

# 东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金 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

上海东方证券资产管理有限公司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。本年度报告由董事长签发。

基金托管人中国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、净值表现和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 1 月 1 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.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>18</b>
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	22
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>44</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	44
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	50
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.....	50

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 .....	50
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 .....	51
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	51
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	51
8.12	投资组合报告附注 .....	51
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息 .....</b>	<b>52</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
9.2	期末上市基金前十名持有人 .....	52
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	53
9.4	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 .....	53
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动 .....</b>	<b>53</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示 .....</b>	<b>54</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	54
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 .....	54
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
11.4	基金投资策略的改变 .....	54
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	54
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 .....	54
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
11.8	其他重大事件 .....	56
<b>§12</b>	<b>备查文件目录 .....</b>	<b>60</b>
12.1	备查文件目录 .....	60
12.2	存放地点 .....	60
12.3	查阅方式 .....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	东方红睿丰混合
场内简称	东证睿丰
基金主代码	169101
前端交易代码	169101
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型，本基金合同生效后三年内封闭运作，在交易所上市交易，基金合同生效满三年后转为上市开放式。
基金合同生效日	2014 年 9 月 19 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	1,610,160,711.75 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015-03-06

### 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，追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	本基金在中国经济增长模式转型的大背景下，寻找符合经济发展趋势的行业，积极把握由新型城镇化、人口结构调整、资源环境约束、产业升级、商业模式创新等大趋势带来的投资机会，挖掘重点行业中的优势个股，自下而上精选具有核心竞争优势的企业，分享转型期中国经济增长成果，在控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	本基金在封闭期内的业绩比较基准为：三年期银行定期存款利率（税后）；本基金转换为上市开放式基金（LOF）后的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*70%+中国债券总指数收益率*30%。
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号31层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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，证券时报
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	2014 年 9 月 19 日(基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	917,604,010.10	90,260,033.72
本期利润	1,143,025,561.18	203,537,110.83
加权平均基金份额本期利润	0.7099	0.1264
本期加权平均净值利润率	46.51%	12.28%
本期基金份额净值增长率	65.64%	12.60%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	925,745,848.34	90,260,033.72
期末可供分配基金份额利润	0.5749	0.0561
期末基金资产净值	2,874,605,188.28	1,813,697,822.58
期末基金份额净值	1.785	1.126
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	86.51%	12.60%

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1月1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	18.84%	1.41%	0.68%	0.01%	18.16%	1.40%
过去六个月	7.14%	2.17%	1.46%	0.01%	5.68%	2.16%
过去一年	65.64%	2.03%	3.33%	0.01%	62.31%	2.02%
自基金合同生效起至今	86.51%	1.85%	4.55%	0.01%	81.96%	1.84%

注: 1、本基金合同于 2014 年 9 月 19 日生效。

2、自基金合同生效日起至今指 2014 年 9 月 19 日-2015 年 12 月 31 日。

3、根据基金合同中的有关规定,本基金合同生效后三年内(含三年)为封闭期,本基金在封闭期内的业绩比较基准为: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。

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

$$benchmark_t = 100\% * [t \text{ 日三年期银行定期存款利率 (税后) } / 365]$$

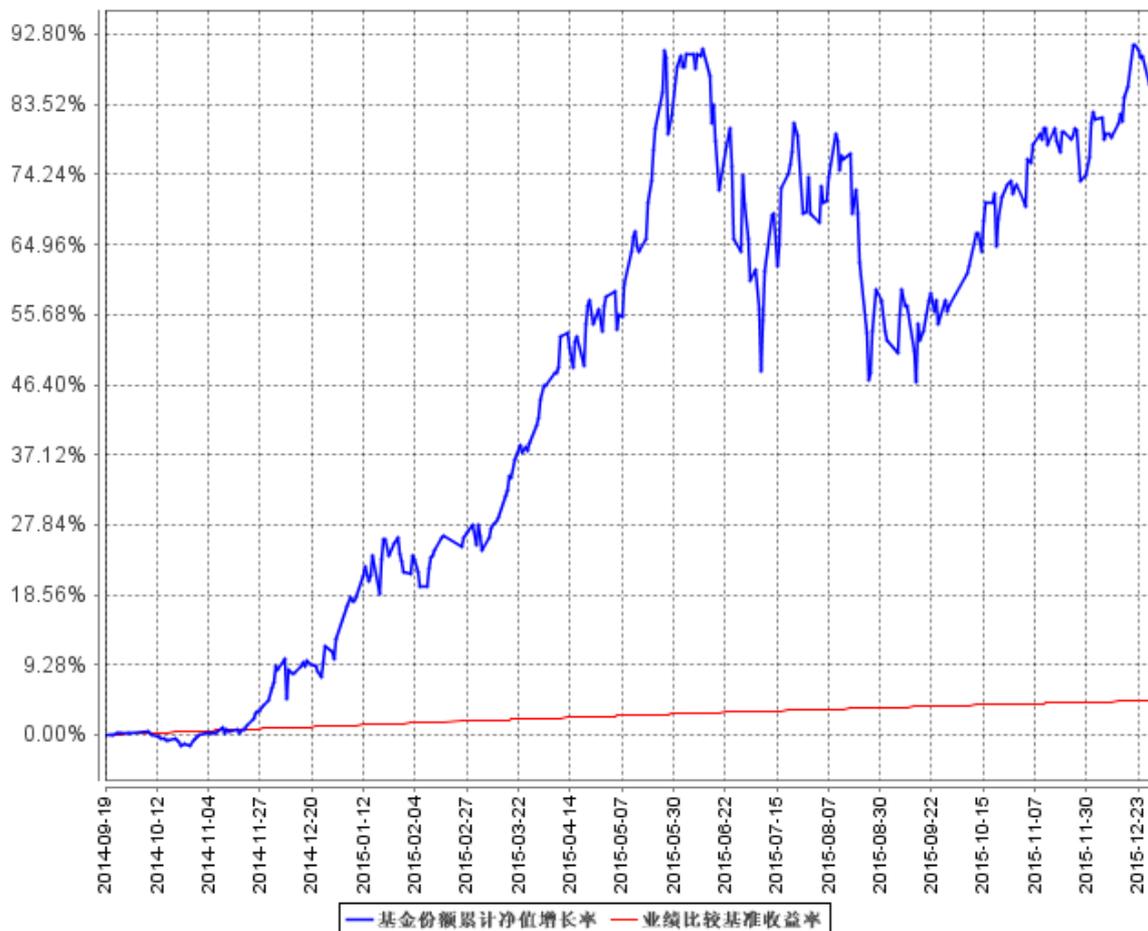
其中,  $t=1, 2, 3, \dots, T$ , T 表示时间截至日;

