前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金

【2015】年度报告摘要

基金管理人:前海开源基金管理有限公司
基金托管人:广发证券股份有限公司
送出日期:2016年3月30日

§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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。
基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月25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。
本报告中的财务资料已经审计。瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。
本报告期自2015年1月14日(基金合同生效日)起至12月31日止。
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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	前海开源睿远稳健增利混合	
基金主代码	000932	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年1月14日	
基金管理人	前海开源基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	170,060,753.27份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	前海开源睿远稳健增利混合A	前海开源睿远稳健增利混合C
下属分级基金的交易代码:	000932	000933
报告期末下属分级基金的份额总额	8,815,726.42份	161,245,026.85份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于债券和现金类资产,力争在严格控制风险和保持基金资产流动性的前提下,实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金的投资策略主要有以下六方面内容: 1、大类资产配置 在大类资产配置中,本基金综合运用定性和定量的分析手段,在对宏观经济因素进行充分研究的基础上,判断宏观经济周期所处阶段。本基金将依据经济周期周转,结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估,制定本基金在债券、股票、现金等大类资产之间的配置比例。 2、债券投资策略 在债券投资策略方面,本基金将在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理,采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资。 3、股票投资策略 本基金精选有良好增值潜力的股票构建股票投资组合。股票投资策略将从定性和定量两方面入手,定性方面主要考察上市公司所属行业发展前景、行业地位、竞争优势、管理团队、创新能力等多种因素;定量方面考量公司估值、资产质量及财务状况,比较分析各优质上市公司的价值,成长及财务指标,优先选择具有相对比较优势的公司作为最终股票投资对象。 4、可转债策略 基于行业分析、企业基本面分析和可转换债券估值模型分析,并结合市场环境情况等,本基金在一、二级市场投资可转换债券,以达到在严格控制风险的基础上,实现基金资产稳健增值的目的。可转债的策略具体包括:1)个券选择策略,2)转股策略,3)条款博弈策略,4)套利策略。 5、权证投资策略 本基金将权证的投资作为提高基金投资组合收益的辅助手段。根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值,发现市场对股票权证的非理性定价;利用权证衍生工具的特性,通过权证与证券的组合投资,来达到改善组合风险收益特征的目的。 6、股指期货投资策略 本基金以套期保值为目的,参与股指期货交易。 本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素,结合定性和定量方法,确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模,以及中国证监会的相关限定和要求,确定参与股指期货交易的投资比例。 若相关法律法规发生变化时,基金管理人期货投资管理从其最新规定,以符合上述法律法规和监管要求的变化。
业绩比较基准	中证全债指数收益率×85%+沪深300指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于中高风险收益的投资品种,其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金,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		前海开源基金管理有限公司	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	傅成斌	王玮
	联系电话	0755-83601888	020-87555888-6052
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com	wwei@gf.com.cn
客户服务电话		4001666998	95575
传真		0755-83181169	020-87555129

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.qhkyfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

§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1月14日(基金合同生效日)-2015年12月31日	
	前海开源睿远稳健增利混合A	前海开源睿远稳健增利混合C
本期已实现收益	2,366,339.44	25,934,996.04
本期利润	3,407,109.46	26,984,901.24
加权平均基金份额本期利润	0.1708	0.0494
本期基金份额净值增长率	16.50%	15.00%
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	0.0631	0.0494
期末基金资产净值	10,268,425.52	185,453,622.73
期末基金份额净值	1.165	1.150

注:① 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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
② 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 期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分期末余额的孰低数。表中的"期末"均指报告期最后一个自然日,无论该日是否为开放日或交易所的交易日。
④ 本基金的基金合同于2015年1月4日生效,截止2015年12月31日,本基金成立未满1年。

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

前海开源睿远稳健增利混合A

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	6.68%	0.40%	4.82%	0.25%	1.86%	0.15%
过去六个月	6.39%	0.60%	2.35%	0.40%	4.04%	0.20%
自基金合同生效起至今	16.50%	0.59%	9.04%	0.38%	7.46%	0.21%

