

东方安心收益保本混合型证券投资基金 2015 年年度报告 摘要

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：东方基金管理有限责任公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：二〇一六年三月二十六日

§ 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。

基金托管人中国邮政储蓄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。

立信会计师事务所（特殊普通合伙）为基金财务出具了标准无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2015 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

本基金于 2015 年 11 月 17 日至 2015 年 12 月 14 日以通讯方式召开了基金份额持有人大会，表决通过了《关于调整东方安心收益保本混合型证券投资基金赎回费率的议案》和《关于更换东方安心收益保本混合型证券投资基金担保人的议案》，并于 2015 年 11 月 4 日完成了更换担保人、调整赎回费率等相关内容的变更注册，详情可参阅本公司于 2015 年 12 月 16 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及管理人网站上发布的《关于以通讯方式召开东方安心收益保本混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》及其提示性公告、《东方基金管理有限责任公司关于东方安心收益保本混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

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	东方安心收益保本
基金主代码	400020
前端交易代码	400020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 7 月 3 日
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,101,047,262.81 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过保本资产与收益资产的动态配置和有效的组合管理，控制本金损失的风险，并在基金本金安全的基础上实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金将综合运用固定比例投资组合保险策略 (Constant Proportion Portfolio Insurance, 以下简称 CPPI 策略) 与基于期权的投资组合保险策略 (Option-Based Portfolio Insurance, 以下简称 OBPI 策略) 在保本周期内实现保值增值的目的。
业绩比较基准	以三年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准。
风险收益特征	本基金是保本混合型的基金产品，属于证券投资基金中的低风险品种。

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		东方基金管理有限责任公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李景岩	田东辉
	联系电话	010-66295888	010-68858112
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	tiandonghui@psbc.com
客户服务电话		010-66578578 或 400-628-5888	95580
传真		010-66578700	010-68858120

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	http://www.orient-fund.com 或 http://www.df5888.com
基金年度报告备置地点	本基金管理人及本基金托管人住所

§ 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	2013 年 7 月 3 日(基 金合同生效 日)-2013 年 12 月 31 日
本期已实现收益	412,875,498.60	14,631,900.74	3,358,682.40
本期利润	417,916,542.44	19,264,661.16	2,993,400.21
加权平均基金份额本期利润	0.1517	0.1618	0.0165
本期基金份额净值增长率	12.13%	17.68%	1.65%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	0.1738	0.1570	0.0165
期末基金资产净值	1,399,538,536.75	91,363,437.25	162,602,934.80
期末基金份额净值	1.2711	1.1962	1.0165

注：①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。

②期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

③本基金所述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。

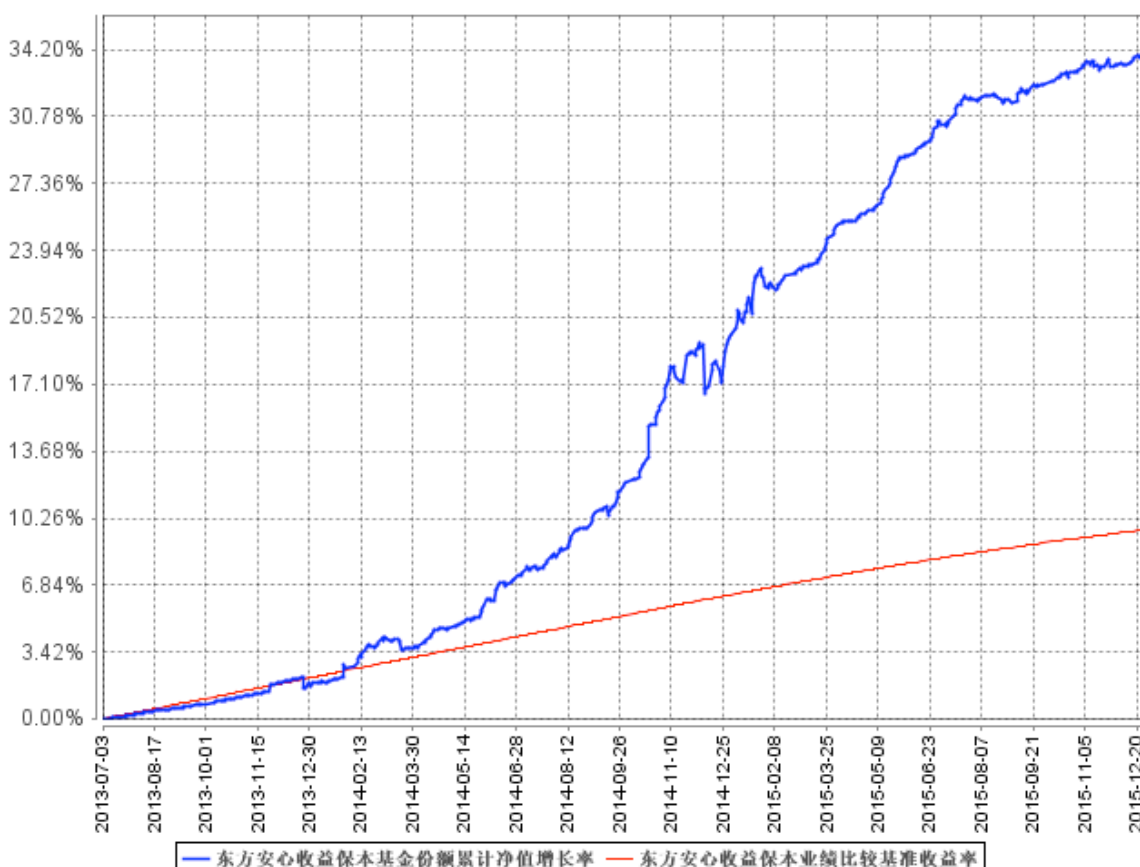
3.2 基金净值表现

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	1.32%	0.08%	0.71%	0.01%	0.61%	0.07%
过去六个月	2.77%	0.08%	1.50%	0.01%	1.27%	0.07%
过去一年	12.13%	0.13%	3.37%	0.01%	8.76%	0.12%
过去三年	34.13%	0.17%	9.71%	0.01%	24.42%	0.16%
过去五年	34.13%	0.17%	9.71%	0.01%	24.42%	0.16%
自基金合同 生效起至今	34.13%	0.17%	9.71%	0.01%	24.42%	0.16%

