东方保本混合型开放式证券投资基金

【2015】年度报告摘要

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	东方保本混合
基金主代码	400013
前端交易代码	400013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月14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	874,019,983.27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,在保本周期期间,为投本周期内认购并持有到期的基金份额提供保本金额安全保证的基础上,力求基金资产的稳定增值。
投资策略	在大类资产配置方面,本基金运用CPPI固定比例投资组合保险机制,采动态分配基金资产在收益资产和保本资产上的投资比例。 在保本资产投资方面,以追求本金安全为目的。固通过持有相当数量的剩余期限小于或等于保本周期的债券等低风险固定收益类证券,并规避利率、再投资等风险,以确保保本资产的稳定收益。 在收益资产投资方面,以追求收益为目的。即采用积极投资方式,把握市场时机、挖掘市场热点,精选个股,获取稳定的资本增值。
业绩比较基准	本基金以三年期银行定期存款积分收益率作为本基金的业绩比较基准。 本基金投资品种为债券产品,不动产投资品种期限均在保本周期期限以内。本基金以三年期银行定期存款积分收益率作为业绩比较基准,随着期货资者预期的变化,会适时调整业绩比较基准并及时公告,不需要召开基金份额持有人大会。
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	李展容	田东辉
	联系电话	010-66296888	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		010-66278700	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.dfh888.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
本期已实现收益	190,302,917.06	18,849,330.08	14,879,796.12
本期利润	191,915,201.36	30,946,147.32	5,282,425.41
加权平均基金份额本期利润	0.1040	0.1347	0.0086
本期基金份额净值增长率	8.51%	15.62%	0.47%
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	0.1628	0.1526	0.0740
期末基金资产净值	1,001,008,293.60	102,409,525.82	589,716,599.86
期末基金份额净值	1.145	1.120	1.074

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。

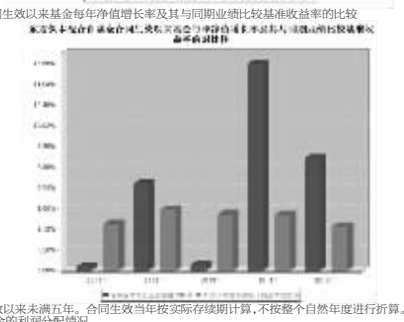
3.2 基金净值表现

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

3.1.1 期间数据和指标		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	1.87%	0.08%	0.71%	0.01%	1.16%		0.07%
过去六个月	2.47%	0.09%	1.50%	0.01%	0.97%		0.08%
过去一年	8.51%	0.22%	3.36%	0.01%	5.16%		0.22%
过去三年	26.04%	0.22%	11.84%	0.01%	14.20%		0.21%
过去五年	34.74%	0.18%	19.97%	0.01%	14.77%		0.17%
自基金合同生效起至今	34.74%	0.18%	19.97%	0.01%	14.77%		0.17%

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

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	61,206,665.72	16.17	61,206,681.89	
2014	-	-	-	-	
2013	-	-	-	-	
合计	0.7000	61,206,665.72	16.17	61,206,681.89	

§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		
张岗(先生)	本基金基金经理、权益投资部总经理、投资决策委员会委员	2011年4月14日	2015年4月30日	13年	西北大学经济管理学院经济学博士,13年证券从业经历。曾任建新证券股份公司行业分析部经理、天治基金管理有限公司研究员、基金经理、投资副总监、建信基金管理有限公司专户投资部总监助理、副总监。2010年4月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任权益投资部总经理、权益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、东方保本混合型开放式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、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
姚航(女士)	本基金基金经理	2013年9月25日	-	11年	中国人民大学工商管理硕士,11年证券从业经历。曾就职于嘉实基金管理有限公司投资部,2010年10月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任股票投资部总经理助理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理、东方保本混合型开放式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。东方新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
王然(女士)	本基金基金经理	2015年4月30日	-	7年	北京交通大学产业经济学硕士,7年证券从业经历。曾任易基基金交通运输、纺织服装、轻工制造行业研究员。2010年4月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任权益投资部交通运输、纺织服装、商业零售行业研究员。东方策略成长股票型开放式证券投资基金(于2015年8月7日更名为东方策略成长混合型开放式证券投资基金)基金经理。东方金元宝货币市场基金基金经理。

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、《东方保本混合型开放式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年是牛熊转换的一年,上半年在转型升级等政策驱动下,上证综指由3200点上涨至5200点,而6月在一系列去杠杆和外围市场影响下,下半年上证综指开始回落,全年呈现"倒V"型走势。创业板指则呈现了"M型"走势,全年上涨了85%,明显强于上证综指。