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。

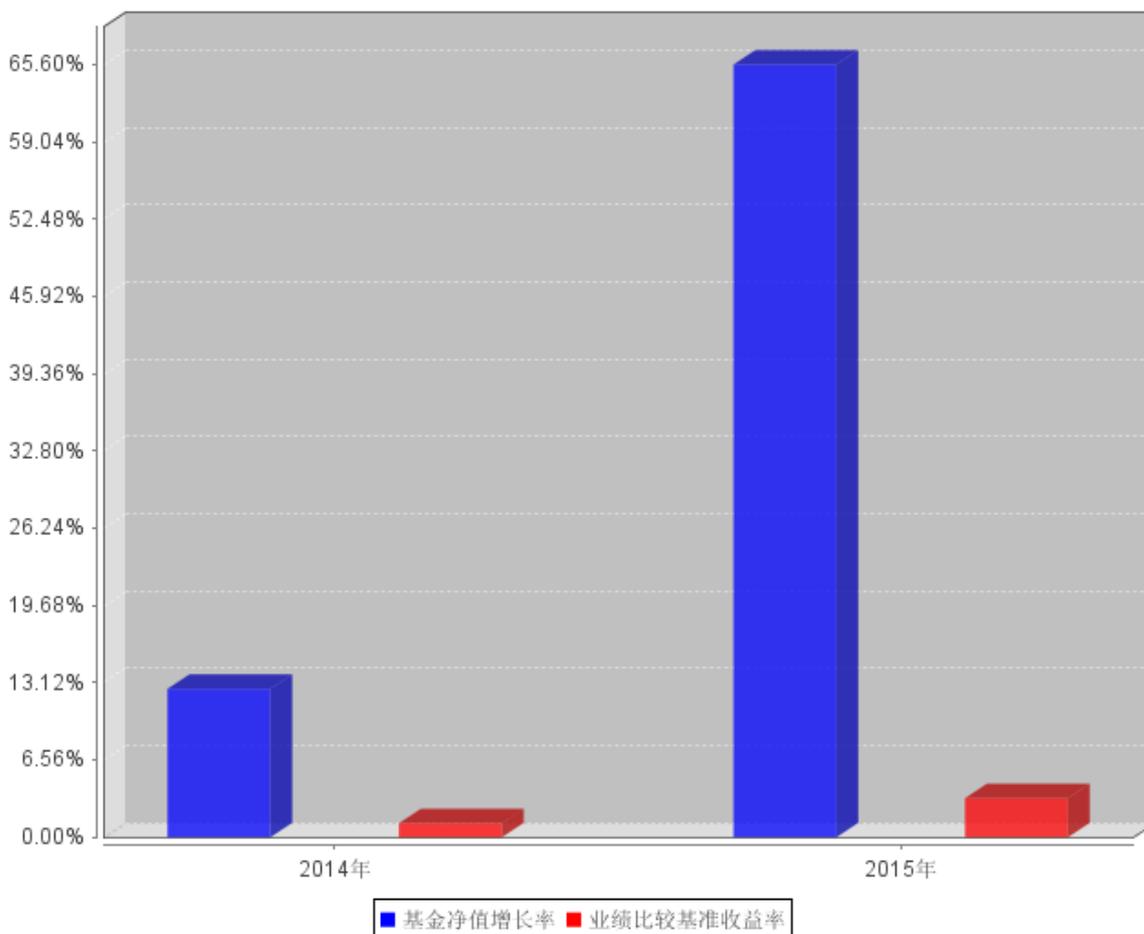
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2015 年 12 月 31 日。

2、本基金建仓期 6 个月，即从 2014 年 9 月 19 日起至 2015 年 3 月 18 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

### 3.2.3 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、本基金合同生效日为 2014 年 9 月 19 日。  
 2、合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2015	0.5100	82,118,195.48	-	82,118,195.48	
2014	-	-	-	-	
合计	0.5100	82,118,195.48	-	82,118,195.48	

注：本基金自 2014 年 9 月 19 日(基金合同生效日)至 2014 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。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、东方红收益增强债券型证券投资基金、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		
杨达治	本基金基金经理，兼任公司董事总经理、公募权益投资部总监、权益研究部总监、东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金、东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿元三年定期开	2014年9月19日	2015年12月3日	14年	硕士，曾任东方证券股份有限公司证券投资业务总部研究员；东方基金有限责任公司研究部研究员；东方证券股份有限公司资产管理业务总部投资经理；上海东方证券资产管理有限公司投资部投资经

