

东方稳健回报债券型证券投资基金

[2015] 第四季度报告

基金管理人:东方基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年一月二十日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、经理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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年1月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告和管理人报告等项内容，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。

基金过往业绩并不代表基金未来表现，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。

本基金期间自2015年1月1日起至2015年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 东方稳健回报债券

基金主代码 400009

交易代码 400009

前端交易代码 400009

后端交易代码 400009

基金合同生效日 2007年1月10日

报告期末基金份额总额 1,179,913,209.02份

投资目标 在控制风险和确保资产流动性的前提下，追求较高的回报率，力争实现资产的长期增值。

投资策略 本基金在资产配置的基础上，根据宏观经济、资本市场的变化情况，综合考虑低波段投资品种的预期收益、风险、流动性等因素，通过资产配置和择时操作，力求在控制风险的前提下，实现资产的长期增值。

业绩比较基准 95%的业绩比较基准=业绩比较基准收益率+0.5%×一年期定期存款利率

报告期末基金资产净值 2015年12月31日，本基金的净值增长率为1.9%，业绩比较基准收益率为2.37%，低于业绩比较基准0.47%。

§ 3 主要财务指标

主要财务指标 单位:人民币元

报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)

1.本期已实现收益 22,041,990.30

2.本期利润 20,635,028.61

3.期末可供分配基金份额利润 0.2010

4.期末基金份额净值 1,392,047,105.30

5.期末基金资产净值 1,190.30

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)和扣除相关费用后的余额，本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金的业绩比较基准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将低于所列数值。

3.基金的净值表现

4.报告期末基金份额持有人数为200人或基金份额净值低于5000万元的情形。

5.报告期末基金份额持有人数为10人或基金份额净值低于0.1元的情形。

6.报告期末基金份额持有人数为1人或基金份额净值低于0.01元的情形。

7.报告期末基金份额持有人数为0人或基金份额净值低于0.001元的情形。

8.报告期末基金份额持有人数为0人或基金份额净值低于0.0001元的情形。

9.报告期末基金份额持有人数为0人或基金份额净值低于0.00001元的情形。

3.22 日基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%)

过去三个月 0.00% 2.27% -0.27%

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

2.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.1 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 ① 净值增长(%) ② 业绩比较基准收益率(%) ③ 业绩比较基准收益率差额(%)

过去三个月 1.90% 2.37% -0.07%

3.2.2 日基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

2.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.3 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

2.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.4 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

2.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.5 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

2.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.6 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

2.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.7 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

2.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.8 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

2.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.9 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

2.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.10 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

2.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.11 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

2.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.12 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

2.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.13 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

2.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.14 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

2.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.15 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

2.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.16 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

2.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.17 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

2.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.18 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

2.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.19 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

2.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.20 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

2.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.21 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

2.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.22 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

2.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.23 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

2.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.24 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

2.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.25 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

2.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.26 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

2.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.27 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

2.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.28 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

2.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.29 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

2.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.30 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

2.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.31 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

2.本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.32 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较