

# 东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资 基金 2015 年年度报告

2015 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

送出日期：2016 年 3 月 26 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 21 日复核了本报告中的财务指标、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。

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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。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及其更新。

本报告期自 2015 年 6 月 3 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	16
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>17</b>
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>42</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	42
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	43
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	46
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	47

8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	47
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	47
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	47
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	47
8.12	投资组合报告附注 .....	47
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息 .....</b>	<b>48</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	49
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	49
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况 .....	49
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动 .....</b>	<b>49</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示 .....</b>	<b>50</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	50
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	50
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	50
11.4	基金投资策略的改变 .....	50
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	50
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	51
11.8	其他重大事件 .....	51
<b>§12</b>	<b>备查文件目录 .....</b>	<b>53</b>
12.1	备查文件目录 .....	53
12.2	存放地点 .....	53
12.3	查阅方式 .....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金
基金简称	东方红睿逸定期开放混合
基金主代码	001309
前端交易代码	001309
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型、开放式、发起式，本基金以定期开放方式运作，即以运作周期和到期开放期相结合的方式运作。
基金合同生效日	2015 年 6 月 3 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	1,054,594,202.29 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在力求本金长期安全的基础上，力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金以 36 个月为一个运作周期，以长期投资的理念进行大类资产的配置和个券选择，运用封闭期无流动性需求的优势，同时，充分考虑每个运作周期中期间开放期的安排，在股票的配置上，以时间换空间，采用低风险投资策略，为本基金获得更高的低风险收益；在债券配置上，合理配置久期匹配债券的结构，做好流动性管理，以期获得更高的投资收益。
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的三年期银行定期存款税后收益率+1.5%。
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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
信息披露负责人	姓名	唐涵颖	张燕
	联系电话	021-63325888	0755-83199084
	电子邮箱	service@dfham.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4009200808	95555
传真		021-63326981	0755-83195201
注册地址		上海市黄浦区中山南路 318	深圳市深南大道 7088 号招商银

	号 31 层	行大厦
办公地址	上海市黄浦区中山南路 318 号 2 号楼 31 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200010	518040
法定代表人	王国斌	李建红

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报, 上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.dfham.com
基金年度报告备置地点	上海东方证券资产管理有限公司 上海市中山南路 318 号 2 号楼 31 层 招商银行股份有限公司 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	立信会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区南京东路 61 号 4-11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	中国北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年 6 月 3 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	25,001,274.37
本期利润	52,667,648.80
加权平均基金份额本期利润	0.0499
本期加权平均净值利润率	5.00%
本期基金份额净值增长率	5.00%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末
期末可供分配利润	25,001,274.37
期末可供分配基金份额利润	0.0237
期末基金资产净值	1,107,261,851.09
期末基金份额净值	1.050
3.1.3 累计期末指标	2015 年末
基金份额累计净值增长率	5.00%

注：1、表中的“期末”均指报告期最后一日，即 12 月 31 日；“本期”指 2015 年 6 月 3 日-2015 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、基金转换费等)，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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

4、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 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①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	6.92%	0.40%	1.07%	0.01%	5.85%	0.39%
过去六个月	6.38%	0.49%	2.25%	0.01%	4.13%	0.48%
自基金合同生效起至今	5.00%	0.51%	2.64%	0.01%	2.36%	0.50%

注：1、本基金合同于 2015 年 6 月 3 日生效。

2、自基金合同生效日起至至今指 2015 年 6 月 3 日-2015 年 12 月 31 日。

3、根据基金合同中的有关规定，本基金以定期开放方式运作，即以运作周期和到期开放相结合的方式运作，业绩比较基准为同期中国人民银行公布的三年期银行定期存款税后收益率+1.5%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，t 日收益率（ $benchmark_t$ ）按下列公式计算：