	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、东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金基金经理				理、研究部副总监兼投资经理、执行董事；现任公司董事 总经理、公募权益投资部总监、权益研究部总监兼东方红新动力混合、东方红产业升级混合、东方红睿丰混合、东方红睿元混合、东方红中国优势混合、东方红京东大数据混合基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。
林鹏	本基金基金经理，兼东方证券股份有限公司执行董事、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	2014 年 9 月 25 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；现任上海东方证券股份有限公司执行董事兼

	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、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。				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基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。
刚登峰	本基金基金经理，兼任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、东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红优势精选灵活配置混合型	2015年5月5日	-	7年	硕士，曾任东方证券股份有限公司资产管理业务总部研究员、上海东方证券资产管理有限公司研究部高级研究员、投资经理助理，资深研究员、投资主办人；现任东方红睿丰混合、东方红睿阳混合、东方红睿元混合、

	发起式证券投资基金基金经理。			东方红策略精选混合、东方红优势精选混合基金经理。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》的相关规定等。

3、根据 2015 年 12 月 3 日《上海东方证券资产管理有限公司关于东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更的公告》，自 2015 年 12 月 3 日起，杨达治先生不再担任本基金的基金经理。

## 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》的规定。

#### 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，本基金单位净值增长率为 65.64%，同期上证指数涨幅为 11.79%，中小盘指数涨幅为 55.69%，创业板指数涨幅为 85.88%。

报告期内，实体经济表现疲软，无风险收益率持续下行，在此背景下，上半年的持续资金流入推高了市场的泡沫，下半年的监管层去杠杆，又催化了估值的迅速回归。市场情绪的波动超出我们的预计，我们仍然选择从基本面出发，与那些最优秀的公司长期相伴，来平滑系统性的风险。国内一部分优秀的龙头企业，拥有积极进取的管理层，国际竞争力不断提升，我们相信他们具有穿越经济周期的能力。

#### 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 1.785 元，份额累计净值为 1.836 元。本报告期

内，本基金净值增长率为 65.64%，业绩比较基准收益率为 3.33%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们依然谨慎看好市场的长期走势。中国股市就从全球股市的估值洼地一跃而起，但我们依然认为通过加大对优秀公司的投资力度是大概率盈利之道。即使在目前东方红睿丰混合 2015 年半年度报告前已经普遍高估的上市群体中，一部分优秀的国内龙头企业仍然拥有良好的经营成长性以及合理的股票价格，值得我们花更多的时间去研究以及长期持有。未来的世界必然是互联网的天下，我们并不认为过去做得优秀的企业一定会在互联网浪潮之下掉队，相反，由于拥有优秀且进取的管理层以及大量优质人才，我们看好这些企业利用互联网提升国际竞争力，去获取更大的市场空间。值得警惕的倒是相当一批数量的伪互联网股票，虽然喊出了豪情万丈的转型口号，但这个群体中的大多数公司只是把互联网作为炒作的题材，这与 2000 年的互联网泡沫并无二致，击鼓传花的游戏正在如火如荼的进行着，对此我们应该抱有谨慎的心态。

#### 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

本基金于 2016 年 1 月 13 日公告对 2015 年报告期内利润进行收益分配，每 10 份基金份额派发红利 5.18 元；共计派发红利 834,063,250.34 元（均为现金形式发放）。

根据基金合同规定，封闭期内，本基金的收益分配，每年不得少于一次，且每次基金收益分配比例不低于截至收益分配基准日可供分配利润的 90%。截至收益分配基准日 2015 年 12 月 31 日，本基金可供分配收益为 925,745,848.34 元。本基金本期分红已符合相关法律法规及《基金合同》约定。

#### 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

本基金自基金合同生效日起封闭三年，未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二

百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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 130197 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	东方红睿丰灵活配置混合型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丰灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“东方红睿丰”)的财务报表,包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年度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丰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》、《东方红睿丰灵活配置混合型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



交易性金融资产	7.4.7.2	2,420,582,197.95	1,674,011,787.26
其中：股票投资		2,420,582,197.95	1,556,699,482.86
基金投资		-	-
债券投资		-	117,312,304.40
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		-	1,100,758.07
应收利息	7.4.7.5	95,143.23	491,197.31
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		2,910,095,570.40	1,847,690,052.31
<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>上年度末 2014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		-	-
应付证券清算款		28,893,985.08	29,405,566.72
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,608,105.35	2,229,225.30
应付托管费		601,350.88	371,537.55
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,096,940.81	1,859,900.16
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	290,000.00	126,000.00
负债合计		35,490,382.12	33,992,229.73
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	1,610,160,711.75	1,610,160,711.75
未分配利润	7.4.7.10	1,264,444,476.53	203,537,110.83
所有者权益合计		2,874,605,188.28	1,813,697,822.58
负债和所有者权益总计		2,910,095,570.40	1,847,690,052.31

注：1. 本基金于 2014 年 9 月 19 日成立。

2. 报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.785 元，基金份额总额 1,610,160,711.75 份。

## 7.2 利润表

会计主体：东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 9 月 19 日(基 金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		1,212,308,077.25	217,244,735.65
1. 利息收入		3,213,884.37	5,753,931.68
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,681,271.71	616,588.03
债券利息收入		16,162.84	281,095.92
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		516,449.82	4,856,247.73
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		983,672,641.80	98,213,726.86
其中：股票投资收益	7.4.7.12	813,326,436.45	87,539,105.58
基金投资收益		-72,889.04	-
债券投资收益	7.4.7.13	31,184,930.11	9,996,647.88
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	111,460,440.00	-
股利收益	7.4.7.16	27,773,724.28	677,973.40
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	225,421,551.08	113,277,077.11
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	-	-
<b>减：二、费用</b>		69,282,516.07	13,707,624.82
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	36,598,356.59	7,004,674.68
2. 托管费	7.4.10.2.2	6,099,726.08	1,167,445.79
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	25,929,420.06	5,362,952.52
5. 利息支出		-	39,186.34
其中：卖出回购金融资产支出		-	39,186.34
6. 其他费用	7.4.7.20	655,013.34	133,365.49
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,143,025,561.18	203,537,110.83
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,143,025,561.18	203,537,110.83

