日收益率} = \frac{\text{基金净值增长率} - \text{业绩比较基准收益率}}{\text{基金净值增长率}} \times 100\%$

注：1.自基金合同生效日起至2016年9月8日—2016年12月31日。

2.根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：中债3000指数收益率*70%+中国债总收益率*30%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，日收益率（按下列公式计算）：

$\text{日收益率} = \frac{\text{基金净值增长率} - \text{业绩比较基准收益率}}{\text{基金净值增长率}} \times 100\%$

注：1.自基金合同生效日起至2016年9月8日—2016年12月31日。

2.根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：中债3000指数收益率*70%+中国债总收益率*30%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，日收益率（按下列公式计算）：

$\text{日收益率} = \frac{\text{基金净值增长率} - \text{业绩比较基准收益率}}{\text{基金净值增长率}} \times 100\%$

注：1.自基金合同生效日起至2016年9月8日—2016年12月31日。

2.根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：中债3000指数收益率*70%+中国债总收益率*30%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，日收益率（按下列公式计算）：

$\text{日收益率} = \frac{\text{基金净值增长率} - \text{业绩比较基准收益率}}{\text{基金净值增长率}} \times 100\%$

注：1.自基金合同生效日起至2016年9月8日—2016年12月31日。

2.根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：中债3000指数收益率*70%+中国债总收益率*30%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，日收益率（按下列公式计算）：

$\text{日收益率} = \frac{\text{基金净值增长率} - \text{业绩比较基准收益率}}{\text{基金净值增长率}} \times 100\%$

注：1.自基金合同生效日起至2016年9月8日—2016年12月31日。

2.根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：中债3000指数收益率*70%+中国债总收益率*30%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，日收益率（按下列公式计算）：

$\text{日收益率} = \frac{\text{基金净值增长率} - \text{业绩比较基准收益率}}{\text{基金净值增长率}} \times 100\%$

注：1.自基金合同生效日起至2016年9月8日—2016年12月31日。

2.根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：中债3000指数收益率*70%+中国债总收益率*30%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，日收益率（按下列公式计算）：

$\text{日收益率} = \frac{\text{基金净值增长率} - \text{业绩比较基准收益率}}{\text{基金净值增长率}} \times 100\%$

注：1.自基金合同生效日起至2016年9月8日—2016年12月31日。

2.根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：中债3000指数收益率*70%+中国债总收益率*30%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，日收益率（按下列公式计算）：

$\text{日收益率} = \frac{\text{基金净值增长率} - \text{业绩比较基准收益率}}{\text{基金净值增长率}} \times 100\%$

注：1.自基金合同生效日起至2016年9月8日—2016年12月31日。

2.根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：中债3000指数收益率*70%+中国债总收益率*30%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，日收益率（按下列公式计算）：

$\text{日收益率} = \frac{\text{基金净值增长率} - \text{业绩比较基准收益率}}{\text{基金净值增长率}} \times 100\%$

注：1.自基金合同生效日起至2016年9月8日—2016年12月31日。

2.根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：中债3000指数收益率*70%+中国债总收益率*30%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，日收益率（按下列公式计算）：

$\text{日收益率} = \frac{\text{基金净值增长率} - \text{业绩比较基准收益率}}{\text{基金净值增长率}} \times 100\%$

注：1.自基金合同生效日起至2016年9月8日—2016年12月31日。

2.根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：中债3000指数收益率*70%+中国债总收益率*30%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，日收益率（按下列公式计算）：

$\text{日收益率} = \frac{\text{基金净值增长率} - \text{业绩比较基准收益率}}{\text{基金净值增长率}} \times 100\%$

注：1.自基金合同生效日起至2016年9月8日—2016年12月31日。

2.根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：中债3000指数收益率*70%+中国债总收益率*30%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，日收益率（按下列公式计算）：

$\text{日收益率} = \frac{\text{基金净值增长率} - \text{业绩比较基准收益率}}{\text{基金净值增长率}} \times 100\%$