前海开源睿远稳健增利混合C

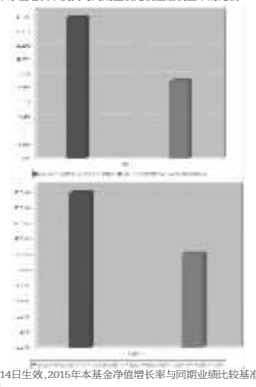
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.38%	0.40%	4.82%	0.25%	1.56%	0.15%
过去六个月	5.89%	0.60%	2.35%	0.40%	3.54%	0.20%
自基金合同生效起至今	15.00%	0.59%	9.04%	0.38%	5.96%	0.21%

注:本基金的业绩比较准为:中证全债指数收益率×85%+沪深300指数收益率×15%。

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本基金的基金合同于2015年1月14日生效,截至2015年12月31日止,本基金成立未满1年。
②本基金的建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同规定。截至2015年12月31日止,本基金建仓期结束未满1年。

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:本基金的基金合同于2015年1月14日生效,2015年本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按本基金实际存续期计算;截止2015年12月31 日,本基金成立未满1 年。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

前海开源睿远稳健增利混合A						
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	0.0000	0.00	0.00	0.00		
合计	0.0000	0.00	0.00	0.00		

单位:人民币元

前海开源睿远稳健增利混合C					
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	0.0000	0.00	0.00	0.00	
合计	0.0000	0.00	-	0.00	

注:本基金的基金合同于2015年1月14日生效,截止2015年12月31日,本基金成立未满三年。

§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

前海开源基金管理有限公司(以下简称"前海开源基金")于2012年12月27日经中国证监会批准,2013年1月23日注册成立,截至报告期末,注册资本为2亿元人民币。其中,开源证券股份有限公司、北京市中盛金期投资管理有限公司、北京长和世纪资产管理有限公司和深圳市和合投信资产管理合伙企业(有限合伙)各持股权25%。目前,前海开源基金分别在北京、上海设立分公司,在深圳设立华南营销中心;直销中心覆盖珠三角、长三角和京津冀环渤海经济区,为公司的快速发展奠定了组织和区域基础。经中国证监会批准,前海开源基金控股子公司——前海开源资产管理(深圳)有限公司(以下简称"前海开源资管")已于2013年9月5日在深圳市注册成立,并于2013年9月18日取得中国证监会核发的《特定客户资产管理业务资格证书》。截至报告期末,前海开源资管的股东结构为:前海开源基金管理有限公司出资8400万,占比84%,恒大地产集团有限公司出资1600万,占比16%。

截至报告期末,前海开源基金旗下管理26只开放式基金,资产管理规模超过350亿元。

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		
刘静	本基金的基金经理、公司联席投资总监	2015年1月14日	-	14年	本基金自同生效起至披露截止日不满一年;刘静女士,经济学硕士。历任长盛基金管理有限公司债券高级交易员、基金经理助理、长盛货币市场基金基金经理、长盛全债指数增强债券投资基金基金经理、长盛积极配置债券投资基金基金经理,现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监。

注:①对基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,"离任日期"为根据公司决定确定的解聘日期,对此后的非首任基金经理,"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。
②证券从业的含义遵从行业协会《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

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金基金合同》和其他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,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

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

基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(2011 年修订)的规定,针对投票市场、债券市场交易等投资管理活动,以及投权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节,制定了《前海开源基金管理有限公司公平交易管理办法》、《前海开源基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内控控制,完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估,以及履行相关的报告和信息披露义务,切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输近行为,保护投资者合法权益。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日成交量的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