$$benchmark_t = 100\% * [(t \text{ 日三年期银行定期存款税后收益率} + 1.5\%) / 365]$$

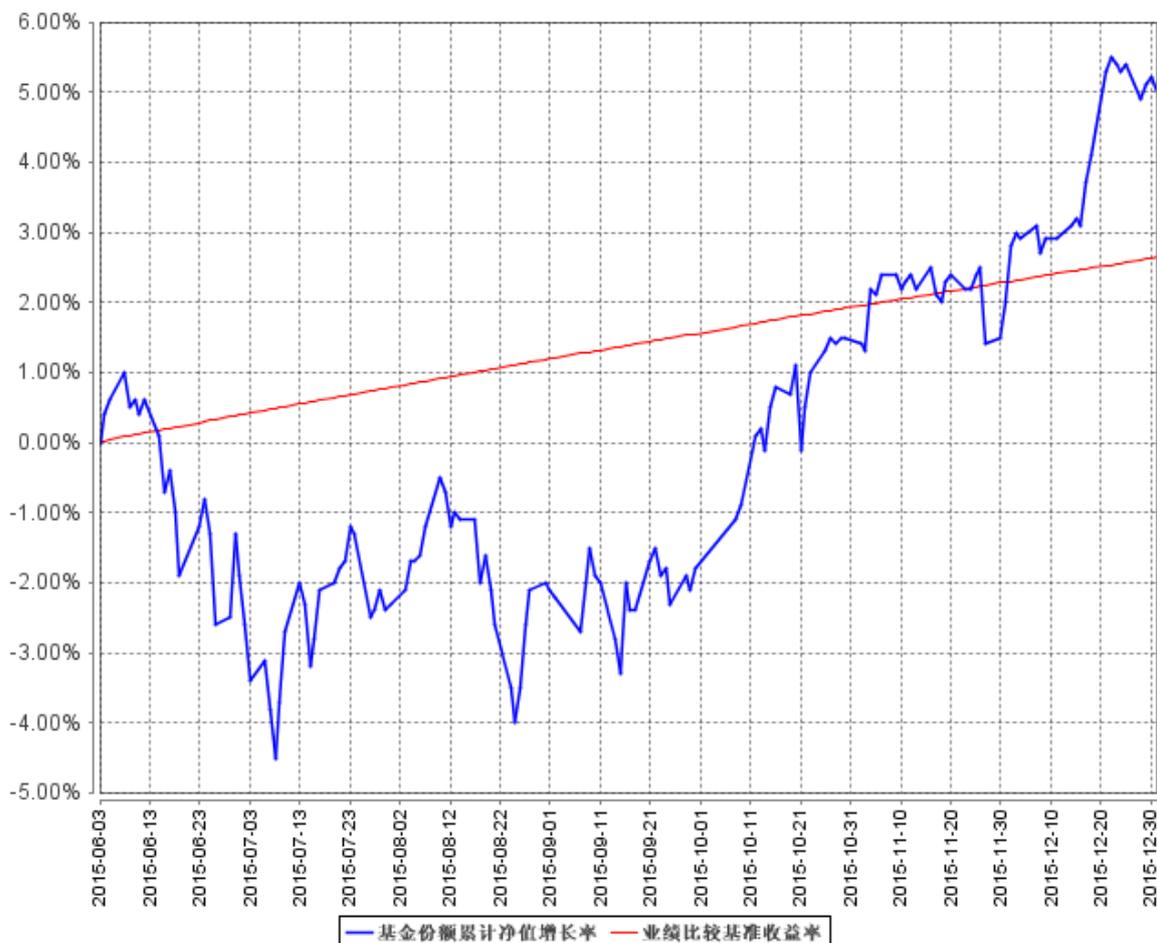
其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ，T 表示时间截至日；

t 日至 T 日的期间收益率（ $benchmark_{t:T}$ ）按下列公式计算：

$$benchmark_{t:T} = [\prod_{t}^T (1 + benchmark_t)] - 1$$

其中， $T=2, 3, 4, \dots$ ； $\prod_{t}^T (1 + benchmark_t)$  表示 t 日至 T 日的  $(1 + benchmark_t)$  数学连乘。

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

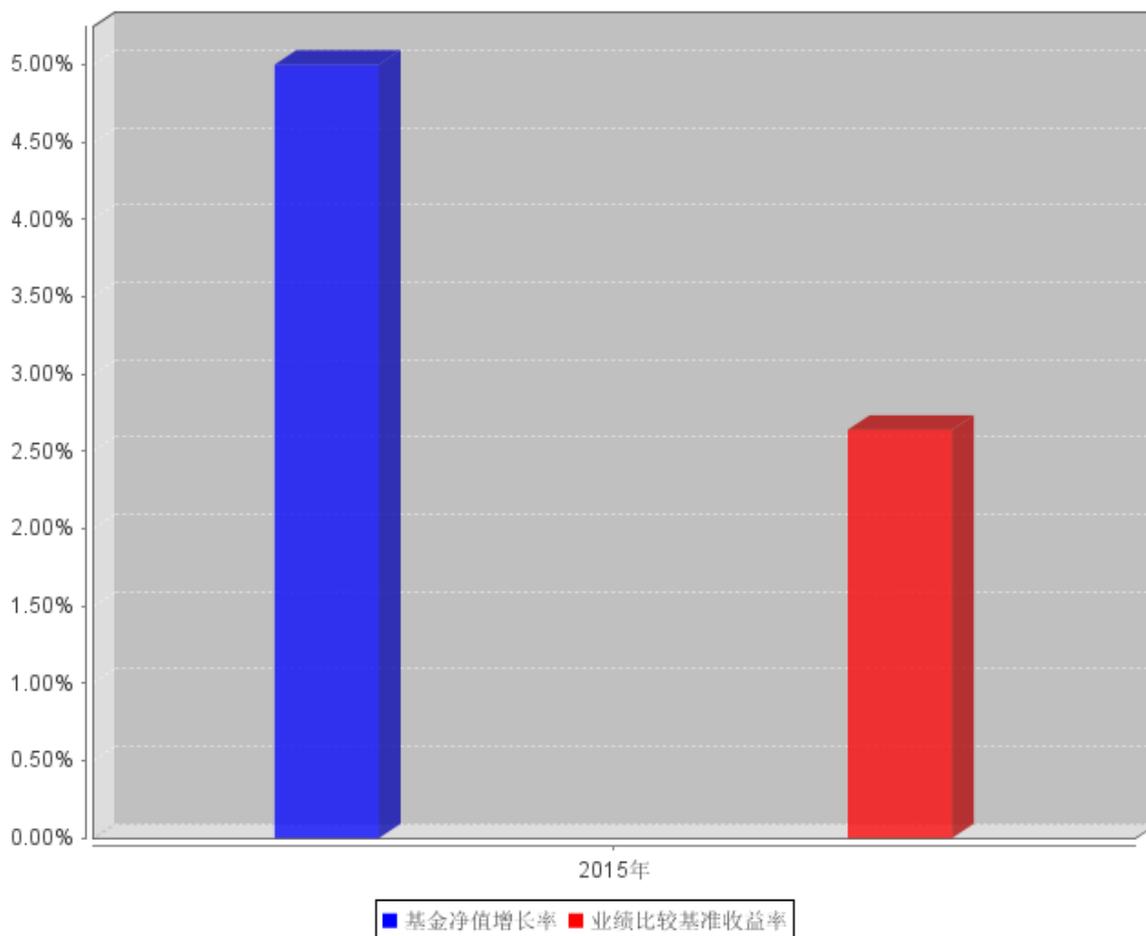


注：(1) 截止日期为 2015 年 12 月 31 日。

(2) 本基金合同于 2015 年 6 月 3 日生效，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