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

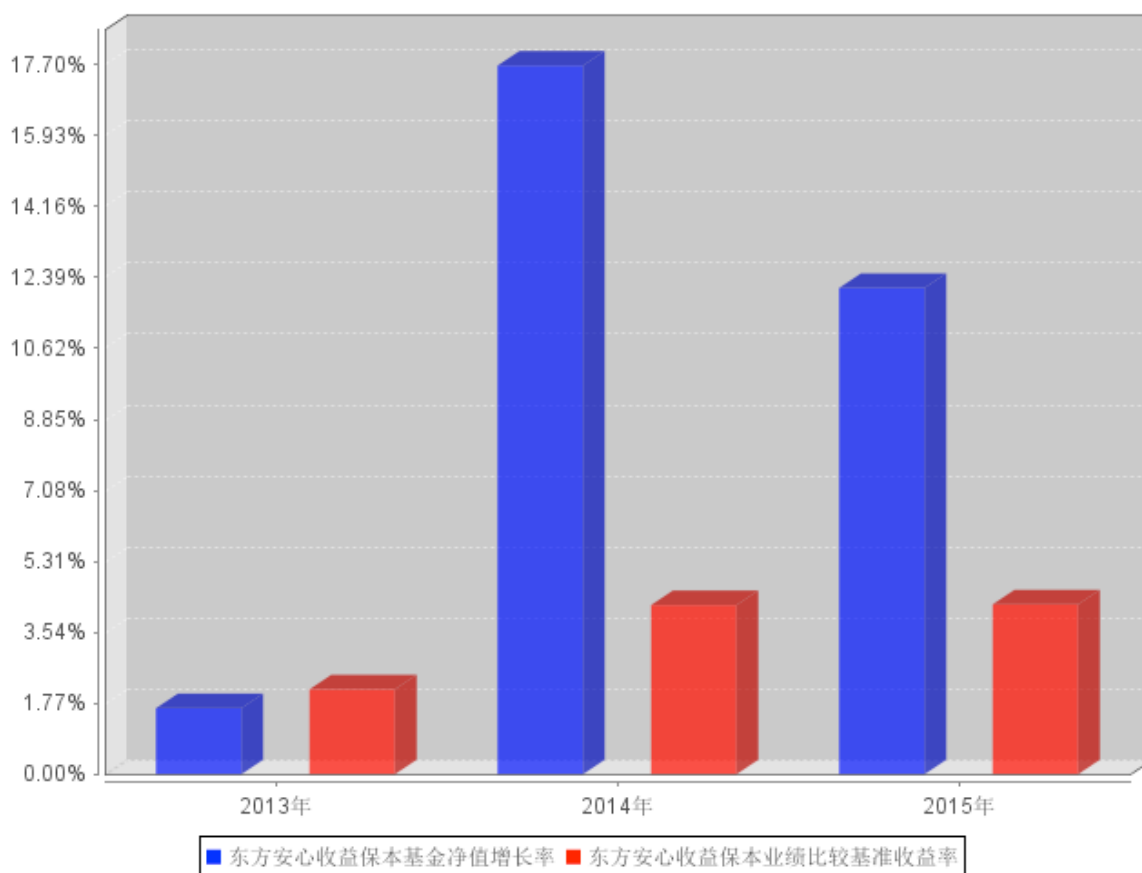
东方安心收益保本基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同于 2013 年 7 月 3 日生效，建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

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

东方安心收益保本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对比图



注：自合同生效以来未满五年。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	0.7000	77,161,761.94	0.62	77,161,762.56	
2014	-	-	-	-	
2013	-	-	-	-	
合计	0.7000	77,161,761.94	0.62	77,161,762.56	

§ 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

本基金管理人为东方基金管理有限责任公司（以下简称“本公司”）。本公司经中国证监会“证

监基金字[2004]80号”批复批准于2004年6月11日成立，本公司注册资本2亿元人民币。本公司股东东北证券股份有限公司出资人民币12800万元，占公司注册资本的64%；河北省国有资产控股运营有限公司出资人民币5400万元，占公司注册资本27%；渤海国际信托股份有限公司出资人民币1800万元，占公司注册资本的9%。截止2015年12月31日，本公司管理28只开放式证券投资基金——东方龙混合型开放式证券投资基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、东方金账簿货币市场证券投资基金、东方策略成长混合型开放式证券投资基金、东方稳健回报债券型证券投资基金、东方核心动力混合型开放式证券投资基金、东方保本混合型开放式证券投资基金、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金、东方启明量化先锋混合型证券投资基金、东方安心收益保本混合型证券投资基金、东方利群混合型发起式证券投资基金、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金、东方新兴成长混合型证券投资基金、东方双债添利债券型证券投资基金、东方添益债券型证券投资基金、东方主题精选混合型证券投资基金、东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金、东方永润18个月定期开放债券型证券投资基金、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、东方赢家保本混合型证券投资基金、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金、东方新价值混合型证券投资基金、东方创新科技混合型证券投资基金、东方稳定增利债券型证券投资基金、东方金元宝货币市场证券投资基金。

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		
王丹丹 (女士)	本基金基金经理、固定收益部副总经理、投资决策委员会委员	2013年7月3日	-	9年	中国人民银行研究生部金融学硕士，9年基金从业经历。2006年6月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任债券研究员、债券交易员、东方金账簿货