注：1.自基金合同生效日起至2016年9月8日—2016年12月31日。

2.根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：中债3000指数收益率*70%+中国债总收益率*30%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，日收益率（按下列公式计算）：

$\text{日收益率} = \frac{\text{基金净值增长率} - \text{业绩比较基准收益率}}{\text{基金净值增长率}} \times 100\%$

注：1.自基金合同生效日起至2016年9月8日—2016年12月31日。

2.根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：中债3000指数收益率*70%+中国债总收益率*30%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，日收益率（按下列公式计算）：

$\text{日收益率} = \frac{\text{基金净值增长率} - \text{业绩比较基准收益率}}{\text{基金净值增长率}} \times 100\%$

注：1.自基金合同生效日起至2016年9月8日—2016年12月31日。

2.根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：中债3000指数收益率*70%+中国债总收益率*30%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，日收益率（按下列公式计算）：

$\text{日收益率} = \frac{\text{基金净值增长率} - \text{业绩比较基准收益率}}{\text{基金净值增长率}} \times 100\%$

注：1.自基金合同生效日起至2016年9月8日—2016年12月31日。

2.根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：中债3000指数收益率*70%+中国债总收益率*30%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，日收益率（按下列公式计算）：

$\text{日收益率} = \frac{\text{基金净值增长率} - \text{业绩比较基准收益率}}{\text{基金净值增长率}} \times 100\%$

注：1.自基金合同生效日起至2016年9月8日—2016年12月31日。

2.根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：中债3000指数收益率*70%+中国债总收益率*30%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，日收益率（按下列公式计算）：

$\text{日收益率} = \frac{\text{基金净值增长率} - \text{业绩比较基准收益率}}{\text{基金净值增长率}} \times 100\%$

注：1.自基金合同生效日起至2016年9月8日—2016年12月31日。

2.根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：中债3000指数收益率*70%+中国债总收益率*30%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，日收益率（按下列公式计算）：

$\text{日收益率} = \frac{\text{基金净值增长率} - \text{业绩比较基准收益率}}{\text{基金净值增长率}} \times 100\%$

注：1.自基金合同生效日起至2016年9月8日—2016年12月31日。

2.根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：中债3000指数收益率*70%+中国债总收益率*30%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，日收益率（按下列公式计算）：

$\text{日收益率} = \frac{\text{基金净值增长率} - \text{业绩比较基准收益率}}{\text{基金净值增长率}} \times 100\%$

注：1.自基金合同生效日起至2016年9月8日—2016年12月31日。

2.根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：中债3000指数收益率*70%+中国债总收益率*30%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，日收益率（按下列公式计算）：

$\text{日收益率} = \frac{\text{基金净值增长率} - \text{业绩比较基准收益率}}{\text{基金净值增长率}} \times 100\%$

注：1.自基金合同生效日起至2016年9月8日—2016年12月31日。

2.根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：中债3000指数收益率*70%+中国债总收益率*30%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，日收益率（按下列公式计算）：

$\text{日收益率} = \frac{\text{基金净值增长率} - \text{业绩比较基准收益率}}{\text{基金净值增长率}} \times 100\%$

注：1.自基金合同生效日起至2016年9月8日—2016年12月31日。

2.根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：中债3000指数收益率*70%+中国债总收益率*30%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，日收益率（按下列公式计算）：

$\text{日收益率} = \frac{\text{基金净值增长率} - \text{业绩比较基准收益率}}{\text{基金净值增长率}} \times 100\%$

注：1.自基金合同生效日起至2016年9月8日—2016年12月31日。

2.根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：中债3000指数收益率*70%+中国债总收益率*30%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，日收益率（按下列公式计算）：

$\text{日收益率} = \frac{\text{基金净值增长率} - \text{业绩比较基准收益率}}{\text{基金净值增长率}} \times 100\%$

注：1.自基金合同生效日起至2016年9月8