(3) 本基金建仓期 6 个月，即从 2015 年 6 月 3 日至 2015 年 12 月 2 日，至本报告期末本基金已建仓完成，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：1、本图所示时间区间为 2015 年 06 月 03 日至 2015 年 12 月 31 日。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自 2015 年 06 月 03 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日未实施利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上海东方证券资产管理有限公司成立于 2010 年 7 月 28 日，是国内首家获中国证监会批准设立的券商系资产管理公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准东方证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可[2010]518 号）批准，由东方证券股份有限公司出资 3 亿元在原东方证券资产管理业务总部的基础上成立。2013 年 8 月，公司成为首家获得“公开募集证券投资基金管理业务资格”的证券公司。公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。截至 2015 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理东方红新动力灵活配置混合型证券投资

资基金、东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金、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、东方红中国优势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、东方红稳健精选混合型证券投资基金、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金、东方红优势精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红纯债债券型发起式证券投资基金、东方红收益增强债券型证券投资基金、东方红信用债债券型证券投资基金十五只证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
林鹏	本基金基金经理，兼东方证券资产管理有限公司执行董事、东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金、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、东方红领先精选灵活配置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、	2015年6月3日	-	18年	硕士，曾任东方证券股份有限公司研究所研究员、资产管理业务总部投资经理；现任上海东方证券资产管理有限公司执行董事、公募权益投资部总监兼任东方红睿丰混合、东方红睿阳混合、东方红睿元混合、东方红领先精选混合、东方红稳健精选混合、

	东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。				东方红睿逸定期开放混合基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。
纪文静	本基金基金经理，兼任上海东方证券资产管理有限公司公募固定收益投资部副总监、东方红领先精选灵活配置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、东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红纯债债券型发起时证券投资基金、东方红收益增强债券型证券投资基金、东方红信用债债券型证券投资	2015 年 7 月 14 日	-	10 年	硕士，曾任东海证券股份有限公司固定收益部债券交易员、德邦证券股份有限公司债券投资与交易部总经理，2014 年 10 月加入上海东方证券资产管理有限公司，现任上海东方证券资产管理有限公司公募固定收益投资部副总监兼任东方红领先精选混合、东方红稳健精选混合、东方红睿逸定期开放混合、东方红策略精选混合、东方红纯债债

	基金基金 经理			券、东方 红收益增 强债券、 东方红信 用债债券 基金经 理。具有 基金从业 资格，中 国国籍。
--	------------	--	--	---

注：1、上述表格内基金首任基金经理“任职日期”指基金合同生效日，“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；对此后非首任基金经理，基金经理的“任职日期”和“离任日期”均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，上海东方证券资产管理有限公司作为本基金管理人，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、基金合同以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了《上海东方证券资产管理有限公司公平交易制度》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；2、对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理，确保公平对待所有投资组合。

事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1 日、3 日、5 日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、集合及定向产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，合规与风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《上海东方证券资产管理有限公司公平交易制度》等规定。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年，权益市场波动较大。全年来看，上证综指上涨 9.41%，深证成指上涨 14.98%，沪深 300 上涨 5.58%，创业板上涨 84.41%，中小板上涨 53.7%。2015 年债券市场在经济增速下行的宏观环境下，收益率大幅下行，中债总财富指数上涨 8.03%。本产品一方面积极参与债券市场，获取了稳定的收益；另一方面精选蓝筹个股进行配置。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.050 元，份额累计净值为 1.050 元。本报告期内，本基金净值增长率为 5.00%，业绩比较基准收益率为 2.64%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年经济增速仍将保持低位，“供给侧”改革将延续，成为资本市场最显著的影响因素，以股票和债券市场为主的直接融资金量将大幅上升，积极财政政策和适度宽松的货币政策或贯穿全

年。

从债券市场来看，一方面稳增长持续发力或带来经济阶段性企稳的情况，另一方面汇率等因素导致货币政策面临两难、全面宽松不断滞后。因此，短期看债券市场波动加剧，但中长期看，中国经济进入下行通道，利率维持低位震荡，债券市场仍然有机会。然而经济下行周期，信用风险加速暴露，因此“防踩雷”是贯穿全年的主题。

从权益市场来看，经过前期的调整，个股的价值已经体现，且积极的财政政策和相对宽松的货币政策也都有利于权益市场。另外，从需求角度来看，债券等固定收益资产收益率的下行将倒逼资金向高波动性的权益市场寻求超额收益。这部分资金以保险和理财资金为代表，更青睐低估值高分红、经营稳定的个股。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人坚持规范经营、合规运作，重视公司和基金运作的风险管理，以制度、流程、系统为抓手，整体提升合规与风险管理水平，切实做好公募基金业务的稽核监察工作。基金管理人日常监察稽核工作主要由合规与风险管理部承担，2015 年依据相关法律法规及公司制度规定，开展了如下主要监察稽核工作：