一季度,基本面有所走弱,通缩压力不减;货币政策方面,央行先后进行了降准和降息操作,并且三次下调逆回购利率,以进行应对。二季度,基本面强势不改,通胀依旧低位运行;货币政策方面,央行先后进行了降准和降息操作,并在6月末重启逆回购,以应对经济基本面走弱和季末因素导致的资金面的波动。三季度,基本面继续走弱,通胀虽受猪周期的影响小幅上行,但仍处于2以下的相对低位;货币政策方面,央行先后进行了"双降"操作并重启了14天逆回购,宽松力度加大;外源流动性方面,8.11汇改一度导致人民币大幅贬值和外占大幅流出,但随着央行干预力度的加强,人民币汇率有所企稳,外源流动性也得以改善。四季度,尽管经济基本面弱势企稳,但社融增速掉头向下,指向未来经济仍面临较大的不确定性;随着猪周期影响的消退,CPI较3季度下台阶。货币政策方面,央行进行了"双降"操作,并且顺势下调了7天逆回购利率。外源流动性方面,10月人民币短暂企稳,外源流动性有所改善,之后随着美国公布非农就业数据并如期加息,人民币持续贬值,外占面临净流出态势。全年来看,经济和通胀趋势性走弱,货币政策持续宽松。尽管经济下行及外源流动性压力,但是央行采取多种手段维稳汇率,人民币贬值对资金面的冲击有限,资金面以宽松为主。

纯债方面,一季度前期,由于基本面较弱,资金面较为宽松,且货币政策宽松预期较强,收益曲线平坦化下行。之后,受地方政府债务置换导致供需失衡等因素影响,国开债收益率及隐含回购利率大幅上升,期间国开债利率一度突破7%,收益率陡峭化上行至年内高点。二季度,在降准降息及大量扩新资金进入资金市场等利好因素的作用下,资金利率降至年内低位,债券市场收益率整体下行。从整个季度来看,短端债券和中高等级信用债收益率下行幅度较大,而中长期债券和低等级信用债收益率则表现出较为明显的抵御风险特征。三季度,在资产荒配置、风险偏好下降等利好因素的作用下,债券市场收益率整体下行,短端中高等级信用债和长久期利率债先后领涨,中高等级信用利差大幅收窄。从整个季度来看,长久期利率债表现最佳。四季度前期,受汇率企稳、降准降息的影响,收益率迎来了一轮快速的下行;11月初受美联储加息预期增强及PPO重启的影响债券收益率一度出现20-30BP的回调;之后在风险偏好下降、供给减少等利好因素的作用下,债券收益率加速下行。由于资金宽松,套息交易受到追捧,信用利差继续收窄。从整个季度来看,10年国开表现最佳,10年国债和5年期信用债亦有较好的表现。

权益方面,一季度,前期受政策放松不及预期,以及两融业务监管等因素的影响,大盘有所调整,转债亦跟随正股回调。之后,在全面降准降息、逆回购利率多次下调等多重利好的带动下,股市走强,中小盘表现好于大盘。转债亦跟随正股回暖,但由于估值压缩,转债表现不及正股。二季度,前期在地产新政推出、公开市场利率连续下调、存款准备金率大幅下调等利好因素的影响下,增量资金加速入市,股市延续强势;进入5月份,市场在累计了较大涨幅后对利空因素较为敏感,股市上涨的同时波动加大。6月前两周股市延续了之前的上涨趋势,但之后在场外配资清理的影响下巨幅下挫。转债在股市上涨时跟随正股上涨,在股市大跌时转债因面临正股下跌和估值下降的双重压力跌幅一度超过正股,但之后因有债底保护表现出一定的抗跌性。三季度,前期政府大举救市在一段时间内稳定了市场情绪,市场在3600-4200的区间内宽幅震荡。尤其后市场一度对汇率失控导致资金流出极度恐慌,大盘连续多个交易日暴跌。之后央行通过双降以及外汇市场干预等在一定程度上稳定了市场预期,大盘有所企稳,但市场情绪仍较为脆弱。转债在股市下跌时跟随正股下跌,且在一些时段波动大于正股,但整体上因有债底保护表现出一定的抗跌性。四季度,前期受供金宽松、汇率阶段性企稳及风险偏好上升等影响,市场以上涨为主。之后随着人民币持续贬值,市场风险偏好有所回落,市场在3500-3600点的区间小幅震荡。转债由于存量较少,在140元附近或60%-65%的转股溢价率附近有较强的支撑,表现出较强的抗跌性。

