

东方红信用债券型证券投资基金

[2017]第一季度报告

基金管理人:上海东方证券资产管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

报告送出日期:2017年4月21日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招银基金管理有限公司根据本基金基金合同规定，于2017年4月10日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配、风险揭示等信息，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

基金过往业绩并不代表未来表现。投资有风险，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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称:东方红信用债券型证券投资基金

基金代码:001946

交易方式:场内

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2016年1月16日

报告期末基金份额总额:436,090,666.09份

本基金以信用债券为主要投资对象，合理控制信用风险，在追求基金安全的基础上，强调信用，力争为投资者提供高于业绩比较基准的长期定期回报。

投资目标:本基金对过往业绩并不代表未来表现。投资有风险，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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)

东方红信用债券A

东方红信用债券C

1.本期已实现收益

-3,136,791.10

-2,422,470.07

2.本期利润

339,662,931

-281,196,688

3.加权平均基金份额本期利润

0.0009

-0.0014

4.期末基金资产净值

261,637,415.54

181,847,915.01

5.期末基金份额净值

0.997

0.991

注:(1)本基金信用债券型亚指指标不包括持有认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于同类基金的平均水平。

(2)本期已实现收益指基金本期已实现收入、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

3.2.1 本基金报告期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

东证红信用债券A

东证红信用债券C

阶段

净值增长率

净值增长率标准差

① -0.07%

-31%

0.11%

35.1%

② -0.04%

-0.04%

过去三个月 0.00%

0.07%

-31%

0.11%

33.1%

③ -0.04%

-0.04%

注:过去三个月指2017年1月1日 - 2017年3月31日。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:过去三个月指2017年1月1日 - 2017年3月31日。

3.3 主要财务指标

3.3.1 主要财务指标

3.3.1.1 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

东证红信用债券A

东证红信用债券C

阶段

净值增长率

净值增长率标准差

① -0.07%

-31%

0.11%

35.1%

② -0.04%

-0.04%

过去三个月 0.00%

0.07%

-31%

0.11%

33.1%

③ -0.04%

-0.04%

注:过去三个月指2017年1月1日 - 2017年3月31日。

3.3.1.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:过去三个月指2017年1月1日 - 2017年3月31日。

3.3.2 主要财务指标

3.3.2.1 主要财务指标

3.3.2.1.1 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

东证红信用债券A

东证红信用债券C

阶段

净值增长率

净值增长率标准差

① -0.07%

-31%

0.11%

35.1%

② -0.04%

-0.04%

过去三个月 0.00%

0.07%

-31%

0.11%

33.1%

③ -0.04%

-0.04%

注:过去三个月指2017年1月1日 - 2017年3月31日。

3.3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:过去三个月指2017年1月1日 - 2017年3月31日。

3.3.3 主要财务指标

3.3.3.1 主要财务指标

3.3.3.1.1 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

东证红信用债券A

东证红信用债券C

阶段

净值增长率

净值增长率标准差

① -0.07%

-31%

0.11%

35.1%

② -0.04%

-0.04%

过去三个月 0.00%

0.07%

-31%

0.11%

33.1%

③ -0.04%

-0.04%

注:过去三个月指2017年1月1日 - 2017年3月31日。

3.3.3.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:过去三个月指2017年1月1日 - 2017年3月31日。

3.3.4 主要财务指标

3.3.4.1 主要财务指标

3.3.4.1.1 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

东证红信用债券A

东证红信用债券C

阶段

净值增长率

净值增长率标准差

① -0.07%

-31%

0.11%

35.1%

② -0.04%

-0.04%

过去三个月 0.00%

0.07%

-31%

0.11%

33.1%

③ -0.04%

-0.04%

注:过去三个月指2017年1月1日 - 2017年3月31日。

3.3.4.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:过去三个月指2017年1月1日 - 2017年3月31日。

3.3.5 主要财务指标

3.3.5.1 主要财务指标

3.3.5.1.1 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

东证红信用债券A

东证红信用债券C

阶段

净值增长率

净值增长率标准差

① -0.07%

-31%

0.11%

35.1%

② -0.04%

-0.04%

过去三个月 0.00%

0.07%

-31%

0.11%

33.1%

③ -0.04%

-0.04%

注:过去三个月指2017年1月1日 - 2017年3月31日。

3.3.5.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:过去三个月指2017年1月1日 - 2017年3月31日。

3.3.6 主要财务指标

3.3.6.1 主要财务指标

3.3.6.1.1 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

东证红信用债券A

东证红信用债券C

阶段

净值增长率

净值增长率标准差

① -0.07%

-31%

0.11%

35.1%

② -0.04%

-0.04%