##### （一）切实履行日常合规管理各项职责

1、完成了公司 2015 年相关合规审查工作。2、及时完成公司各类合规与风险管理报告工作，定期向公司董事和监管机构出具监察稽核报告。3、梳理公司业务流程，建议并督促相关部门完善业务和管理制度，积极推进各项业务制度流程管理的有效化。4、完成反洗钱各项基础工作。

##### （二）推进监察稽核工作日常化

1、合规与风险管理部全年进行多次常规检查、专项检查，并出具检查报告，协助相关部门梳理业务风险点，不断促进各业务流程的固化执行、公司各项制度的有效落地。

2、对于常规检查、专项检查等发现公司部门管理或业务执行存在的问题，合规与风险管理部协助相关部门制定整改计划，并根据出具的合规建议或整改要求持续跟踪及监督相关事项的整改情况，督促相关部门落实整改措施。

##### （三）继续公司全面风险管理体系建设

2015 年，合规与风险管理部根据监管的要求在制度、流程、指标、系统、人员、管理机制等方面完成了全面风险管理体系的框架构建，并开始在全公司范围内落实。

##### （四）强化公司员工执业行为管理

合规与风险管理部不断加强部门内员工队伍专业知识和职业技能的培训，同时注重加强对公司员工的合规与风险管理培训，通过组织多次内部培训进一步提升全体员工的合规意识，加强员

工执业行为自律。2015 年，为进一步规范公司员工本人及其配偶、利害关系人的投资行为管理，对员工投资行为管理办法实施细则做出了补充规定。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，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净值计算的复核责任。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。

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务，本基金管理人对估值和定价过程进行了严格的控制。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上，确定本基金管理人采用的估值政策。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，公司设估值决策小组，成员包括：公司总经理、公司联席总经理、合规总监（督察长）、交易总监、运营总监、市场总监、投资经理、基金会计主管。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变更可参与讨论，但最终决策由估值决策小组讨论决策并联名审批。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署提供中债收益率曲线和中债估值的服务协议，由其按约定提供银行间同业市场债券品种的估值数据。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配。

本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，基金合同生效未满三年，不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

# § 6 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	信会师报字[2016]第 130204 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的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”）的财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年 06 月 03 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是东方红睿逸的基金管理人的责任。这种责任包括： (1) 按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，并使其实现公允反映； (2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露

	<p>的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	<p>我们认为，东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金财务报表在所有重大方面按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了东方红睿逸 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 06 月 03 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>	
注册会计师的姓名	王 斌	唐 成
会计师事务所的名称	立信会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	上海市黄浦区南京东路 61 号 4-11 楼	
审计报告日期	2016 年 3 月 25 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金

报告截止日： 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	70,244,387.17
结算备付金		1,976,273.42
存出保证金		411,449.84
交易性金融资产	7.4.7.2	1,330,969,229.21
其中：股票投资		258,898,513.01
基金投资		-
债券投资		1,072,070,716.20
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-

应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	13,105,117.27
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		1,416,706,456.91
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年12月31日</b>
<b>负债:</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		296,199,310.90
应付证券清算款		11,106,719.37
应付赎回款		-
应付管理人报酬		1,394,095.68
应付托管费		185,879.44
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	333,351.65
应交税费		-
应付利息		45,248.78
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	180,000.00
负债合计		309,444,605.82
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	7.4.7.9	1,054,594,202.29
未分配利润	7.4.7.10	52,667,648.80
所有者权益合计		1,107,261,851.09
负债和所有者权益总计		1,416,706,456.91

注：1. 本基金于 2015 年 6 月 3 日成立，无上年度末可比数据。

2. 报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.050 元，基金份额总额 1,054,594,202.29 份。

## 7.2 利润表

会计主体：东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2015 年 6 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015年6月3日(基金合同生效日)至 2015年12月31日
----	-----	--

<b>一、收入</b>		69,247,297.01
1. 利息收入		21,368,019.48
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,566,962.06
债券利息收入		19,488,224.82
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		312,832.60
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		20,202,367.16
其中：股票投资收益	7.4.7.12	7,684,013.20
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	11,092,107.27
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	1,426,246.69
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	27,666,374.43
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	10,535.94
<b>减：二、费用</b>		16,579,648.21
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	9,127,712.64
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,217,028.40
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	2,248,468.04
5. 利息支出		3,771,678.45
其中：卖出回购金融资产支出		3,771,678.45
6. 其他费用	7.4.7.20	214,760.68
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		52,667,648.80
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		52,667,648.80

注：本基金于 2015 年 6 月 3 日成立，无上年度可比期间数据。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2015 年 6 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 6 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,054,594,202.29	-	1,054,594,202.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	52,667,648.80	52,667,648.80
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,054,594,202.29	52,667,648.80	1,107,261,851.09

注：本基金于 2015 年 6 月 3 日成立，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

          陈光明  任莉  詹朋            
 基金管理人负责人                    主管会计工作负责人                    会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金募集的批复》(证监许可[2015]783号文)核准,由上海东方证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2015 年 6 月 3 日生效。本基金为契约型、开放式和发起式,本基金以定期开放方式运作,即以运作周期和到期开放期相结合的方式运作,存续期限不定。本基金的基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金于 2015 年 5 月 18 日至 2015 年 5 月 29 日向社会公开募集,扣除认购费后的有效认购资金 1,054,169,974.64 元,利息转份额 424,227.65 元,募集规模为 1,054,594,202.29 份。上述募集资金已由立信会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债、央行票据、中期票据、中小企业私募债、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。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。