					币市场证券投资基金基金经理助理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理。现任固定收益部副总经理、投资决策委员会委员、东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理。
徐 昀 君 (先生)	本基金基金经理、固定收益部总经理助理	2013 年 12 月 24 日	2015 年 3 月 12 日	7 年	对外经济贸易大学金融学硕士, CFA, FRM, 7 年证券从业经历。曾任安信证券资产管理部研究员、投资经理, 华西证券资产管理部投资经

				<p>理。2013 年 3 月加盟东方基金管理有限公司，曾任东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理助理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理助理、东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理。现任固定收益部总经理助理，东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方双债添利债券型证</p>
--	--	--	--	--

					券基金基金 基金经理、 东方添益 债券型证 券投资基 金基金经 理、东方 利群混合 型发起式 证券投资 基金基金 经理、东 方永润 18 个月定期 开放债券 型证券投资 基金基金 经理。
朱晓栋 (先生)	本基金基金 经理、 权益投资 部总经理 助理、投 资决策委 员会委员	2014 年 1 月 30 日	-	6 年	对外经济 贸易大学 经济学硕 士,6 年证 券从业经 历。2009 年 12 月加 盟东方基 金管理有 限责任公 司, 曾任 研究部金 融行业、 固定收益 研究、食 品饮料行 业、建筑 建材行业 研究员, 东方龙混 合型开放 式证券投资 基金基金 经理助 理、东方 精选混合 型开放

					证券投资基金基金经理。现任权益投资部总经理助理、投资决策委员会委员、东方利群混合型发起式证券投资基金基金经理、东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方核心动力股票型开放式证券投资基金（于 2015 年 7 月 31 日更名为东方核心动力
--	--	--	--	--	---

					混合型证券投资基金) 基金经理、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：①此处的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

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》及其各项实施准则、《东方安心收益保本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，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为。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

基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011年修订），制定了《东方基金管理有限责任公司公平交易管理制度》。

基金管理人建立了投资决策的内部控制体系和客观的研究方法，各投资组合经理在授权范围内自主决策，各投资组合共享研究平台，在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

基金管理人实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易，基金管理人执行交易系统内的公平交易程序；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投

投资组合的交易价格和数量，基金管理人按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；对于银行间交易，按照时间优先、价格优先的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段的同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对相关交易情况进行合理性解释并留存记录。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动中公平对待不同投资组合，未直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。

公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《东方基金管理有限责任公司公平交易管理制度》的规定对本报告期公司不同投资组合同向交易价差进行了分析。公司采集连续四个季度，不同时间窗口（1 日内、3 日内、5 日内）的同向交易样本，在假设同向交易价差为零及 95%的置信水平下，对同向交易价差进行 T 分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析。分析结果显示本基金与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

基金管理人管理的投资组合参与的交易所公开竞价不存在同日反向交易，不存在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，全球经济政策呈分化之势，美联储如期于 12 月加息，欧洲和日本则继续扩大 QE 规模，大宗商品价格继续探底，原油跌破 08 年低点。国内实体经济持续低迷，央行 4 次降准、5 次降息，并辅以定向政策对冲经济下滑，值得一提的是，人民币汇率从 8 月份出现了贬值趋势，对居民和企业的资产负债配置行为、金融市场影响因素都形成了深远的影响。

债券市场方面，上半年受股票打新的挤出，窄幅波动，短端受益于打新基金形成的短期资金供给，收益率率先出现下降，随着打新的暂停，长端收益率启动下行趋势，收益率降至历史低位，同时，随着经济下滑和资产价格的暴跌，信用风险接连暴露。

股票市场方面，上半年随着杠杆资金的进入，股市一路走高，上证指数超过 5100 点，创业板

指数超过 4000 点，6 月初，随着场外融资的清理和巨额获利盘的积累，股市出现断崖式下跌，全年呈现宽幅震荡的格局。

报告期内，本基金根据客户结构特点，主要配置于流动性较好、信用风险较低的资产，积极参与打新，取得了稳定的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 12 月 31 日，本基金净值增长率为 12.13%，业绩比较基准收益率为 3.37%，高于业绩比较基准 8.76%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从经济数据所显示的趋势来看，经济基本面依然处于下降的弱势之中，在 2016 年，中国制造业的困局有望在人民币持续贬值中得到改善，同时供给侧的改革政策也将推进传统过剩产能的出清，经济基本面有望得到改善；需要警惕的是供给侧改革带来的阵痛，使得经济呈现前低后高走势的概率较大。

市场层面而言，支持 2015 年股市上涨的几大因素均发生了一些变化，无风险利率在央行连续降息以及汇率的制约之下，下行空间已经不大，而企业盈利的改善需要等到下半年才能看到，因此我们对一季度市场持谨慎态度。

对于 2016 年一季度债券市场而言，供需两旺的背景下收益率有望再下一城，国债、地方债净增量将大幅提升，银行理财、保险的再配置压力较大。考虑到国内外宏观经济不确定性增强、债券收益率已处低位，机构心态可能较谨慎，预计债市难改震荡性格局，将重点关注利率债的波段交易价值。

本基金将立足于基本面，兼顾业绩成长与估值的合理性，寻找符合本基金绝对回报策略的标的，争取为投资者创造持续稳定的投资回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金法》和中国证监会发布的有关规定，完善内部控制制度和操作流程；在基金日常运作上，开展定期和实时监控，强化内控体系和制度的落实；在加强对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察方面，通过实时监控、定期检查、专项检查等方式，及时发现问题、提出改进建议并跟踪改进落实情况。本报告期内重点开展的监察稽核工作包括：（1）开展对公司各项业务的日常监察，对风险隐患做到及时发现、及时化解，保证投资管理、基金销售和后台运营等业务的合法合规。（2）根据中国证监会颁布的相关法律法规，进一