根据wind的数据统计,传媒、通信、计算机、轻工、服装是2015年涨幅最大的五个板块,涨幅均超过120%;涨幅最小的板块是银行,全年上涨了6%。概念板块中,互联网营销、IP变现、虚拟现实是涨幅最大的三个板块,涨幅超过220%;而涨幅最小的板块则是政策持续低于预期的一带一路、国企改革、自贸区板块,平均涨幅仅有20%。

2015年初,本基金改变投资策略为打新基金,在保持较低仓位获得绝对收益的基础上,基金参与新股IPO的申购,并且在7月份IPO暂停以前获得较好的收益率。第三季度,市场风险集中释放、IPO暂停给本基金运作带来的不小的困难,但本基金降低股票配置仓位,最大限度的减少了回撤风险,并在第四季度市场反弹和IPO重启过程中获得了较好的收益。2015年,债券收益率下行幅度较大,十年利率债下行近100BP。具体而言,1-2月债市整体延续慢牛;3月,受地方债务置换等供给冲击,收益率反弹,直到央行4月降准,市场情绪有所缓和;随着7月股灾发生、8月宽松货币政策再启,资金不断涌入债市,带动债券收益率大幅下行,信用利差压缩至低位;年底机构配置热情较高,带动债券收益率快速下行。

报告期内,本基金债券方面以持有中短久期信用债为主,获得稳定票息,同时配合利率债波段获取一定资本利得。

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8.51%,业绩比较基准收益率为3.36%,高于业绩比较基准5.15%。

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2016年,经济仍有下行风险,企业盈利仍不容乐观,供给侧出清或给周期类行业提供反弹的机会。流动性层面,2016年仍有降准空间,但较2015年的边际改应递减。政策层面,2016年是政策继续托底、改革持续攻坚的一年,但政策的施展空间和力度是影响市场心态的重要因素之一。整体上看,2016年的风险偏好一方面看改革预期,另一方面看流动性和人民币汇率,应调整心态、降低预期收益率,兼顾转型、改革持续落地标的和高股息率低估值标的。

具体而言,宏观经济层面,2016年经济企稳动力不足,供给侧收缩或存在机会。2015年第三季度GDP增长6.9%,为近六年内首次破7%,预计2016年政府或将继续下调经济增长目标到6.5%至6.8%。预计2016年制造业、房地产投资持续下行,基建投资稳定于低位,居民消费低位徘徊,供给侧去产能和去库存的出清过程将贯穿于2016年。整体来看,预计2016年宏观经济增长仍难企稳,政策层面的脉冲刺激不会改变供给侧调整下经济震荡下探的趋势。

政策面看,经济低迷,企业债务负担重,需要通过宽松的货币政策予以支持;另一方面,人民币贬值压力仍然存在,2016年资金外流趋势或将形成,汇率风险或将是市场波动的最大风险之一,国内降息降准虽然存在一定空间,但空间不大,较2015年的边际效应递减,资金驱动市场上行的预期将落空。

2016年是中国经济"破旧立新"的关键之年,除去过剩产能,挖掘新经济潜力是未来股权投资的关键。展望2016年一季度,国内宏观经济仍难大幅回升、工业生产景气度仍偏低,两会之前存在供给侧改革和创新经济的政策预期,市场更多的从预期的角度配置前期涨幅较少、估值较低的品种,整体预期收益率中枢下移。我们认为一季度在供给侧改革的背景下,煤炭、钢铁、有色等品种存在反弹机会。而超跌成长股也存在反弹的机会,业绩稳健增长的个股可能成为市场中受追捧的标的。

对于2016年债券市场而言,在收益率相对较低、宏观扰动因素较多的情况下,机构心态可能较为谨慎,预计债券收益率将在震荡中下行,波段交易机会较多。汇率波动、地方债供给冲击、经济数据超预期、股市企稳等事件都可能带动债券收益率反弹。利率债、交易活跃且利率相对较高的地方债、高等级信用债、优质ABS等类固定收益品种仍具有较好的投资价值。

未来,本基金将继续以持有中短久期、高收益的信用债为主,以获得稳定的票息收入,实现绝对收益。同时择机参与利率债波段操作。

感谢基金持有人对本基金的信任和支持,我们将本着勤勉尽责的精神,秉承"诚信是基、回报为金"的原则,力争获取与基金持有人风险特征一致的稳健回报。

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202,152,829.74元,实际分配金额61,206,681.89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《东方保本混合型开放式证券投资基金基金合同》与《东方保本混合型开放式证券投资基金托管协议》,自2011年4月14日起托管东方保本混合型开放式证券投资基金(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61,206,681.89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:东方保本混合型开放式证券投资基金