本基金的业绩比较基准为:同期中国人民银行公布的三年期银行定期存款税后收益率+1.5%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本基金合同于 2015 年

06 月 03 日生效。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### **7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则**

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1、本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 6 次，每份基金份额每次收益分配比例不低于收益分配基准日每份基金份额截至收益分配基准日可供分配利润的 10%；
- 3、若《基金合同》生效不满 3 个月则可不进行收益分配；
- 4、本基金收益分配方式仅现金分红一种方式；
- 5、基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- 6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》,若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》,对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),采用第三方估值机构提供的价格数据确定公允价值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需说明的会计政策变更事项。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围, 不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的股票的股息、红利收入, 由上市公司在向基金派发股息、红利时代扣代缴个人所得税。持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息、红利收入全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50%计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25%计入应纳税所得额, 自 2015 年 9 月 8 日起, 暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。对基金取得的企业债券利息收入, 应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税, 暂不征收企业所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	70,244,387.17
定期存款	-
其中: 存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计:	70,244,387.17

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	250,873,180.24	258,898,513.01	8,025,332.77
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	226,781,191.20	229,460,716.20
	银行间市场	825,648,483.34	842,610,000.00
	合计	1,052,429,674.54	1,072,070,716.20
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,303,302,854.78	1,330,969,229.21	27,666,374.43

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本报告期末未持有任何买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
应收活期存款利息	57,330.39
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,381.34
应收债券利息	13,045,201.93
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	203.61
合计	13,105,117.27

### 7.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末，未持有其他应收款、待摊费用等其他资产。

### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	311,788.55
银行间市场应付交易费用	21,563.10
合计	333,351.65

### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	180,000.00
合计	180,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 6 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	1,054,594,202.29	1,054,594,202.29
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,054,594,202.29	1,054,594,202.29

注：本基金合同于 2015 年 6 月 3 日生效。设立时募集的扣除认购费后的有效认购资金为 1,054,169,974.64 元，利息转份额 424,227.65 元，募集规模为 1,054,594,202.29 份。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	25,001,274.37	27,666,374.43	52,667,648.80
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,001,274.37	27,666,374.43	52,667,648.80

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 6 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,084,764.28
定期存款利息收入	416,222.22
其他存款利息收入	-

结算备付金利息收入	43,935.01
其他	22,040.55
合计	1,566,962.06

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月3日(基金合同生效日)至2015年12月31日
卖出股票成交总额	687,068,506.55
减：卖出股票成本总额	679,384,493.35
买卖股票差价收入	7,684,013.20

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月3日(基金合同生效日)至2015年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	11,092,107.27
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	11,092,107.27

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月3日(基金合同生效日)至2015年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,184,950,527.46
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,156,148,070.83
减：应收利息总额	17,710,349.36
买卖债券差价收入	11,092,107.27

##### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入

##### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金在本报告期未进行贵金属投资。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金在本报告期无买卖贵金属差价收入。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期无贵金属赎回差价收入。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期无贵金属申购差价收入。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期无买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月3日(基金合同生效日)至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,426,246.69
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,426,246.69

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年6月3日(基金合同生效日)至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	27,666,374.43
——股票投资	8,025,332.77
——债券投资	19,641,041.66
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-

——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	27,666,374.43

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年6月3日(基金合同生效日)至2015年12月31日
基金赎回费收入	-
其他	10,535.94
合计	10,535.94

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年6月3日(基金合同生效日)至2015年12月31日
交易所市场交易费用	2,231,568.04
银行间市场交易费用	16,900.00
合计	2,248,468.04

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年6月3日(基金合同生效日)至2015年12月31日
审计费用	60,000.00
信息披露费	120,000.00
银行费用	25,460.68
帐户维护费	9,000.00
其他	300.00
合计	214,760.68

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日,本基金未发生需要披露的重大或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金管理人于2016年3月25日发布公告,同意王国斌先生自2016年3月24日起辞去公司董事长职务,由公司总经理陈光明先生代为履行公司董事长职务。

截至财务报表批准报出日,本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
上海东方证券资产管理有限公司（“东证资管”）	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：1. 本报告期存在控制关系或重大利害关系的关联方未发生变化。

2. 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金合同生效日为 2015 年 06 月 03 日，无上年度可比期间。

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 6 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
东方证券	1,616,213,342.26	100.00%

注：本基金合同生效日为 2015 年 6 月 3 日，无上年度同期对比数据。

##### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 6 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
东方证券	433,530,748.43	100.00%

注：本基金合同生效日为 2015 年 6 月 3 日，无上年度同期对比数据。

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 6 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
东方证券	4,631,508,000.00	100.00%

注：本基金合同生效日为 2015 年 6 月 3 日，无上年度同期对比数据。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年6月3日(基金合同生效日)至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
东方证券	1,382,712.17	100.00%	311,788.55	100.00%

注：1. 本基金合同生效日为 2015 年 6 月 3 日，无上年度同期对比数据。

2、上述佣金按市场佣金率计算,扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所以买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

3. 本公司因作为证券公司子公司尚未获得在上海交易所租用其他券商交易单元资格；截至报告期末，本公司已在深证交易所获得租用券商交易单元资格，并已按公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月3日(基金合同生效日)至2015年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	4,504,723.66