步加强基金投资运作的监察力度，完善了基金投资有关控制制度。(3) 进一步完善公司内控体系，完善业务流程，在各个部门和全体人员中实行风险管理责任制，并进行持续监督，跟踪检查执行情况。(4) 注重加强对员工行为规范和职业素养的教育与监察，并通过开展法规学习活动等形式，提升员工的诚信规范和风险责任意识。下一年度，本基金管理人将在不断提高内部监察稽核和风险控制工作的科学性和实效性的基础上，确保基金资产的规范运作，维护基金份额持有人的合法利益，给基金份额持有人以更多、更好的回报。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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》的要求，本基金管理人成立了东方基金管理有限责任公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），成员由分管运营副总经理、分管投研副总经理、督察长以及运营部、投研部门（包括但不限于权益投资部、固定收益部、量化投资部）、风险管理部负责人组成，估值委员会设立委员会主任 1 名，委员会副主任 1-2 名，估值委员会成员均具备良好的专业知识、专业胜任能力和独立性，熟悉基金投资品种及基金估值法律法规。职责分工分别如下：

1. 委员会主任

负责定期或不定期组织召开估值委员会工作会议，就估值参与各方提交的估值问题组织讨论，进行决议并组织实施；因特殊原因，委员会主任无法履行职责时，由副主任代理其行使主任职责。

2. 运营部

①自行或应各方需求提请估值委员会主任召开估值委员会会议。

②征求托管行意见并借鉴行业界通行做法，提出估值模型和估值方法的修改意见。

③根据估值委员会会议决定的估值方法、估值模型及参数计算具体投资品种的公允价值并据以对基金等投资组合进行估值。

④负责编制投资组合持有的投资品种变更估值方法的相关公告。

3. 投研部门

当基金等投资组合持有没有市价或不存在活跃市场的投资品种（简称“停牌有价证券”）时，根据估值委员会要求和运营部的估值方案，负责评估现有估值政策和估值方法是否公允、适当，对估值方法有失公允性的“停牌有价证券”，建议或提示运营部提请估值委员会主任召开估值会议。

4. 风险管理部

在日常监控和风险管理过程中发现估值政策和估值方法有失公允性时，建议或提示运营部提请估值委员会主任召开估值会议。

上述参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

截至本报告期末，公司已与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金）。公司与中证指数有限公司签署了《债券估值数据服务协议》，并依据其提供的中证债券估值数据对公司旗下基金持有的交易所固定收益品种进行估值（适用非货币基金）。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金《基金合同》的相关规定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 10%，本年度基金管理人进行了一次收益分配，具体分配情况如下：

2015 年 11 月 30 日为收益分配基准日，基准日基金可供分配利润 270,110,585.25 元，实际分配金额 77,161,762.56 元，每 10 份基金份额分配现金红利 0.7000 元，现金红利发放日 2015 年 12 月 21 日。

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

报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金持有人数低于 200 人或基金资产规模低于 5000 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

基金托管人依据《东方安心收益保本混合型证券投资基金基金合同》与《东方安心收益保本混合型证券投资基金托管协议》，自 2013 年 7 月 3 日起托管东方安心收益保本混合型证券投资基金（以下称本基金）的全部资产。

本报告期内，本托管人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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，本托管人依据国家相关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金已分配利润 77,161,762.56 元。

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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、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，认为其真实、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

本基金本年度财务会计报告已经审计，立信会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，投资者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：东方安心收益保本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	7.4.7.1	912,321,926.87	736,124.15
结算备付金		1,361,724.59	1,670,333.44
存出保证金		655,836.02	38,559.36
交易性金融资产	7.4.7.2	696,750,289.28	102,259,723.48
其中：股票投资		36,750,022.68	10,997,070.00
基金投资		-	-
债券投资		660,000,266.60	91,262,653.48

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	300,000,650.00	7,700,000.00
应收证券清算款		4,162,761.71	242.50
应收利息	7.4.7.5	10,842,429.28	2,055,232.86
应收股利		-	-
应收申购款		496,143.60	198.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,926,591,761.35	114,460,413.89
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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		523,708,814.43	22,600,000.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		106,007.79	212,027.59
应付管理人报酬		1,602,740.22	103,551.35
应付托管费		246,575.41	15,930.99
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,249,731.39	70,082.53
应交税费		-	-
应付利息		40,323.22	13,750.31
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	99,032.14	81,633.87
负债合计		527,053,224.60	23,096,976.64
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,101,047,262.81	76,379,498.28
未分配利润	7.4.7.10	298,491,273.94	14,983,938.97
所有者权益合计		1,399,538,536.75	91,363,437.25
负债和所有者权益总计		1,926,591,761.35	114,460,413.89

注：①报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2711 元，基金份额总额 1,101,047,262.81 份。

②本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为年度报告正文中对应的附注号，投资者欲了解相应附注的内容，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

7.2 利润表

会计主体：东方安心收益保本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 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		477,760,348.57	22,786,533.35
1. 利息收入		97,001,658.05	8,002,174.78
其中：存款利息收入	7.4.7.11	38,768,462.30	1,272,026.32
债券利息收入		37,028,822.13	6,423,146.28
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		21,204,373.62	307,002.18
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		314,123,859.88	9,830,137.37
其中：股票投资收益	7.4.7.12	321,659,396.94	6,109,060.98
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13.1	-7,918,138.81	3,631,136.39
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	382,601.75	89,940.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	5,041,043.84	4,632,760.42
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	61,593,786.80	321,460.78
减：二、费用		59,843,806.13	3,521,872.19
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	45,275,253.58	1,668,317.01
2. 托管费	7.4.10.2.2	6,965,423.64	256,664.15
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	2,219,034.52	154,982.68
5. 利息支出		5,086,694.39	1,037,707.85
其中：卖出回购金融资产支出		5,086,694.39	1,037,707.85
6. 其他费用	7.4.7.20	297,400.00	404,200.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		417,916,542.44	19,264,661.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		417,916,542.44	19,264,661.16

