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

东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金

2015 年度报告摘要

§1 重要提示

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6月3日(基金合同生效日)起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	东方红睿逸定期开放混合
基金主代码	001309
前端交易代码	001309
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

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

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。

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%

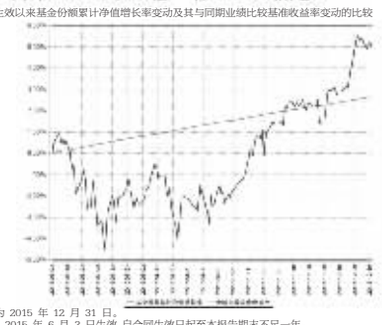
注:1、本基金合同于2015年6月3日生效。

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期相结合的方式运作,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%。

[illegible]

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

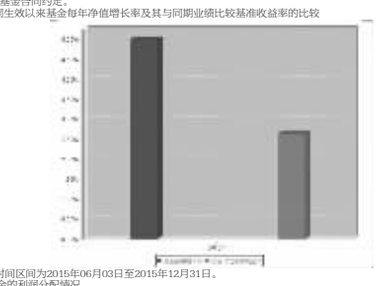


注:(1)截止日期为 2015 年 12 月 31 日。

(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 至 2015 年 12 与 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3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、东方红稳健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、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。	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。
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、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。	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、东方红信用债债券型证券投资基金基金经理。

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聘解日期;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 公平交易制度和执行情况

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,开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)的乘离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,分析对象融资公募、集合发定向产品,并重点分析同类资产(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,并按法规要求上报证监管机构。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;另一方面精选基等个股进行配置。

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投性企稳的情况,另一方面汇率等因素导致货币政策面临两难、全面宽松不断落后。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,且不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,更青睐低付值高分红、经营稳定的个股。

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、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可交易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

本基金本报告期未进行利润分配。

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。

4.8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

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130204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
资 产:		
银行存款		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		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		-
买入返售金融资产		-
应收证券清算款		-
应收利息		13,105,117.27
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		1,416,706,456.91
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015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		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		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		180,000.00
负债合计		309,444,605.82
所有者权益:		
实收基金		1,054,594,202.29
未分配利润		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
一、收入		69,247,297.01
1.利息收入		21,368,019.48
其中:存款利息收入		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		7,684,013.20
基金投资收益		-
债券投资收益		11,092,107.27
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		1,426,246.69
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		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)		10,535.94
减:二、费用		16,579,648.21
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	9,127,712.64
2. 托管费	7.4.8.2.2	1,217,028.40
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-
4. 交易费用		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		214,760.68
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		52,667,648.80
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		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(本期净利润)	-	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6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模板说明》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。

7.4.5.1 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 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。

7.4.8 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。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 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,无上年度可期对比数据。

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,无上年度可期对比数据。

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,无上年度可期对比数据。

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 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,无上年度可期对比数据。

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	9,127,712.64
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×1.5%÷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。

7.4.8.2.2 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×0.2%÷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,无上年度可期对比数据。

7.4.8.2 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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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。

7.4.8.4.2 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

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

7.4.8.5 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,按银行间业利率计息。

2.本基金合同生效日为2015年6月3日,无上年度可期对比数据。

7.4.8.6 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。

7.4.9 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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

7.4.10.1.1 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	-

7.4.10.1.2 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