注：1. 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

2. 实际支付销售机构的客户维护费以本基金管理人和各销售机构对账确认的金额为准。

3、本基金合同生效日为 2015 年 6 月 3 日，无上年度同期对比数据。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 6 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,217,028.40

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

2、本基金合同生效日为 2015 年 6 月 3 日，无上年度同期对比数据。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。本基金合同生效日为 2015 年 6 月 3 日，无上年度可比期间数据。

### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期
	2015 年 6 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2015 年 6 月 3 日）持有的基金份额	10,004,850.00
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分变动份额	-
减：期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	10,004,850.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.9500%

注：1、本报告期内基金管理人运用固有资金于 2015 年 5 月 18 日认购东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金，按照招募说明书规定，认购费 1000 元。

2、本基金合同生效日为 2015 年 6 月 3 日，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年6月3日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	70,244,387.17	1,084,764.28

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

2. 本基金合同生效日为 2015 年 6 月 3 日，无上年度同期对比数据。

### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

### 7.4.11 利润分配情况

#### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期末未进行利润分配。

### 7.4.12 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002778	高科石化	2015年12月28日	2016年1月6日	新股流通受限	8.50	8.50	5,600	47,600.00	47,600.00	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
136104	15市北债	2015年12月22日	2016年1月6日	新债流通受限	100.00	100.00	50,000	5,000,000.00	5,000,000.00	-
136121	15南山02	2015年12月25日	2016年1月21日	新债流通受限	100.00	100.00	500,000	50,000,000.00	50,000,000.00	-
123001	蓝标转债	2015年12月23日	2016年1月8日	新债流通受限	100.00	100.00	3,030	303,000.00	303,000.00	-

### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000002	万科A	2015年12月18日	重大事项停牌	24.43	-	-	256,593	3,502,337.13	6,268,566.99	-
600271	航天信息	2015年10月12日	重大事项停牌	71.46	-	-	2,600	186,434.69	185,796.00	-

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 238,199,310.90 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
150210	15 国开 10	2016/1/4	108.36	1,000,000.00	108,360,000.00
101576004	15 义国资产 MTN002	2016/1/6	102.37	300,000.00	30,711,000.00
101558026	15 南玻 MTN001	2016/1/4	104.19	500,000.00	52,095,000.00
101559059	15 余城建设 MTN001	2016/1/4	100.92	600,000.00	60,552,000.00
合计				2,400,000.00	251,718,000.00

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 58,000,000.00 元，于 2016 年 1 月 4 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在经营层面设立风险控制委员会，实施董事会风控与审计委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由合规与风险管理部

和风险管理负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险，本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2015 年 12 月 31 日
A-1	20,176,000.00
A-1 以下	-
未评级	240,846,000.00
合计	261,022,000.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券包含期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的其他债券。

3. 本基金合同生效日为 2015 年 6 月 3 日，无上年度末数据。

##### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2015 年 12 月 31 日
AAA	109,187,716.20
AAA 以下	582,665,000.00
未评级	119,196,000.00
合计	811,048,716.20

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券包含期限大于一年的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的其他债券。

3、本基金合同生效日为 2015 年 6 月 3 日，无上年度末数据。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	70,244,387.17	-	-	-	-	-	70,244,387.17
结算备付金	1,976,273.42	-	-	-	-	-	1,976,273.42
存出保	411,449.84	-	-	-	-	-	411,449.84

证金							
交易性金融资产		50,345,000.00	210,677,000.00	646,798,291.20	164,250,425.00	258,898,513.01	1,330,969,229.21
应收利息						13,105,117.27	13,105,117.27
资产总计	72,632,110.43	50,345,000.00	210,677,000.00	646,798,291.20	164,250,425.00	272,003,630.28	1,416,706,456.91
负债							
卖出回购金融资产款	296,199,310.90						296,199,310.90
应付证券清算款						11,106,719.37	11,106,719.37
应付管理人报酬						1,394,095.68	1,394,095.68
应付托管费						185,879.44	185,879.44
应付交易费用						333,351.65	333,351.65
应付利息						45,248.78	45,248.78
其他负债						180,000.00	180,000.00
负债总计	296,199,310.90					13,245,294.92	309,444,605.82
利率敏感度缺口	-223,567,200.47	50,345,000.00	210,677,000.00	646,798,291.20	164,250,425.00	258,758,335.36	1,107,261,851.09

注：1. 上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

2、本基金合同生效日为 2015 年 6 月 3 日，无上年度末对比数据。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金于本报告期末的利率风险状况；	
	该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；	
	该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

	影响金额（单位：人民币元）	
	本期末（2015年12月31日）	
上升 0.25%	-8,089,361.13	
下降 0.25%	8,089,361.13	

本基金合同生效日为 2015 年 6 月 3 日，无上年度末数据。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他市场价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他市场价格风险，主要受到证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	258,898,513.01	23.38
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	1,072,070,716.20	96.82
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	1,330,969,229.21	120.20

注：1、本基金合同生效日为 2015 年 6 月 3 日，无上年度末对比数据。

2、本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债、央行票据、中期票据、中小企业私募债、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关；	
	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2015 年 12 月 31 日）
	上升 5%	9,411,725.73
	下降 5%	-9,411,725.73

注：1、本基金合同生效日为 2015 年 6 月 3 日，无上年度末可比数据。

2、本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准对应的股票市场指数（沪深 300）价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	1. 置信区间 95%	
	2. 观察期 统计日之前的 250 个交易日	
分析	风险价值（单位：人民币元）	本期末（2015 年 12 月 31 日）
	1 天	4,761,225.96
	1 周	10,646,424.90