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	上年度末 2014年12月31日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	11,596,212.19	476,189.89
结算备付金		5,680,305.66	502,420.97
存出保证金		284,989.06	27,925.69
交易性金融资产	7.4.7.2	874,160,325.22	105,802,656.04
其中:股票投资		36,392,492.22	17,676,060.30
基金投资		-	-
债券投资		838,157,833.00	88,126,605.74
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	100,000,270.00	-
应收证券清算款		120,514,217.57	299,937.26
应收利息	7.4.7.5	11,451,122.98	3,280,864.39
应收股利		-	-
应收申购款		50,422.69	99,148.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,124,127,865.39	110,489,152.32
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		120,000,000.00	6,499,991.90
应付证券清算款		-	21,480.41
应付赎回款		73,510.96	438,170.70
应付管理人报酬		1,138,753.84	112,998.83
应付托管费		175,192.90	17,384.42
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	681,461.80	25,681.53
应交税费		-	-
应付利息		7,397.60	136.91
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,043,254.69	964,481.80
负债合计		123,119,571.79	8,080,326.50
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	788,353,700.16	82,490,845.75
未分配利润	7.4.7.10	212,654,593.44	19,918,480.07
所有者权益合计		1,001,008,293.60	102,409,525.82
负债和所有者权益总计		1,124,127,865.39	110,489,152.32

注:①报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.145元,基金份额总额874,019,983.27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:东方保本混合型开放式证券投资基金

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		230,361,982.61	35,579,417.31
1.利息收入		62,880,472.27	12,516,204.60
其中:存款利息收入	7.4.7.11	17,351,586.90	172,193.66
债券利息收入		31,841,964.69	10,122,288.96
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		13,686,920.68	2,221,721.98
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		134,772,013.97	10,614,127.76
其中:股票投资收益	7.4.7.12	135,579,006.73	10,436,967.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13.1	-1,119,988.54	-281,498.71
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	312,996.78	206,499.06
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	1,612,284.28	12,096,817.24
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	31,097,212.09	352,287.69
减:二.费用		38,446,781.25	4,633,269.99
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	27,629,791.41	3,133,078.02
2. 托管费	7.4.10.2.2	4,235,352.54	482,011.91
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,176,570.82	239,490.50
5. 利息支出		5,047,666.48	362,289.56
其中:卖出回购金融资产支出		5,047,666.48	362,289.56
6. 其他费用	7.4.7.20	357,400.00	416,400.00
三.利润总额(亏损总额以"-"号填列)		191,915,201.36	30,946,147.32
减:所得税费用		-	-
四.净利润(净亏损以"-"号填列)		191,915,201.36	30,946,147.32

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:东方保本混合型开放式证券投资基金

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)	82,490,845.75	19,918,680.07	102,409,525.82
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	191,915,201.36	191,915,201.36
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)	705,862,854.41	62,027,393.90	767,890,248.31
其中:1.基金申购款	6,043,651,781.48	1,746,375,598.87	7,790,027,768.35
2.基金赎回款	-5,337,788,927.07	-1,684,348,592.97	-7,022,137,520.04
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)	-	-61,206,681.89	-61,206,681.89
五.期末所有者权益(基金净值)	788,353,700.16	212,654,593.44	1,001,008,293.60

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)	549,081,530.51	40,635,069.35	589,716,599.86
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	30,946,147.32	30,946,147.32
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)	-466,590,684.76	-51,662,536.60	-518,253,221.36
其中:1.基金申购款	4,375,081.27	635,158.71	4,970,239.98
2.基金赎回款	-470,925,766.03	-52,297,695.31	-523,223,461.34
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)	82,490,845.75	19,918,680.07	102,409,525.82

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:

_____孙晓伟_____ _____秦熠群_____ _____张智梅____

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

东方保本混合型开放式证券投资基金(以下简称"本基金")根据2011年2月23日中国证监会《关于核准东方保本混合型开放式证券投资基金募集的批复》(证监许可[2011]270号)和《关于募集东方保本混合型开放式证券投资基金募集时间安排的确认函》(基金部函[2011]135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《东方保本混合型开放式证券投资基金基金合同》自2011年3月15日至2011年4月11日公开募集设立。本基金为混合型开放式基金,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,868,373,217.98元人民币,业经立信会计师事务所有限公司"信会师报字(2011)第81282号"验资报告验证。经向中国证监会备案,《东方保本混合型开放式证券投资基金基金合同》于2011年4月14日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,868,943,721.33份基金单位,其中认购资金利息折合570,503.35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《东方保本混合型开放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,包括国内依法公开发行的债券、A股股票(包含中小板和创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、货币市场工具、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。

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益,暂不缴纳营业税和企业所得税。