新股申购方面,一季度受益于中签率较高打新收益可观。二季度,之前较高的打新收益吸引了大量资金,导致中签率大幅下降,但在次新股强势上涨的带动下新股一字板个数增加,较高的涨幅在一定程度上抵消了中签率下降带来的不利影响。再加上5月后新股发行提速,新股申购仍能获得较高的收益,4月份、5月份和6月份第一批新股的平均年化收益率均超过10%。新股申购在类固收品种中性价比仍然较高。3季度IPO暂停。年末新股申购重启,但由于申购热情较高,中签率甚至低于IPO暂停前,申购收益有限。

操作上,基金总体较好地把握了大类资产的轮动。纯债方面,一季度,本基金在债市走强时进行了较大幅度的加仓,将仓位维持在较高水平,较好的获得了收益曲线快速下行带来的资本利得收益。之后在债券市场反转时债券仓位已经大幅降低。二季度,本基金前期持有的中高等级信用债获取了较好的收益。三季度,本基金在风险偏好大幅回落且汇率出现企稳迹象时陆续在长久期利率债上进行了较大幅度的加仓,四季度,本基金在中长久期利率债上继续维持较高仓位,权益方面,一季度,本基金一季度初市场波动较大时在股票和转债维持较低仓位,市场回暖后进行了较大幅度的加仓,权益部分为组合带来了较大的正贡献。二季度,本基金在4,5月份的时候进行了加仓,在6月份市场大跌前进行了减仓,并在市场大跌后陆续减仓。三季度,本基金在政府大举救市时进行了较大幅度的加仓,后续在市场大幅波动的情况下进行过几次波段操作,并陆续降低仓位。四季度,本基金在市场风险偏好上升时进行了一定程度的加仓,之后随着市场风险偏好回落进行了逐步减仓。新股申购方面,本基金在对新股基本面和申购节奏进行充分研究的基础上积极参与新股申购,获取了较为稳定的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金A类份额净值为1.165元,净值增长率为16.50%;C类份额净值为1.150元,净值增长率为15%。同期业绩比较基准收益率为9.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,纯债方面,我们认为1季度经济仍面临较大的不确定性,通胀尽管难以回到10月份的低点但仍将处于相对低位,货币政策将以宽松为主,债市整体风险不大,但经历了前期的快速下行后,目前债券收益率已处于较低水平,收益率继续下行的空间不大。在收益率处于低位时,市场对负面信息较为敏感,尽管债市长期趋势向下,但年后公开市场操作的不确定性、金融数据可能的超预期、地方债发行、以及外围流动性可能的波动都可能导致收益率出现调整。在经济弱势及违约容忍度提升的情况下,信用事件发生的概率增加,利率债和中高等级信用债较为安全。

权益方面,经历了1月份的大幅下跌,目前市场估值已较为合理,部分股票已有较好的投资价值。在人民币汇率暂稳的背景下,我们认为股市将有所企稳,部分业绩增长确定性高且估值合理的个股可能出现较好的投资机会。转债方面,随着前期新券的发行,可选择的个券增加,转债市场流动性得以改善,二级市场宜结合正股表现及转债自身的特性精选个券,一级市场宜精选申购收益较高的个券。

基于以上考虑,未来本基金将本着以获取稳健收益为主的原则根据市场情况进行大类资产灵活配置,纯债以中短久期、中高等级信用债为主,以获取稳定的票息收入。权益二级市场主要根据市场变化情况进行波段操作,一级市场积极参与预期申购收益率较高的转债申购,力争为基金持有人获取较高的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,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。

本基金管理人设有估值委员会,负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序,指导和监督整个估值流程。估值委员会由总经理、督察长、基金事务部、研究部、投资部、监察稽核部、交易部负责人及其他指定相关人员组成。估值委员会成员均具备专业胜任能力和相关从业资格,精通各自领域的理论知识,熟悉相关政策法规,并具有丰富的实践经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议,由其按约定提供固定收益品种的估值数据。