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方安心收益保本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）	76,379,498.28	14,983,938.97	91,363,437.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	417,916,542.44	417,916,542.44
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）	1,024,667,764.53	-57,247,444.91	967,420,319.62
其中：1. 基金申购款	10,459,626,892.41	2,848,718,523.73	13,308,345,416.14
2. 基金赎回款	-9,434,959,127.88	-2,905,965,968.64	-12,340,925,096.52
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）	-	-77,161,762.56	-77,161,762.56
五、期末所有者权益（基金净值）	1,101,047,262.81	298,491,273.94	1,399,538,536.75
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 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）	159,958,961.82	2,643,972.98	162,602,934.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	19,264,661.16	19,264,661.16
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）	-83,579,463.54	-6,924,695.17	-90,504,158.71
其中：1. 基金申购款	2,753,311.51	388,392.29	3,141,703.80

2. 基金赎回款	-86,332,775.05	-7,313,087.46	-93,645,862.51
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）	76,379,498.28	14,983,938.97	91,363,437.25

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：

_____ 孙晔伟	_____ 秦熠群	_____ 张蓉梅
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

东方安心收益保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2013 年 4 月 19 日中国证监会《关于核准东方安心收益保本混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2013]368 号）和《关于东方安心收益保本混合型证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函[2013]296 号）的核准，由基金发起人东方基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方安心收益保本混合型证券投资基金基金合同》自 2013 年 5 月 13 日至 2013 年 6 月 28 日公开募集设立。本基金为混合型开放式证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 221,279,645.45 元人民币，业经立信会计师事务所（特殊普通合伙）“信会师报字[2013]第 230037 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东方安心收益保本混合型证券投资基金基金合同》于 2013 年 7 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 221,496,054.75 份基金单位，其中认购资金利息折合 216,409.30 份基金单位。本基金基金管理人为东方基金管理有限责任公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方安心收益保本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，主要投资于固定收益类金融工具，包括国债、中央银行票据、地方政府债、金融债（含政策性金融债）、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转债）、次级债券、资产支持证券、债券回购、银行存款等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金也可以参与新股申购、增发股票申购、要约收购类股票投资、持有可转换债券转股所得的股票、投资二级市场股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）以及权证等中国

证监会允许基金投资的其它权益类金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或中国证监会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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《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 XBRL 模板第 3 号—年度报告和半年度报告》、《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》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合《企业会计准则》及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本基金 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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策与最近一年保持一致，会计估计发生变更。

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

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

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》（以下简称“估值处理标准”），本公司旗下公募基金自 2015 年 3 月 30 日起实施新的债券估值标准。对在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），选取中证指数有限公司提供的相应品种当日的估值净价。对在交易所市场上市交易的可转换债券，选取每日收盘价作为估值全价。对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，采用成本估值。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税【2002】128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税【2004】78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税【2005】103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税【2007】84 号《关于调整证券(股票)交易印花税率的通知》、财税【2008】1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 04 月 23 日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好交易相关系统印花税率参数调整的通知》、2008 年 09 月 18 日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税【2012】85 号《关于实施公司股息红利差别化个人所得税政策的通知》、《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》财税[2015]101 号及其他相关税务法规和实务操作，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，不缴纳营业税。
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，暂不缴纳营业税和企业所得税。
3. 基金取得的股票股息、红利收入，自 2015 年 9 月 8 日起，基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得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；上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。
4. 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。
5. 对于基金从事 A 股买卖，自 2008 年 09 月 19 日起，由出让方按 0.1% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。
6. 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
东北证券股份有限公司	本基金管理人股东、销售机构
东方基金管理有限责任公司	本基金管理人、注册登记机构、直销机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司	本基金托管人、销售机构
渤海国际信托股份有限公司	本基金管理人股东
河北省国有资产控股运营有限公司	本基金管理人股东
东方汇智资产管理有限公司	本基金管理人下属子公司

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8.1 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1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1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
东北证券股份 有限公司	1,287,267,540.52	100.00%	94,709,612.14	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1月1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
东北证券股份 有限公司	3,511,363.30	100.00%	31,635,961.45	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1月1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
东北证券股份 有限公司	2,140,700,000.00	100.00%	2,801,200,000.00	100.00%

7.4.8.1.4 权证交易

本报告期及上年度可比期间，本基金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
东北证券股份 有限公司	1,163,377.65	100.00%	1,222,518.36	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1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 (%)
东北证券股份 有限公司	84,824.19	100.00%	59,140.71	100.00%

注：①上述佣金按照市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

②该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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1月1日至2014年12月31 日
	当期发生的基金应支付 的管理费	45,275,253.58
其中：支付销售机构的客 户维护费	357,620.37	561,560.31

注：①计提标准：本基金的管理费每日按前一日基金资产净值的 1.30% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财

产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

③保本周期内，保证费用由基金管理人从基金管理费收入中列支。

7.4.8.2.2 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 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	6,965,423.64	256,664.15

注：①计提标准：本基金的托管费每日按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国邮政储蓄银行股份有限公司	-	-	-	-	279,800,000.00	80,691.95
上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国邮政储蓄银行股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2013 年 7 月 3 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	8,189,189.18	-
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	8,189,189.18	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.7400%	-

注：根据《东方安心收益保本混合型证券投资基金招募说明书》中对申购费用的规定，申购金额大于或等于 500 万元的，申购费用为 1000 元/笔。基金管理人运用固有资金投资本基金适用的申购费用为 1000 元/笔。

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

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		上年度可比期间	
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		2014 年 1 月 1 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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	712,321,926.87	10,652,085.82	736,124.15	19,422.19