注：本基金合同生效日为 2015 年 6 月 3 日，无上年度末可比数据。

### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 1,078,572,679.19 元，第二层次的余额为 252,396,550.02 元，无属于第三

层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金采用第三方估值机构根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将相关债券的公允价值确定为第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	258,898,513.01	18.27
	其中：股票	258,898,513.01	18.27
2	固定收益投资	1,072,070,716.20	75.67
	其中：债券	1,072,070,716.20	75.67
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	72,220,660.59	5.10

7	其他各项资产	13,516,567.11	0.95
8	合计	1,416,706,456.91	100.00

注：本基金本报告期末未持有通过沪港通交易机制投资的港股。

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	7,286,382.00	0.66
B	采矿业	-	-
C	制造业	219,487,136.52	19.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,322,096.00	0.30
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,380,998.98	0.12
J	金融业	4,629,264.66	0.42
K	房地产业	6,268,566.99	0.57
L	租赁和商务服务业	16,414,675.65	1.48
M	科学研究和技术服务业	109,392.21	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	258,898,513.01	23.38

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通交易机制投资的港股。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002415	海康威视	992,991	34,148,960.49	3.08
2	000651	格力电器	1,163,028	25,993,675.80	2.35
3	600066	宇通客车	1,096,054	24,650,254.46	2.23
4	000858	五粮液	808,806	22,064,227.68	1.99
5	002475	立讯精密	592,200	18,920,790.00	1.71
6	002400	省广股份	652,671	16,414,675.65	1.48
7	600887	伊利股份	923,700	15,176,391.00	1.37
8	600309	万华化学	783,732	13,989,616.20	1.26
9	000538	云南白药	184,626	13,407,540.12	1.21
10	600557	康缘药业	372,200	9,312,444.00	0.84
11	600196	复星医药	377,031	8,856,458.19	0.80
12	600276	恒瑞医药	176,265	8,658,136.80	0.78
13	300498	温氏股份	159,300	7,286,382.00	0.66
14	000002	万科A	256,593	6,268,566.99	0.57
15	300146	汤臣倍健	158,909	6,117,996.50	0.55
16	002311	海大集团	413,926	5,782,546.22	0.52
17	600660	福耀玻璃	379,400	5,763,086.00	0.52
18	000860	顺鑫农业	157,468	3,354,068.40	0.30
19	000889	茂业通信	209,200	3,322,096.00	0.30
20	601169	北京银行	284,522	2,996,016.66	0.27
21	002701	奥瑞金	76,900	2,173,194.00	0.20
22	601318	中国平安	45,368	1,633,248.00	0.15
23	300496	中科创达	6,560	918,465.60	0.08
24	603996	中新科技	16,729	494,174.66	0.04
25	000848	承德露露	19,400	320,100.00	0.03
26	300493	润欣科技	7,248	299,632.32	0.03
27	600271	航天信息	2,600	185,796.00	0.02
28	300494	盛天网络	6,251	162,901.06	0.01
29	300492	山鼎设计	6,219	109,392.21	0.01
30	002785	万里石	12,000	70,080.00	0.01
31	002778	高科石化	5,600	47,600.00	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
----	------	------	----------	----------------

1	601318	中国平安	93,899,399.76	8.48
2	000002	万 科 A	93,764,111.70	8.47
3	600196	复星医药	70,045,267.06	6.33
4	002415	海康威视	45,072,194.27	4.07
5	601169	北京银行	39,343,806.04	3.55
6	000858	五 粮 液	38,234,104.03	3.45
7	600066	宇通客车	36,782,977.54	3.32
8	600309	万华化学	35,562,636.89	3.21
9	000651	格力电器	32,350,648.94	2.92
10	000848	承德露露	31,064,727.90	2.81
11	601336	新华保险	26,302,209.07	2.38
12	002475	立讯精密	22,695,805.52	2.05
13	600060	海信电器	22,354,057.76	2.02
14	000001	平安银行	21,137,966.11	1.91
15	300017	网宿科技	20,779,451.05	1.88
16	300186	大华农	18,629,372.00	1.68
17	002701	奥瑞金	17,586,550.10	1.59
18	000889	茂业通信	16,924,771.79	1.53
19	000538	云南白药	16,309,235.19	1.47
20	600019	宝钢股份	15,922,361.22	1.44

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	000002	万 科 A	95,493,405.25	8.62
2	601318	中国平安	94,462,189.17	8.53
3	600196	复星医药	53,450,617.17	4.83
4	601169	北京银行	36,925,782.55	3.33
5	000848	承德露露	33,579,109.95	3.03
6	300017	网宿科技	29,654,535.87	2.68
7	601336	新华保险	24,677,494.06	2.23
8	600060	海信电器	23,195,849.93	2.09
9	300186	大华农	21,458,324.88	1.94
10	000001	平安银行	20,607,299.64	1.86

11	600019	宝钢股份	16,660,841.80	1.50
12	002701	奥瑞金	15,092,482.84	1.36
13	600261	阳光照明	14,212,000.40	1.28
14	600309	万华化学	13,728,979.00	1.24
15	002250	联化科技	12,873,057.03	1.16
16	000858	五粮液	12,643,634.66	1.14
17	000889	茂业通信	11,267,824.80	1.02
18	000651	格力电器	11,044,841.58	1.00
19	000957	中通客车	11,019,395.00	1.00
20	601009	南京银行	10,737,033.14	0.97