本基金本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内,本基金未进行利润分配。

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

本基金本报告期内,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的情形。

本基金2015年10月14日至2015年12月17日连续47个工作日,基金资产净值低于五千万元。

§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

本报告期,广发证券股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)审计了本基金的财务报表,包括2015年12月31日的资产负债表,2015年1月14日(基金合同生效日)至2015年12月31日的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注,并出具了无保留意见的审计报告。

投资者欲了解详细内容,可通过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:前海开源睿远稳健增利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

姓名	本期末 2015年12月31日
资 产:	
银行存款	85,853,591.93
结算备付金	247,582.25
存出保证金	149,778.75
交易性金融资产	39,512,426.27
其中:股票投资	7,494,548.27
基金投资	-
债券投资	32,017,878.00
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	70,000,225.00
应收证券清算款	-
应收利息	801,603.52
应收股利	-
应收申购款	111,109.58
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	196,676,317.30
负债和所有者权益	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	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	497,068.47
应付管理人报酬	111,062.00
应付托管费	18,510.35
应付销售服务费	50,295.64
应付交易费用	27,283.64
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	250,038.95
负债合计	954,269.05
所有者权益:	
实收基金	170,060,753.27
未分配利润	25,661,294.98
所有者权益合计	195,722,048.25
负债和所有者权益总计	196,676,317.30

注:①报告截止日2015年12月31日,前海开源睿远稳健增利混合A基金份额净值1.165元,基金份额总额8,815,726.42份,前海开源睿远稳健增利混合C基金份额净值1.150元,基金份额总额161,245,026.85份。
②本基金的基金合同于2015年1月14日生效,无上年度末可比数据。

7.2 利润表

会计主体:前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月14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1月14日(基金合同生效日)至2015年12月31日
一、收入	43,041,484.96
1.利息收入	6,664,381.34
其中:存款利息收入	2,608,137.78
债券利息收入	1,456,497.03
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	2,599,746.53
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	33,966,308.18
其中:股票投资收益	30,772,149.21
基金投资收益	-
债券投资收益	2,887,605.46
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	306,553.51
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	2,090,676.22
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	320,119.22
减:二、费用	12,649,474.26
1. 管理人报酬	6,890,298.77
2. 托管费	1,148,383.12
3. 销售服务费	3,328,349.76
4. 交易费用	916,021.90
5. 利息支出	18,060.71
其中:卖出回购金融资产支出	18,060.71
6. 其他费用	348,360.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	30,392,010.70
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	30,392,010.70

注:本基金的基金合同于2015年1月14日生效,实际报告期间为2015年1月14日(基金合同生效日)到2015年12月31日,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:前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月14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1月14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)	303,948,857.19	-	303,948,857.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	30,392,010.70	30,392,010.70
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)	-133,888,103.92	-4,730,715.72	-138,618,819.64
其中:1.基金申购款	3,185,704,393.68	266,994,424.08	3,452,698,817.76
2.基金赎回款	-3,319,592,497.60	-271,725,139.80	-3,591,317,637.40
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)	170,060,753.27	25,661,294.98	195,722,048.25

注:本基金的基金合同于2015年1月14日生效,实际报告期间为2015年1月14日(基金合同生效日)到2015年12月31日,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:

傅毓_____ 李志祥_____ _____任福利_____

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

前海开源睿远稳健增利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")证监许可【2014】1268号文《关于准予前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金注册的批复》,由前海开源基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金基金合同》及其他法律法规公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次募集期间为2015年1月5日至2015年1月12日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集303,866,359.21元,经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2015]第02030002号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金基金合同》于2015年1月14日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为303,948,857.19份基金份额,其中认购资金利息折合 82,497.98 份基金份额。本基金的基金管理人为前海开源基金管理有限公司,本基金托管人为广发证券股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系自2015年1月14日(基金合同生效日)起至2015年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。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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卖出回购金融资产款和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的控制。

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

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)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在证券交易所市场的收盘价确定公允价值;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按其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且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。

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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得(损失)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确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在"损益平准金"科目中核算,并于期末金额转入"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