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金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

7.4.9.1.1 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	-
--------	------	------------------------	----------------------	------------	------	------	-------	-----------	-----------	---

7.4.9.1.2 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
123001	蓝标转债	2015 年 12 月 23 日	2016 年 1 月 8 日	新债流 通受限	100.00	100.00	2,330	233,000.00	233,000.00	-

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有因暂时停牌而于期末流通受限的股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 523,708,814.43 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单 价	数量（张）	期末估值总额
011565002	15 首机场 SCP002	2016 年 1 月 8 日	100.52	500000	50,260,000.00
011599811	15 厦港务 SCP005	2016 年 1 月 8 日	100.14	500000	50,070,000.00
011599854	15 浙能源 SCP003	2016 年 1 月 8 日	100.18	500000	50,090,000.00
041554009	15 北部湾 CP001	2016 年 1 月 8 日	101.12	500000	50,560,000.00
041556018	15 滨建投 CP001	2016 年 1 月 8 日	100.79	500000	50,395,000.00
041562023	15 徐高铁 CP001	2016 年 1 月 8 日	100.98	500000	50,490,000.00
041569021	15 顺国资 CP001	2016 年 1 月 8 日	100.97	500000	50,485,000.00
011517016	15 华电 SCP016	2016 年 1 月 8 日	100.20	400000	40,080,000.00
011599845	15 鄂能源 股 SCP001	2016 年 1 月 8 日	100.08	400000	40,032,000.00

101458028	14 海宁资产 MTN001	2016 年 1 月 8 日	108.28	90000	9,745,200.00
150403	15 农发 03	2016 年 1 月 8 日	100.20	200000	20,040,000.00
150416	15 农发 16	2016 年 1 月 8 日	100.23	500000	50,115,000.00
150215	15 国开 15	2016 年 1 月 8 日	100.13	200000	20,026,000.00
合计				5290000	532,388,200.00

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止, 本基金未持有在交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止本年度报告报出日, 本基金无需要披露的有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 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	36,750,022.68	1.91
	其中: 股票	36,750,022.68	1.91
2	固定收益投资	660,000,266.60	34.26
	其中: 债券	660,000,266.60	34.26
	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	300,000,650.00	15.57
	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	913,683,651.46	47.42
7	其他各项资产	16,157,170.61	0.84
8	合计	1,926,591,761.35	100.00

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	5,575,013.80	0.40
B	采矿业	-	-
C	制造业	19,306,078.40	1.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	764,359.95	0.05
F	批发和零售业	2,898,000.00	0.21
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	4,378,453.92	0.31
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,736,000.00	0.20
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	109,392.21	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	982,724.40	0.07
S	综合	-	-
	合计	36,750,022.68	2.63

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	000890	法 尔 胜	500,000	6,885,000.00	0.49
2	600549	厦门钨业	250,000	4,702,500.00	0.34
3	002458	益生股份	99,921	3,777,013.80	0.27
4	600579	天华院	199,991	3,333,849.97	0.24
5	600050	中国联通	500,000	3,090,000.00	0.22
6	002336	人人乐	200,000	2,898,000.00	0.21
7	300429	强力新材	19,950	2,773,050.00	0.20
8	000540	中天城投	300,000	2,736,000.00	0.20
9	002234	民和股份	100,000	1,798,000.00	0.13
10	603999	读者传媒	16,713	982,724.40	0.07

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

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	601211	国泰君安	116,861,279.85	127.91
2	000673	当代东方	59,897,335.80	65.56
3	601288	农业银行	39,068,786.00	42.76
4	601985	中国核电	32,649,100.17	35.74
5	002651	利君股份	31,702,507.99	34.70
6	300429	强力新材	19,052,833.45	20.85
7	603088	宁波精达	13,348,393.00	14.61
8	600310	桂东电力	12,341,871.91	13.51
9	600270	外运发展	11,419,651.00	12.50
10	300285	国瓷材料	8,857,739.66	9.70
11	002719	麦趣尔	8,853,000.00	9.69
12	600240	华业资本	8,191,432.45	8.97
13	000890	法 尔 胜	7,650,000.00	8.37
14	002318	久立特材	7,398,233.00	8.10
15	300274	阳光电源	7,359,862.00	8.06
16	603012	创力集团	7,195,830.96	7.88
17	002708	光洋股份	7,072,202.00	7.74

18	300187	永清环保	6,621,316.00	7.25
19	002260	德奥通航	6,043,529.00	6.61
20	002592	八菱科技	5,720,091.00	6.26
21	600331	宏达股份	5,454,341.00	5.97
22	600549	厦门钨业	5,325,100.00	5.83
23	002234	民和股份	4,924,117.45	5.39
24	600612	老凤祥	4,918,079.52	5.38
25	002458	益生股份	4,536,976.58	4.97
26	600010	包钢股份	4,244,223.00	4.65
27	002348	高乐股份	3,953,416.00	4.33
28	300433	蓝思科技	3,903,587.05	4.27
29	600009	上海机场	3,797,120.00	4.16
30	002365	永安药业	3,686,034.00	4.03
31	600959	江苏有线	3,628,431.51	3.97
32	000540	中天城投	3,592,110.65	3.93
33	600579	天华院	3,472,160.30	3.80
34	601199	江南水务	3,465,513.00	3.79
35	600050	中国联通	3,204,051.00	3.51
36	002336	人人乐	2,940,833.00	3.22
37	603020	爱普股份	2,729,326.51	2.99
38	300471	厚普股份	2,724,966.53	2.98
39	002529	海源机械	2,614,455.65	2.86
40	600965	福成五丰	2,469,299.70	2.70
41	600643	爱建集团	2,461,677.00	2.69
42	000750	国海证券	2,277,848.00	2.49
43	300390	天华超净	2,273,917.00	2.49
44	300263	隆华节能	2,229,236.28	2.44
45	600048	保利地产	2,005,528.18	2.20
46	300325	德威新材	1,976,263.68	2.16
47	600016	民生银行	1,865,710.00	2.04
48	000655	金岭矿业	1,825,564.00	2.00