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 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）	1,610,160,711.75	203,537,110.83	1,813,697,822.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,143,025,561.18	1,143,025,561.18
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）	-	-82,118,195.48	-82,118,195.48
五、期末所有者权益（基金净值）	1,610,160,711.75	1,264,444,476.53	2,874,605,188.28
项目	上年度可比期间 2014 年 9 月 19 日(基金合同生效日)至 2014 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）	1,610,160,711.75	-	1,610,160,711.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	203,537,110.83	203,537,110.83
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）	1,610,160,711.75	203,537,110.83	1,813,697,822.58

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

东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金(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”)《关于核准东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2014]720 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《东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2014 年 9 月 19 日生效。本基金为契约型基金,基金合同生效后三年内封闭运作,在交易所上市交易,基金合同生效满三年后转为上市开放式(LOF),存续期限不定期。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 2014 年 8 月 25 日至 2014 年 9 月 12 日向社会公开募集,扣除认购费后的有效认购资金 1,609,220,897.11 元,利息转份额 939,814.64 元,募集规模为 1,610,160,711.75 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《东方红睿丰灵活配置混合型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(含中小企业私募债)、中期票据、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、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。本基金转换为上市开放式基金(LOF)后股票资产投资比例为基金资产的 0%—95%,封闭期内股票资产投资比例为基金资产的 0%—100%;权证投资比例为基金资产净值的 0%—3%;每个交易日日终,在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%,封闭期内不受上述 5%的限制。

本基金的业绩比较基准为:本基金在封闭期内的业绩比较基准为:三年期银行定期存款利率(税后);本基金转换为上市开放式基金(LOF)后的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率\*70%+

中国债券总指数收益率\*30%。

#### 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 年度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

本基金本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致，所采用的会计估计不完全一致。

##### 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。

##### 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。

本基金以交易目的持有的股票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, 封闭期内, 本基金的收益分配, 每年不得少于一次, 且每次基金收益分配比例不低于截至收益分配基准日可供分配利润的 90%。本基金转换为上市开放式基金 (LOF) 后, 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, 且每次基金收益分配比例不低于截至收益分配基准日可供分配利润的 25%; 3、若《基金合同》生效不满 3 个月则可不进行收益分配; 4、封闭期间, 基金收益分配采用现金方式; 本基金转换为上市开放式基金 (LOF) 后, 登记在登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额, 其基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资, 投资人可选择获取现金红利或将现金红利按再投日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资, 若投资人不选择, 本基金默认的收益分配方式是现金红利; 登记在深圳证券账户的基金份额只能采取现金红利方式, 不能选择红利再投资; 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。

#### 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结果确定公允价值。

#### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

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》，自 2015 年 3 月 30 日起，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结果确定公允价值。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金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	上年度末 2014 年 12 月 31 日
活期存款	451,664,758.47	144,433,282.95
定期存款	-	-
其中:存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计:	451,664,758.47	144,433,282.95

#### 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	2,081,883,569.76	2,420,582,197.95	338,698,628.19
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,081,883,569.76	2,420,582,197.95	338,698,628.19
项目	上年度末 2014 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动

股票		1,464,911,528.51	1,556,699,482.86	91,787,954.35
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	95,823,181.64	117,312,304.40	21,489,122.76
	银行间市场	-	-	-
	合计	95,823,181.64	117,312,304.40	21,489,122.76
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,560,734,710.15	1,674,011,787.26	113,277,077.11

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均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

本基金本报告期末及上年度末均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

本基金本报告期末及上年度末均未持有任何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	上年度末 2014年12月31日
应收活期存款利息	85,196.10	31,925.81
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	9,204.08	13,511.19
应收债券利息	-	445,583.21
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	743.05	177.10
合计	95,143.23	491,197.31

### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他应收款、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	上年度末 2014 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	2,096,940.81	1,859,900.16
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	2,096,940.81	1,859,900.16

### 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	上年度末 2014 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	290,000.00	126,000.00
合计	290,000.00	126,000.00

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,610,160,711.75	1,610,160,711.75
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	1,610,160,711.75	1,610,160,711.75

注：本基金合同于 2014 年 9 月 19 日生效。

### 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
上年度末	90,260,033.72	113,277,077.11	203,537,110.83
本期利润	917,604,010.10	225,421,551.08	1,143,025,561.18
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	-82,118,195.48	-	-82,118,195.48
本期末	925,745,848.34	338,698,628.19	1,264,444,476.53

### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年9月19日(基金合同生效日)至2014年12月31日
活期存款利息收入	2,040,072.85	494,460.01
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	614,764.38	121,156.70
其他	26,434.48	971.32
合计	2,681,271.71	616,588.03

### 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1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年9月19日(基金合同生效日)至2014年12月31日
卖出股票成交总额	8,849,257,352.12	1,384,997,002.31
减：卖出股票成本总额	8,035,930,915.67	1,297,457,896.73
买卖股票差价收入	813,326,436.45	87,539,105.58