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	929,144,835.71
卖出股票收入（成交）总额	687,068,506.55

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	119,196,000.00	10.76
	其中：政策性金融债	119,196,000.00	10.76
4	企业债券	222,227,000.00	20.07
5	企业短期融资券	261,022,000.00	23.57
6	中期票据	462,392,000.00	41.76
7	可转债（可交换债）	7,233,716.20	0.65
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,072,070,716.20	96.82

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	150210	15 国开 10	1,100,000	119,196,000.00	10.76

2	101559059	15 余城建设 MTN001	600,000	60,552,000.00	5.47
3	011519009	15 国电 SCP009	600,000	60,162,000.00	5.43
4	011550005	15 商飞 SCP005	600,000	60,138,000.00	5.43
5	101558026	15 南玻 MTN001	500,000	52,095,000.00	4.70

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未进行股指期货投资。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理股指期货合约数量，以萃取相应股票组合的超额收益。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未进行国债期货投资。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未进行国债期货投资。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1

本基金持有的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	411,449.84
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,105,117.27
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,516,567.11

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113008	电气转债	2,753,400.00	0.25

注：本基金本报告期末持有的 113008 电气可转债处于转股期，转股期从 2015 年 8 月 3 日至 2021 年 2 月 1 日。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例

6,675	157,991.64	11,092,013.52	1.05%	1,043,502,188.77	98.95%
-------	------------	---------------	-------	------------------	--------

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

### 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,004,850.00	0.95	10,004,850.00	0.95	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,004,850.00	0.95	10,004,850.00	0.95	3 年

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年6月3日）基金份额总额	1,054,594,202.29
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	1,054,594,202.29

注：1、本基金合同生效日为 2015 年 6 月 3 日。

2、总申购份额含红利再投份额（本基金暂未开通基金转换业务）。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

本报告期本基金管理人于 2015 年 5 月 22 日发布公告，自 2015 年 5 月 21 日起免去钱慧同志公开募集基金业务合规负责人（督察长）的职务，由陈光明同志代行公开募集基金业务合规负责人（督察长）职责。

本报告期本基金管理人于 2015 年 8 月 18 日发布公告，自 2015 年 8 月 18 日起任命唐涵颖同志担任公开募集基金业务合规负责人（督察长）职责，公司总经理陈光明先生自 2015 年 8 月 18 日起不再代任行公开募集基金管理业务合规负责人。

本报告期本基金管理人于 2015 年 12 月 28 日发布公告，自 2015 年 12 月 28 日起任命任莉同志担任基金管理人副总经理。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是立信会计师事务所有限公司。该会计师事务所自本基金基金合同生效日（2015 年 6 月 3 日）起为本基金提供审计服务至今，本基金本年度支付给审计机构立信会计师事务所有限公司审计报酬为 6 万元人民币。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券		21,616,213,342.26	100.00%	1,382,712.17	100.00%	-
方正证券	1	-	-	-	-	-

注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易（如有）而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

#### 2、交易单元的选择标准和程序

##### （1）选择标准

券商财务状况良好、经营行为规范，最近一年无重大违规行；具有较强的研究服务能力；交易佣金收费合理。

##### （2）选择程序

基金管理人根据以上标准对不同券商进行综合评价，然后根据评价选择券商，与其签订协议租用交易单元。

3、本基金合同于 2015 年 6 月 3 日生效，上表所列示券商交易单元均为本报告期内新增。

4、截至本报告期末，本公司因作为证券公司子公司尚未获得在上海交易所租用其他券商交易单元资格；本公司已在深证交易所获得租用券商交易单元资格，并已按公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	433,530,748.43	100.00%	4,631,508,000.00	100.00%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2015 年 6 月 4 日
2	东方证券资产管理有限公司旗下基金 2015 年 6 月 30 日基金资产净值和基金份额净值公告	公司网站	2015 年 7 月 1 日
3	上海东方证券资产管理有限公司关于开通通联快捷开户及支付业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015 年 7 月 10 日
4	上海东方证券资产管理有限公司关于新增网上直销系统支持银行卡的提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015 年 7 月 13 日
5	上海东方证券资产管理有限公司关于增聘东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2015 年 7 月 14 日
6	上海东方证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015 年 8 月 18 日
7	上海东方证券资产管理有限公司关于东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2015 年 9 月 7 日
8	东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金 2015 年第 3 季度报告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2015 年 10 月 26 日
9	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015 年 11 月 10 日

10	上海东方证券资产管理有限公司 关于旗下部分基金调整停牌股票 估值方法的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、公 司网站	2015 年 11 月 20 日
11	上海东方证券资产管理有限公司 关于旗下部分基金调整停牌股票 估值方法的公告	中国证券报、上海证 券报、公司网站	2015 年 11 月 23 日
12	上海东方证券资产管理有限公司 关于旗下基金投资资产支持证券 方案的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报、公司网站	2015 年 11 月 27 日
13	上海东方证券资产管理有限公司 关于新增基金高级管理人员的公 告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、公 司网站	2015 年 12 月 28 日

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金的文件；
- 2、《东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金财务报表及报表附注；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人办公场所：上海市中山南路 318 号 2 号楼 31 层。

### 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，亦可通过公司网站查阅，公司网址为：  
www.dfham.com。

上海东方证券资产管理有限公司  
2016 年 3 月 26 日