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

②“买入金额”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。

8.4.2 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	601211	国泰君安	210,009,801.77	229.86
2	601985	中国核电	129,119,038.79	141.32
3	000673	当代东方	59,767,168.30	65.42
4	601288	农业银行	37,651,149.00	41.21
5	600959	江苏有线	35,621,358.89	38.99
6	300429	强力新材	20,541,405.36	22.48
7	300433	蓝思科技	16,966,219.00	18.57
8	002651	利君股份	16,444,964.00	18.00
9	603012	创力集团	14,070,773.08	15.40
10	600310	桂东电力	13,906,303.10	15.22
11	600240	华业资本	10,246,600.20	11.22
12	300285	国瓷材料	9,997,273.46	10.94
13	600270	外运发展	9,971,611.79	10.91
14	002719	麦趣尔	9,192,373.82	10.06
15	002708	光洋股份	8,598,131.28	9.41
16	603088	宁波精达	7,353,473.86	8.05
17	300274	阳光电源	7,326,250.20	8.02
18	600612	老凤祥	7,082,843.56	7.75
19	300471	厚普股份	6,544,256.96	7.16
20	603020	爱普股份	5,713,634.96	6.25
21	600331	宏达股份	5,158,107.02	5.65
22	002592	八菱科技	4,965,815.00	5.44
23	603883	老百姓	4,838,529.92	5.30
24	002318	久立特材	4,679,918.15	5.12
25	300325	德威新材	4,483,989.90	4.91
26	002260	德奥通航	4,421,460.19	4.84
27	300187	永清环保	4,259,940.04	4.66
28	603030	全筑股份	4,226,156.15	4.63
29	300431	暴风科技	3,950,025.25	4.32
30	601199	江南水务	3,817,443.42	4.18
31	002365	永安药业	3,758,817.03	4.11
32	600010	包钢股份	3,659,500.00	4.01
33	603729	龙韵股份	3,569,603.10	3.91
34	603989	艾华集团	3,486,407.00	3.82

35	300447	全信股份	3,455,092.78	3.78
36	002348	高乐股份	3,438,000.00	3.76
37	300458	全志科技	3,300,185.00	3.61
38	002756	永兴特钢	3,247,570.10	3.55
39	600009	上海机场	3,180,000.00	3.48
40	603158	腾龙股份	3,078,722.00	3.37
41	600643	爱建集团	2,905,209.20	3.18
42	002315	焦点科技	2,890,251.06	3.16
43	002751	易尚展示	2,804,480.40	3.07
44	300446	乐凯新材	2,721,961.30	2.98
45	002529	海源机械	2,689,413.60	2.94
46	600965	福成五丰	2,684,590.24	2.94
47	603318	派思股份	2,603,931.15	2.85
48	002612	朗姿股份	2,588,570.00	2.83
49	603718	海利生物	2,543,679.40	2.78
50	600875	东方电气	2,480,605.00	2.72
51	300390	天华超净	2,451,896.50	2.68
52	000750	国海证券	2,434,803.00	2.66
53	002743	富煌钢构	2,412,958.70	2.64
54	603869	北部湾旅	2,409,830.00	2.64
55	300449	汉邦高科	2,367,108.16	2.59
56	002234	民和股份	2,344,648.24	2.57
57	300263	隆华节能	2,341,496.00	2.56
58	300341	麦迪电气	2,334,648.00	2.56
59	603227	雪峰科技	2,319,356.50	2.54
60	300306	远方光电	2,165,060.00	2.37
61	000568	泸州老窖	2,056,284.76	2.25
62	300438	鹏辉能源	1,995,020.94	2.18
63	600048	保利地产	1,989,000.00	2.18
64	002701	奥瑞金	1,985,245.20	2.17
65	000655	金岭矿业	1,863,713.50	2.04
66	603566	普莱柯	1,857,940.00	2.03
67	002674	兴业科技	1,856,260.00	2.03

注：①卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 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	397,668,894.01
卖出股票收入（成交）总额	889,598,646.51

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	90,181,000.00	6.44
	其中：政策性金融债	90,181,000.00	6.44
4	企业债券	48,427,200.00	3.46
5	企业短期融资券	482,792,000.00	34.50
6	中期票据	28,189,800.00	2.01
7	可转债（可交换债）	10,410,266.60	0.74
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	660,000,266.60	47.16

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	041554009	15 北部湾 CP001	500,000	50,560,000.00	3.61
2	041562023	15 徐高铁 CP001	500,000	50,490,000.00	3.61
3	041569021	15 顺国资 CP001	500,000	50,485,000.00	3.61

4	041556018	15 滨建投 CP001	500,000	50,395,000.00	3.60
5	011515005	15 中铝业 SCP005	500,000	50,330,000.00	3.60

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本报告期末本基金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

本报告期末本基金未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本报告期末本基金未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期末本基金未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金所持有的人人乐（002336）于 2015 年 8 月 11 日收到深圳市证监局行政监管措施决定书，主要有以下问题：2012、2013 年，公司以盈利预测作为确认递延所得税资产的基础。检查发现，公司盈利预测涉及主要假设明显不合理，盈利预测不谨慎，高估了递延所得税资产。此外，检查还发现，公司存在会计核算不及时的问题，2014 年 5 月，公司西丽人人乐购物广场因水灾造成损失金额 952 万元，直至 2014 年 4 季度，公司才将水灾损失纳入会计核算。公司于 2015 年