### 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1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年9月19日(基金合同生效日)至2014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	31,184,930.11	9,996,647.88
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	31,184,930.11	9,996,647.88
----	---------------	--------------

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1月1日至2015 年12月31日	上年度可比期间 2014年9月19日(基金合 同生效日)至2014年12月31 日
卖出债券(债转股及债券到期兑付) 成交总额	133,017,857.80	478,081,112.15
减：卖出债券(债转股及债券到期 兑付)成本总额	101,371,181.64	466,841,207.84
减：应收利息总额	461,746.05	1,243,256.43
买卖债券差价收入	31,184,930.11	9,996,647.88

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期及上年度可比期间均无赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期及上年度可比期间均无申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期及上年度可比期间均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

本基金在本报告期及上年度可比期间均未进行贵金属投资。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金在本报告期及上年度可比期间均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

本基金在本报告期及上年度可比期间均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

本基金在本报告期及上年度可比期间均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

本基金在本报告期及上年度可比期间均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

单位：人民币元

项目	本期收益金额	上年度可比期间收益金额
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年9月19日(基金合同生效日)至2014年12月31日
股指期货-投资收益	111,460,440.00	-

### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年9月19日(基金合同生效日)至2014年12月31日
股票投资产生的股利收益	27,773,724.28	677,973.40
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	27,773,724.28	677,973.40

### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年9月19日(基金合同生效日)至2014年12月31日
1. 交易性金融资产	225,421,551.08	113,277,077.11
——股票投资	246,910,673.84	91,787,954.35
——债券投资	-21,489,122.76	21,489,122.76
——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	225,421,551.08	113,277,077.11

### 7.4.7.18 其他收入

本基金在本报告期及上年度可比期间均无基金赎回费、转出补偿费等其他收入。

### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 9 月 19 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	25,929,420.06	5,362,952.52
银行间市场交易费用	-	-
合计	25,929,420.06	5,362,952.52

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 9 月 19 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
审计费用	90,000.00	60,000.00
信息披露费	200,000.00	66,000.00
上市年费	80,000.00	-
银行费用	22,118.76	6,465.49
帐户维护费	16,500.00	900.00
其他	246,394.58	-
合计	655,013.34	133,365.49

#### 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

截至本报告期末,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

本基金的基金管理人于 2016 年 1 月 13 日宣告 2015 年度分红,向截至 2015 年 12 月 31 日止在中国证券登记结算有限责任公司登记在册的全体持有人,按每 10 份基金份额派发红利 5.18 元,共计派发红利 834,063,250.34 元(均为现金红利发放形式)。

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	管理人、基金直销机构
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	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

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1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年9月19日(基金合同生效日)至2014年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
东方证券	14,894,442,563.10	85.34%	3,875,775,558.20	100.00%

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1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年9月19日(基金合同生效日)至2014年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
东方证券	133,017,857.80	100.00%	806,831,826.90	100.00%

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1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年9月19日(基金合同生效日)至2014年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
东方证券	2,283,000,000.00	100.00%	15,596,100,000.00	100.00%

7.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年9月19日(基金合同生效日)至2014年12月31日	
	成交金额	占当期基金成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东方证券	7,223,110.96	100.00%	0	0%

### 7.4.10.1.5 权证交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 7.4.10.1.6 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1月1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	13,275,203.48	88.06%	1,039,697.71	49.58%
关联方名称	上年度可比期间 2014年9月19日(基金合同生效日)至2014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	3,528,507.88	100.00%	1,859,900.16	100.00%

注：1. 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。

2. 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的资格；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的资格，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1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年9月19日.2至2014年12 月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	36,598,356.59
其中：支付销售机构的客户维护费	17,831,491.30	3,458,099.13

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。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 9 月 19 日 (基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	6,099,726.08	1,167,445.79

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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。

### 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

本基金在本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 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

本基金在本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

#### 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

本报告期末及上年度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		上年度可比期间	
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		2014 年 9 月 19 日 (基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	451,664,758.47	2,040,072.85	144,433,282.95	494,460.01

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。

### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

### 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

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分 配 合计	备注
		场内	场外					
1	2015 年 1 月 20 日	2015 年 1 月 21 日	2015 年 1 月 20 日	0.5100	82,118,195.48	-	82,118,195.48	
合计	-	-		0.5100	82,118,195.48	-	82,118,195.48	

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
002073	软控 股份	2015 年 7 月 14 日	2018 年 7 月 16 日	新股流 通受限	8.77	10.05	5,388,369	47,256,000.00	54,153,108.45	-

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	-	-	7,314,146	100,848,872.92	178,684,586.78	-
600271	航 天 信 息	2015 年 10 月 12 日	重大事 项停牌	71.46	-	-	1,807,427	64,601,129.19	129,158,733.42	-
600690	青 岛 海 尔	2015 年 10 月 19 日	重大事 项停牌	9.92	2016 年 2 月 1 日	8.93	10,441	126,417.90	103,574.72	-

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，本基金无因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。

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，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 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人員负责，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

本基金在本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

##### 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	上年度末 2014 年 12 月 31 日
AAA	-	117,312,304.40
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	117,312,304.40

注：本基金在本报告期末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

### 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	451,664,758.47	-	-	-	-	-	451,664,758.47
结算备付金	36,252,358.46	-	-	-	-	-	36,252,358.46
存出保证金	1,501,112.29	-	-	-	-	-	1,501,112.29
交易性金融资产	-	-	-	-	-	2,420,582,197.95	2,420,582,197.95
应收利息	-	-	-	-	-	95,143.23	95,143.23
资产总计	489,418,229.22	-	-	-	-	2,420,677,341.18	2,910,095,570.40

