东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金

【2015】年度报告摘要

基金管理人:上海东方证券资产管理有限公司
基金托管人: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

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。
本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。
本报告期自 2015 年 1月 1日起至 12月 31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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
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,目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的成果,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

2.4 信息披露方式

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

§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

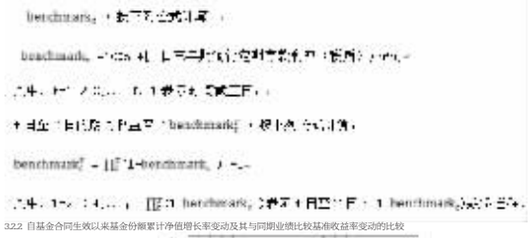
金额单位:人民币元

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

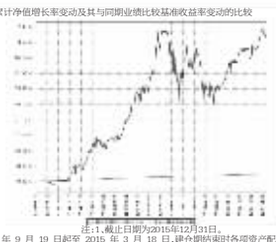
注:1.表中的"期末"均指报告期最后一日,即12月31日。"本期"指2015年1月1日-2015年12月31日。
2.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
3.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.2 基金净值表现
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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%

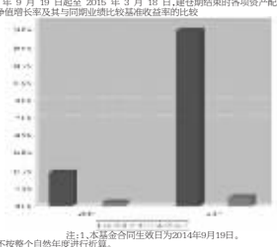
注:1.本基金合同于2014年9月19日生效。
2.自基金合同生效日起至今按2014年9月19日-2015年12月31日。
3.根据基金合同中的有关规定,本基金合同生效后三年内(含三年)为封闭期,本基金在封闭期内的业绩比较基准为:三年期银行定期存款利率(税后),其中,三年期银行定期存款利率是指中国人民银行公布并执行的金融机构三年期人民币存款基准利率。



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,因从 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的定。
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.合同生效当年按照实际存续期计算,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启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证券投资基金、东方红睿鑫优选混合型证券投资基金、东方红睿盛定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红顺鑫精选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、东方红优势精选灵活配置混合型证券投资基金、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		
杨论治	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、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	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、兼东方证券资产管理有限公司执行董事、公募权益投资部总监、东方红睿丰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基金经理。	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发起式证券投资基金基金经理。	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、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31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遵规守信情况的说明
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、投权、交易执行、组合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,对无联方申购、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,非经特别授权制度审核同意,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,分析对象涵盖分券、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,合规与风险管理部根据相关法规要求,与相关人员进行沟通解释,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11.70%,中小盘指数涨幅为56.69%,创业板指数涨幅为85.98%。
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估值,下半年的监管层去杠杆,又催化了估值的迅速回归。市场情绪的波动起出我们的预期,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。从国内一部分优秀的龙头企业,拥有长期进取的管理层,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
我们依然遵循我们长期以来的投资理念: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的盈利之道。回顾在目东方红睿丰混合 2015 年半年报我们已经背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传统人才,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,虽然喊出了蓝情万丈的转型口号,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、行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背景,具有基金从业资格。同时,公司设价值决策小组,成员包括:公司总经理、合规总监(替授权)、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问题与讨论,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。
4.7 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926,745,848.34元。本基金本期分红已符合相关法律法规及《基金合同》约定。
4.8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、证券投资基金托管协议等有关规定所赋予的义务。
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

本报告期基金财务报告经立信会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师王斌、唐成签字出具了信会师报字[2016]第130197号标准无保留意见的审计报告。
投资者可通过本基金年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1资产负债表
会计主体:东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金
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	上年度末 2014年12月31日
资 产:			
银行存款		451,664,758.47	144,433,282.95
结算备付金		36,252,358.46	27,296,265.40
存出保证金		1,501,112.29	357,761.32
交易性金融资产		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		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	1,100,758.07
应收利息		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		-	-
资产总计		2,910,095,570.40	1,847,690,052.31
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
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		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		290,000.00	126,000.00
负债合计		35,490,382.12	33,992,229.73
所有者权益:			
实收基金		1,610,160,711.75	1,610,160,711.75
未分配利润		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
一、收入		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		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		813,326,436.45	87,539,105.58
基金投资收益		-72,889.04	-
债券投资收益		31,184,930.11	9,996,647.88
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		111,460,440.00	-
股利收益		27,773,724.28	677,973.40
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		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)		-	-
减:二、费用		69,282,516.07	13,707,624.82
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	36,598,356.59	7,004,674.68
2. 托管费	7.4.8.2.2	6,099,726.08	1,167,445.79
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		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		655,013.34	133,365.49
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		1,143,025,561.18	203,537,110.83
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		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(本期净利润)	-	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(本期净利润)	-	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 詹明
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发售,《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(包括沪深A股、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80%-95%,封闭期内股票资产投资比例为基金资产的80%-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>估值业务及会计核算有关事项的通知》、《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)》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本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
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。
7.4.5 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
本基金报告期无需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。
(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;持有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 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。
7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

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%

7.4.8.1.2 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%

7.4.8.1.3 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	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	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%

7.4.8.1.4 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%

7.4.8.1.5 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。
7.4.8.1.6 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,其除证券公司席位租用费(包括但不限于交易单元席位租用费、证券结算风险基金和上海证券交易所交易结算费等)。管理人民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.本公司同时为证券公司子公司向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。
7.4.8.2 关联方报酬
7.4.8.2.1 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(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管理费