1 月 29 日披露了业绩修正公告，净利润由三季度报所预测的亏损 2 至 2.5 亿元修正为亏损 5.5 至 6 亿元，修正幅度和金额较大，检查发现，公司未就业绩预测编制制定管理制度或工作程序，下属各子公司业绩预测编制方法不统一；业绩预测相关工作底稿不完整，反映各子公司收入、费用等项目具体测算、分析过程的资料缺失；汇总子公司的盈利预测时，公司未充分考虑部分重要事项的影响，如未基于子公司的实际经营状况分析递延所得税资产是否需要核销，未根据公司发展战略的变化分析关闭亏损门店和终止新店开设可能的损失。公司下属子公司天津市人人乐商业有限公司迁安购物广场（以下简称“迁安广场”）财务经理在 2013 年 6 月至 2015 年 1 月期间，通过盗用出纳人员网银制单证书及密码，挪用公司资金约 3,500 万元。检查发现，迁安广场出纳及其他财务人员在已经知悉资金支付和财务处理存在明显违规时，未及时报告；公司及天津市人人乐商业有限公司内审等相关部门对迁安购物广场“其他应收款”、“其他应付款”、“预付账款”等会计科目长期存在的异常情形未予以关注，并及时跟进了解形成原因，内部控制存在重大缺陷。

本基金所持有的民和股份（002234）于 2015 年 11 月 28 日收到山东省证监局行政监管措施决定书，主要有以下问题：公司内幕信息知情人登记不完整。经检查，公司仅对定期报告涉及的内幕信息进行了知情人登记，未对业绩预告、筹划员工持股计划、全资子公司启动改制并拟在新三板上市等其他重大事项进行登记。公司存在未披露的关联方及关联交易。经查，蓬莱市兴牧养殖专业合作社与公司存在实质上的关联关系。2014 年度、2015 年 1 至 6 月份，公司与兴牧合作社关联交易分别累计约为 3.17 亿元、6300 万元，未依法履行关联交易审议程序，也未按规定予以披露。公司存在用个人银行卡收取销售货款的情况。经查，公司存在用高管人员个人银行卡收取公司货款，然后再由财务人员将上述款项存入公司对公户的情况。

本基金决策依据及投资程序：

（1）研究员对宏观经济、证券市场、行业和公司的发展变化进行深入而有效的研究，形成有关的各类报告，为本基金的投资管理提供决策依据。

（2）投资决策委员会定期召开会议，讨论本报告期内本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定范围形成本基金的资产配置比例指导意见。

（3）基金经理根据投资决策委员会的决议，参考上述报告，并结合自身的分析判断，形成基金投资计划，主要包括行业配置和投资组合管理。

（4）运营部依据基金经理的指令，制定交易策略，统一进行具体品种的交易；基金经理必须遵守投资组合决定权和交易下单权严格分离的规定。

（5）投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出市场风险防范措施，监察稽核部、风险管理部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和量化风险控制。

本基金投资人人乐主要基于以下原因：从基本面上看，我们认为公司面临业绩反转的重大投资机遇，并且公司针对整改报告书及时进行了相关整改。

本基金投资民和股份主要基于以下原因：从基本面上看，养殖行业尤其是禽类养殖行业处在周期翻转期，我们判断 2016 年禽类养殖行业将迎来大的业绩反转，并且公司针对相关问题已经进行整改。

除上述情况外，本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未发现存在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、处罚的情况。

8.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

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	655,836.02
2	应收证券清算款	4,162,761.71
3	应收股利	-
4	应收利息	10,842,429.28
5	应收申购款	496,143.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,157,170.61

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110031	航信转债	753,072.00	0.05
2	113008	电气转债	528,652.80	0.04

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§ 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
2,149	512,353.31	1,043,858,506.97	94.81%	57,188,755.84	5.19%

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	0.00	0.0000%

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	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年7月3日）基金份额总额	221,496,054.75
本报告期期初基金份额总额	76,379,498.28
本报告期基金总申购份额	10,459,626,892.41
减:本报告期基金总赎回份额	9,434,959,127.88
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	1,101,047,262.81

注：基金总申购份额包含基金转换入份额，基金总赎回份额包含基金转换出份额。

§ 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，就本基金召开基金份额持有人大会等相关事宜，公司根据《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定，在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站进行了如下信息披露：

- 1、2015 年 11 月 12 日披露了《关于以通讯方式召开东方安心收益保本混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》；
- 2、2015 年 11 月 13 日披露了《关于以通讯方式召开东方安心收益保本混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告》；
- 3、2015 年 11 月 14 日披露了《关于以通讯方式召开东方安心收益保本混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告》；
- 4、2015 年 12 月 16 日披露了《东方基金管理有限责任公司关于东方安心收益保本混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

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，基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人中国邮政储蓄银行托管业务部总经理变更为田东辉先生，向监管部门的相关报备手续正在办理中。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，本基金管理人（公司）存在一起未决诉讼案件，系原公司员工与公司之间的民事诉讼案件。二审已开庭审理，尚未判决。

本报告期内，无涉及本基金财产业务的诉讼。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度应支付给立信会计师事务所（特殊普通合伙）报酬为 40000 元；截至 2015 年 12 月 31 日，该审计机构已向本基金提供 3 年的审计服务。

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

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

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	
东北证券股份有限公司	21	287,267,540.52	100.00%	1,163,377.65	100.00%	-

注：（1）此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易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

券商选择标准：① 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；② 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；③ 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；④ 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；⑤ 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；⑥ 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；⑦ 收取的佣金率。

券商选择程序：① 对符合选择标准的券商的服务进行评价；② 拟定租用对象：由投研部门根据以

上评价结果拟定备选的券商；③签约：拟定备选的券商后，按公司签约程序与备选券商签约。签约时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等。

(3) 本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东北证券股份有限公司	3,511,363.30	100.00%	2,140,700,000.00	100.00%	-	-

东方基金管理有限责任公司
2016年3月26日