负债							
应付证券清算款						28,893,985.08	28,893,985.08
应付管理人报酬						3,608,105.35	3,608,105.35
应付托管费						601,350.88	601,350.88
应付交易费用						2,096,940.81	2,096,940.81
其他负债						290,000.00	290,000.00
负债总计						35,490,382.12	35,490,382.12
利率敏感度缺口	489,418,229.22					-2,385,186,959.06	2,874,605,188.28
上年度末 2014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	144,433,282.95						144,433,282.95
结算备付金	27,295,265.40						27,295,265.40
存出保证金	357,761.32						357,761.32
交易性金融资产				117,312,304.40		1,556,699,482.86	1,674,011,787.26
应收证券清算款						1,100,758.07	1,100,758.07
应收利息						491,197.31	491,197.31
资产总计	172,086,309.67			117,312,304.40		1,558,291,438.24	1,847,690,052.31
负债							
应付证券清算款						29,405,566.72	29,405,566.72
应付管理人报酬						2,229,225.30	2,229,225.30
应付托管费						371,537.55	371,537.55
应付交易费用						1,859,900.16	1,859,900.16
其他负债						126,000.00	126,000.00
负债总计						33,992,229.73	33,992,229.73
利率敏感度缺口	172,086,309.67			117,312,304.40		-1,524,299,208.51	1,813,697,822.58

注：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。

#### 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）	上年度末（2014年12月31日）
	上升 0.25%		-569,492.58
	下降 0.25%		569,492.58

注：于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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的股票整体涨跌趋势的影响，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		上年度末 2014年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	2,420,582,197.95	84.21	1,556,699,482.86	85.83
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	117,312,304.40	6.47
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	2,420,582,197.95	84.21	1,674,011,787.26	92.30

注：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（含中小企业私募债）、中期票据、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、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）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	上升 5%	96,299,273.81	60,758,877.06
	下降 5%	-96,299,273.81	-60,758,877.06

注：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）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	1 天	83,363,550.46	19,406,566.71
	1 周	186,406,565.67	43,166,008.19

#### 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 2,058,482,194.58 元, 第二层次的余额为 362,100,003.37 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, 确定相关股票和债券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), 本基金于 2015 年 3 月 30 日起改为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从第一层次调整至第二层次。

(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	2,420,582,197.95	83.18
	其中: 股票	2,420,582,197.95	83.18
2	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	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	487,917,116.93	16.77
7	其他各项资产	1,596,255.52	0.05
8	合计	2,910,095,570.40	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	18,799,140.00	0.65
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,895,126,061.06	65.93
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	61,071,288.12	2.12
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	514,256.73	0.02
J	金融业	224,251,823.05	7.80
K	房地产业	178,684,586.78	6.22
L	租赁和商务服务业	42,025,650.00	1.46
M	科学研究和技术服务业	109,392.21	0.00
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	2,420,582,197.95	84.21

### 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	8,237,111	283,274,247.29	9.85
2	600276	恒瑞医药	4,480,826	220,098,173.12	7.66
3	600066	宇通客车	9,260,524	208,269,184.76	7.25
4	000651	格力电器	9,097,984	203,339,942.40	7.07
5	000002	万科A	7,314,146	178,684,586.78	6.22
6	002475	立讯精密	4,720,354	150,815,310.30	5.25
7	600271	航天信息	1,807,427	129,158,733.42	4.49
8	601318	中国平安	3,532,072	127,154,592.00	4.42
9	600309	万华化学	6,292,174	112,315,305.90	3.91
10	000538	云南白药	1,416,170	102,842,265.40	3.58
11	601169	北京银行	9,220,939	97,096,487.67	3.38
12	600660	福耀玻璃	6,236,781	94,736,703.39	3.30
13	600557	康缘药业	3,100,596	77,576,911.92	2.70
14	600196	复星医药	2,824,818	66,354,974.82	2.31
15	000889	茂业通信	3,845,799	61,071,288.12	2.12
16	000858	五粮液	2,106,300	57,459,864.00	2.00
17	002073	软控股份	5,388,369	54,153,108.45	1.88
18	002400	省广股份	1,671,000	42,025,650.00	1.46
19	000915	山大华特	1,089,938	38,322,220.08	1.33
20	002311	海大集团	2,293,745	32,043,617.65	1.11
21	000860	顺鑫农业	1,030,361	21,946,689.30	0.76
22	300146	汤臣倍健	564,331	21,726,743.50	0.76
23	002701	奥瑞金	701,500	19,824,390.00	0.69
24	300498	温氏股份	411,000	18,799,140.00	0.65
25	603936	博敏电子	12,448	638,333.44	0.02
26	300496	中科创达	3,673	514,256.73	0.02
27	300228	富瑞特装	4,031	125,767.20	0.00
28	300492	山鼎设计	6,219	109,392.21	0.00
29	600690	青岛海尔	10,441	103,574.72	0.00
30	000001	平安银行	62	743.38	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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	862,954,913.65	47.58
2	000002	万科A	525,589,563.04	28.98
3	601169	北京银行	399,788,299.14	22.04
4	000651	格力电器	351,981,456.10	19.41
5	000001	平安银行	291,426,102.76	16.07
6	600309	万华化学	269,384,804.24	14.85
7	300017	网宿科技	266,870,993.11	14.71
8	600196	复星医药	235,826,692.39	13.00
9	601988	中国银行	228,985,822.39	12.63
10	600690	青岛海尔	220,655,149.09	12.17
11	600019	宝钢股份	217,186,405.70	11.97
12	002475	立讯精密	212,120,157.93	11.70
13	000858	五粮液	203,604,913.93	11.23
14	002415	海康威视	200,720,632.80	11.07
15	000848	承德露露	200,386,895.55	11.05
16	601336	新华保险	192,605,910.73	10.62
17	600276	恒瑞医药	170,553,406.43	9.40
18	600060	海信电器	153,158,830.48	8.44
19	600066	宇通客车	130,075,082.41	7.17
20	000538	云南白药	126,061,058.85	6.95
21	002292	奥飞动漫	120,637,725.65	6.65
22	601398	工商银行	115,930,183.08	6.39
23	002304	洋河股份	104,148,554.47	5.74
24	600557	康缘药业	102,047,629.64	5.63
25	300186	大华农	98,398,856.63	5.43
26	600660	福耀玻璃	89,590,121.44	4.94
27	002701	奥瑞金	81,928,321.76	4.52
28	600352	浙江龙盛	79,104,186.00	4.36
29	600030	中信证券	71,403,917.38	3.94
30	000889	茂业通信	71,090,006.56	3.92
31	601818	光大银行	68,240,358.83	3.76

