

基金管理人:东方基金管理有限责任公司  
基金托管人:中国民生银行股份有限公司  
报告日期:二〇一五年十月二十六日  
重要提示  
基金管理人的董事、监事、经理及其他高级管理人员在履行勤勉尽责义务后,对本报告的内容真实性、准确性、完整性承担个别及连带责任。  
本基金投资于境外证券市场,因此本基金的净值可能受到汇率波动的影响。投资者应当充分了解并承受该风险。  
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。

基金合同自二〇一〇年九月一日起至二〇一〇年九月一日止。

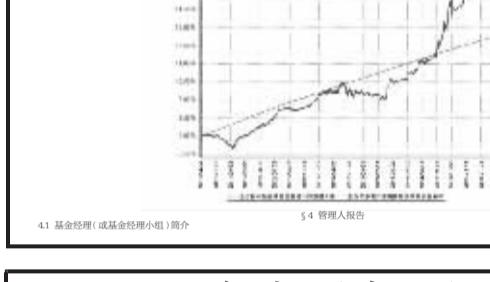
基金简称		东方保本混合型开放式证券投资基金	
基金代码	400013	交易代码	400013
前端交易代码	400013	后端交易代码	400013
基金运作方式	契约型开放式	基金合同生效日	2011年4月14日
报告期末基金份额总额	618,396,680.89份	投资目标	本基金通过对保本资产与收益资产的动态配置和有效的组合管理,在保本周期到期时,为本基金申购期内购入并持有到期的基金份额提供本金保障。
投资策略	在保本周期内,本基金将通过保本资产与收益资产的动态配置和有效的组合管理,在保本周期到期时,为本基金申购期内购入并持有到期的基金份额提供本金保障。	业绩比较基准	在大类资产配置方面,本基金运用“四维”动态资产配置机制,即资产配置、资产类别选择、资产配置比例和资产配置时机,来实现本基金的投资目标。
投资策略	在保本资产配置方面,以保本资产的安全性为目标,通过选择具有相关属性的保本资产,规避股票、商品期货等高风险,以确保本基金的定期收益。	业绩比较基准	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,在保本周期到期时,为本基金申购期内购入并持有到期的基金份额提供本金保障。
业绩比较基准	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,在保本周期到期时,为本基金申购期内购入并持有到期的基金份额提供本金保障。	风险收益特征	本基金是保本型的混合基金产品,属于证券投资基金中的低风险品种。
基金管理人	东方基金管理有限责任公司	基金托管人	中国民生银行股份有限公司
基金代销机构	渤海银行股份有限公司	基金代销机构	渤海银行股份有限公司
基金销售网点	渤海银行股份有限公司	基金销售网点	渤海银行股份有限公司
基金合同终止日	无	基金合同终止日	无
5.2 基金产品概况	单位:人民币元		
基金简称	东方保本混合	报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)	-
1.本期已实现收益	26,429,906.79	2.本期利润	16,244,026.11
3.期初至报告期基金期间的利润总额	10,096.00	4.期末基金资产净值	618,334,731.96
5.期末基金资产净值	1,193		

注:1.基金三季报收益金额为期末基金本期利润减去费用,投资收益和其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。  
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,计算费用影响真实收益请扣费后进行比较。

3.2 报告期基金份额持有人结构及与同期行业基金平均数的比较

阶段 净值增长率(1) 业绩比较基准收益率(2) 业绩比较基准收益率(3) 标准差(4)  
过去三个月 0.50% 0.10% 0.70% 0.00% -0.20% 0.10%

3.2.2 基金合同生效以来基金净值增长率变化图



4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名 职务 说明 任期日期 离任日期

姚帆(女士) 本基金基金经理,权责划分:本基金的基金经理,同时担任本基金的基金经理,负责本基金的日常投资管理工作。 2013年9月26日 -

王然(女士) 本基金基金经理,权责划分:本基金的基金经理,同时担任本基金的基金经理,负责本基金的日常投资管理工作。 2015年4月30日 -

徐航(女士) 本基金基金经理,权责划分:本基金的基金经理,同时担任本基金的基金经理,负责本基金的日常投资管理工作。 2013年9月26日 -

4.2 管理人报告

报告期内本基金运作总体情况正常,未发现本基金存在违反法律法规及基金合同规定的情况。

本基金在报告期内严格遵守基金合同的规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金在报告期内严格遵守基金合同的规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为。