东方安心收益保本混合型证券投资基金

【2015】年度报告摘要

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)在保本期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	李崇岩	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		010-68578570或400-628-5888	95580
传真		010-68578700	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和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)。

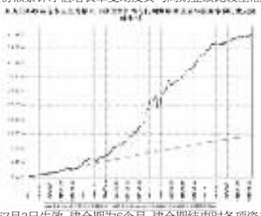
③本基金所述业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

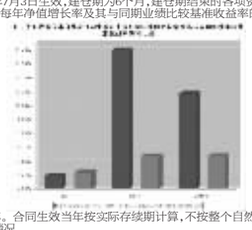
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.32%	0.08%	0.71%	0.01%	0.61%	0.07%
过去六个月	2.77%	0.08%	1.50%	0.01%	1.27%	0.07%
过去一年	12.13%	0.13%	3.37%	0.01%	8.76%	0.12%
过去三年	34.13%	0.17%	9.71%	0.01%	24.42%	0.16%
过去五年	34.13%	0.17%	9.71%	0.01%	24.42%	0.16%
自基金合同生效起至今	34.13%	0.17%	9.71%	0.01%	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



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



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、东方嘉欣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4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。现任固定收益部副总经理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理、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。
徐皓君(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理。2013年1月加盟东方基金管理有限责任公司,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。东方金账簿货币市场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券投资基金基金经理。东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型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。东方新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理。东方惠新灵活配置混合型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。东方新价值混合型证券投资基金基金经理。东方创新科技混合型证券投资基金基金经理。东方稳定增利债券型证券投资基金基金经理。东方金元宝货币市场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式证券投资基金基金经理助理。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。东方策略成长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。东方永润18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。东方惠新灵活配置混合型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。东方新价值混合型证券投资基金基金经理。东方创新科技混合型证券投资基金基金经理。东方稳定增利债券型证券投资基金基金经理。

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

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

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、东方嘉欣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4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。现任固定收益部副总经理。东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理。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。
徐皓君(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理。2013年1月加盟东方基金管理有限责任公司,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。东方金账簿货币市场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券投资基金基金经理。东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型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。东方新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理。东方惠新灵活配置混合型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。东方新价值混合型证券投资基金基金经理。东方创新科技混合型证券投资基金基金经理。东方稳定增利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式证券投资基金基金经理助理。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。东方策略成长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。东方永润18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。东方惠新灵活配置混合型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。东方新价值混合型证券投资基金基金经理。东方创新科技混合型证券投资基金基金经理。东方稳定增利债券型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中的公平交易程序;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,未直接或通过与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了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,主要配置了流动性较好、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不对称的制约之下,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,开展定期和实时监察,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征求托管行意见并供鉴行业界通行做法,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投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

姓名	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	38,149.36
交易性金融资产	7.4.7.2	696,750,289.28	102,259,723.49
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	91,262,453.48
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	2,065,232.86
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	103,161.36
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		40,322.22	13,756.31
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	76,279,498.28
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		97,001,656.05	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	6,423,146.29
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)		314,123,189.88	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	61,693,796.80	321,460.29
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	1,027,707.85
其中:卖出回购金融资产支出		5,086,694.39	1,027,707.85
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