32	000915	山大华特	67,859,787.50	3.74
33	600887	伊利股份	64,804,198.77	3.57
34	600535	天士力	62,896,999.58	3.47
35	601628	中国人寿	61,589,407.59	3.40
36	002594	比亚迪	61,224,682.77	3.38
37	300228	富瑞特装	60,166,763.17	3.32
38	600804	鹏博士	53,144,132.60	2.93
39	601009	南京银行	53,017,794.01	2.92
40	002572	索菲亚	52,879,678.43	2.92
41	601989	中国重工	52,866,087.00	2.91
42	002400	省广股份	52,716,567.49	2.91
43	000100	TCL 集团	52,384,958.86	2.89
44	601058	赛轮金宇	48,714,064.93	2.69
45	601021	春秋航空	48,704,537.09	2.69
46	603898	好莱客	48,675,241.85	2.68
47	002153	石基信息	48,065,110.13	2.65
48	600267	海正药业	47,846,970.00	2.64
49	002073	软控股份	47,256,000.00	2.61
50	002250	联化科技	46,196,792.43	2.55
51	600271	航天信息	45,518,615.99	2.51
52	603899	晨光文具	44,629,322.00	2.46
53	002550	千红制药	42,665,275.98	2.35
54	300498	温氏股份	41,867,290.64	2.31
55	600519	贵州茅台	40,756,216.64	2.25
56	600703	三安光电	40,596,754.51	2.24
57	002311	海大集团	40,054,802.89	2.21
58	002410	广联达	39,563,598.70	2.18

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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	930,947,733.17	51.33
2	000002	万科A	460,277,825.81	25.38

3	600690	青岛海尔	412,836,961.56	22.76
4	300017	网宿科技	329,143,072.60	18.15
5	600019	宝钢股份	303,859,425.73	16.75
6	000001	平安银行	295,389,946.71	16.29
7	601169	北京银行	290,397,927.54	16.01
8	600196	复星医药	276,320,564.34	15.24
9	000651	格力电器	252,041,921.80	13.90
10	601988	中国银行	224,821,304.61	12.40
11	000848	承德露露	212,765,731.00	11.73
12	600271	航天信息	203,023,666.29	11.19
13	002415	海康威视	192,780,839.11	10.63
14	601336	新华保险	173,770,759.27	9.58
15	002292	奥飞动漫	164,955,109.71	9.09
16	600060	海信电器	160,454,658.99	8.85
17	000858	五粮液	132,281,456.12	7.29
18	002475	立讯精密	131,618,007.24	7.26
19	600309	万华化学	120,866,311.61	6.66
20	601398	工商银行	113,257,804.74	6.24
21	601058	赛轮金宇	113,132,265.22	6.24
22	600352	浙江龙盛	96,158,536.73	5.30
23	300186	大华农	96,135,886.08	5.30
24	603288	海天味业	92,843,380.29	5.12
25	002304	洋河股份	92,218,824.09	5.08
26	002311	海大集团	89,436,474.08	4.93
27	002202	金风科技	87,186,003.63	4.81
28	600016	民生银行	85,505,824.93	4.71
29	300228	富瑞特装	83,931,625.73	4.63
30	600030	中信证券	81,350,523.18	4.49
31	600066	宇通客车	78,211,071.48	4.31
32	601818	光大银行	70,120,708.20	3.87
33	601021	春秋航空	69,343,155.46	3.82
34	600887	伊利股份	66,423,111.08	3.66
35	002594	比亚迪	65,454,509.37	3.61
36	600535	天士力	63,751,794.68	3.52
37	603898	好莱客	63,493,257.74	3.50
38	002572	索菲亚	63,437,535.94	3.50
39	002550	千红制药	63,273,276.43	3.49
40	601628	中国人寿	62,038,888.16	3.42

41	000550	江铃汽车	61,525,826.66	3.39
42	002159	三特索道	61,401,356.26	3.39
43	002701	奥瑞金	61,016,101.77	3.36
44	603899	晨光文具	58,856,528.20	3.25
45	600276	恒瑞医药	56,794,345.30	3.13
46	600804	鹏博士	54,358,592.92	3.00
47	002153	石基信息	53,397,545.16	2.94
48	601989	中国重工	51,933,247.68	2.86
49	601328	交通银行	51,607,484.99	2.85
50	601009	南京银行	51,596,746.71	2.84
51	600183	生益科技	50,171,327.64	2.77
52	000100	TCL 集团	49,870,658.00	2.75
53	002410	广联达	43,470,751.22	2.40
54	600267	海正药业	42,075,683.17	2.32
55	002250	联化科技	41,404,779.66	2.28
56	600703	三安光电	40,971,382.93	2.26
57	600519	贵州茅台	40,566,387.56	2.24
58	600077	宋都股份	37,129,058.55	2.05

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	8,603,834,181.34
卖出股票收入（成交）总额	8,849,257,352.12

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

本基金本报告期末未持有债券。

### 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

本基金本报告期末未持有债券。

### 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进行贵金属投资。

## 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进行权证投资。

## 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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					111,460,440.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-

注：本基金本报告期末无股指期货持仓。

### 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。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	1,501,112.29
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	95,143.23
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,596,255.52

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000002	万科A	178,684,586.78	6.22	重大事项停牌
2	600271	航天信息	129,158,733.42	4.49	重大事项停牌

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 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
10,553	152,578.48	27,832,496.72	1.73%	1,582,328,215.03	98.27%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额 比例
1	中国通用技术 (集团) 控股	10,685,830.00	13.77%

	有限责任公司		
2	泰康人寿保险股份有限公司 — 万能一个险万能（乙）	9,368,256.00	12.07%
3	常德华	4,929,708.00	6.35%
4	泰康人寿保险股份有限公司 — 传统—普通保险产品 -019L-CT001	2,539,781.00	3.27%
5	孟莹	2,478,840.00	3.19%
6	周昭玲	1,975,556.00	2.55%
7	徐勇群	1,085,100.00	1.40%
8	东野尚丽	1,000,145.00	1.29%
9	郑光辉	1,000,116.00	1.29%
10	吉烈钧	1,000,000.00	1.29%

### 9.3 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	1,604,749.38	0.0997%

### 9.4 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、基金投资和研 究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	50~100

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年9月19日）基金份额总额	1,610,160,711.75
本报告期期初基金份额总额	1,610,160,711.75
本报告期基金总申购份额	-
减:本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	1,610,160,711.75

注：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（2014 年 9 月 19 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 9 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	3	14,894,442,563.10	85.34%	13,275,203.48	88.06%	-
广发证券	1	2,176,717,746.36	12.47%	1,527,952.25	10.14%	-
长江证券	1	301,553,315.01	1.73%	214,494.81	1.42%	-
申万宏源	1	80,377,908.99	0.46%	57,173.00	0.38%	-

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、本基金本报告期内租用交易单元的变更情况：新增长江证券、申万宏源、广发证券、东方证券 4 个交易单元。

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的资格；本公司已在深证交易所获得租用券商交易单元的资格，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		基金交易		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	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	133,017,857.80	100.00%	2,283,000,000.00	100.00%	7,223,110.96	100.00%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-

## 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	东方证券资产管理有限公司旗下基金 2014 年 12 月 31 日基金资产净值和基金份额净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015 年 1 月 5 日
2	东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金 2014 年年度分红公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 1 月 15 日
3	东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金 2014 年第 4 季度报告	中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 1 月 21 日
4	东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金上市交易公告书	中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 3 月 3 日
5	关于东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金投资者办理跨系统转托管业务的公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 3 月 3 日
6	东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金基金份额上市交易提示性公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 3 月 6 日
7	东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金 2014 年年度报告-摘要	中国证券报、公司网站	2015 年 3 月 28 日
8	东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金 2014 年年度报告-正文	公司网站	2015 年 3 月 28 日
9	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015 年 3 月 31 日
10	东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金 2015 年第 1 季度报告	中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 4 月 20 日
11	东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新正文（2015 年第 1 号）	公司网站	2015 年 5 月 4 日

12	东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新摘要（2015 年第 1 号）	中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 5 月 4 日
13	上海东方证券资产管理有限公司关于增聘东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理的公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 5 月 5 日
14	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加上海天天基金销售有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015 年 5 月 8 日
15	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	上海证券报、中国证券报、公司网站	2015 年 5 月 22 日
16	上海东方证券资产管理有限公司关于调整旗下基金最低持有份额限制公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015 年 5 月 22 日
17	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、证券日报、公司网站	2015 年 6 月 30 日
18	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、证券日报、公司网站	2015 年 7 月 1 日
19	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
20	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
21	上海东方证券资产管理有限公司	中国证券报、上海证	2015 年 7 月 13 日

	关于新增网上直销系统支持银行卡的提示公告	券报、证券时报、公司网站	
22	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 7 月 14 日
23	上海东方证券资产管理有限公司关于东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金 2015 年第 2 季度报告	中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 7 月 21 日
24	上海东方证券资产管理有限公司关于东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金 2015 年第 2 季度报告的更正公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 7 月 22 日
25	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 7 月 24 日
26	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、证券日报、公司网站	2015 年 8 月 18 日
27	东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金 2015 年半年度报告(摘要)	中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 8 月 27 日
28	东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金 2015 年半年度报告(正文)	公司网站	2015 年 8 月 27 日
29	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 10 月 16 日
30	东方红睿丰灵活配置混合型证券	中国证券报、证券时	2015 年 10 月 26 日

	投资基金 2015 年第 3 季度报告	报、公司网站	
31	东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新摘要（2015 年第 2 号）	中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 10 月 31 日
32	东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新（2015 年第 2 号）	公司网站	2015 年 10 月 31 日
33	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
34	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
35	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
36	上海东方证券资产管理有限公司关于东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更的公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 12 月 3 日
37	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
38	上海东方证券资产管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015 年 12 月 31 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丰灵活配置混合型证券投资基金的文件；
- 2、《东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、东方红睿丰灵活配置混合型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](http://www.dfham.com)。

上海东方证券资产管理有限公司  
2016 年 3 月 26 日