东方保本混合型开放式证券投资基金 2016 年第 1 季度报告

2016年3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

报告送出日期:二〇一六年四月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 4 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	东方保本混合			
基金主代码	400013			
交易代码	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				
报告期末基金份额总额	E基金份额总额 475, 259, 306. 66 份			
	本基金通过保本资产与收益资产的动态配置和有效			
+n ½ = 1+=:	的组合管理,在保本周期到期时,为保本周期内认购			
投资目标 	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。			
	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,来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。即通			
 投资策略	过持有相当数量的剩余期限小于或等于保本周期的			
汉 贞東峪	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。			
	本基金以三年期银行定期存款税后收益率作为本基			
业绩比较基准	金的业绩比较基准。			
	本基金为保本混合型基金产品,力争在保本周期到期			

	日保障保本金额的安全。在目前国内金融市场环境
	下,银行定期存款可以近似理解为保本定息产品。本
	基金以三年期银行定期存款税后收益率作为业绩比
	较基准,能够帮助投资者界定本基金的风险收益特
	征,并反映投资目标。
	如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能
	为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上
	出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时,本基
	金管理人可以在与托管人协商一致,报中国证监会备
	案后变更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。
可及此类性红	本基金是保本混合型的基金产品,属于证券投资基金
风险收益特征	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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
基金保证人	瀚华担保股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年1月1日 - 2016年3月31日)
1. 本期已实现收益	8, 286, 888. 83
2. 本期利润	4, 960, 762. 16
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 0081
4. 期末基金资产净值	550, 422, 214. 30
5. 期末基金份额净值	1.158

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所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。

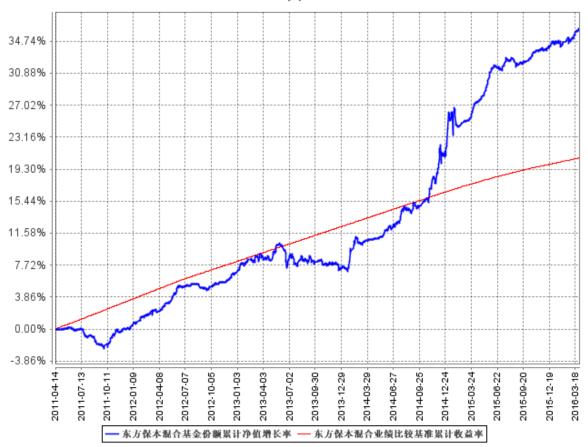
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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. 14%	0. 14%	0. 69%	0.01%	0. 45%	0. 13%

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

东方保本混合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



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

41L F7	职务	任本基金的基金		证券从业年限	说明
姓名	W.ガ	任职日期	离任日期	正分 <u>外</u> 业+水	1/L 1/J
姚航(女士)	本基金基金经理	2013年9月25日	内	12 年	中国人民大学工商 管理硕士,12年证 券从业经历。曾就 职于嘉实基金管理 有限公司运营部。 2010年10月加盟 东方基金管理有限 责任公司,曾任债
					券交易员、东方金

及 本基金基金 2015年4月 130日 28年 28年 28年 2015年4月 30日 28年 28年 28年 2015年4月 30日 28年	投资基金基金经理助理、东方金型证券投资基金基金经理助理、东方温温金型证券投资基金在多金账投资基金在基金账投资基金基金经理理,现在市场企业投资基金经理工务投资方律是金额灵活投资方况。在基金是现代资本是是金额,是一个工程,在全型证券投资方式。在基金是工作,是一个工程,是一个一个一个工程,是一个一个工程,是一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个					账簿货币市场证券
助理、东方多策略 灵活配置混合型经经理,预有市场全处线资基金基金处理,现在东方金数。等货币市场金经理、实方企业经验。 在本程设置基金经理,现在本程设施,在一个工厂工厂,在一个工厂工厂,在一个工厂工厂,在一个工厂工厂,在一个工厂工厂,在一个工厂工厂,在一个工厂工厂,在一个工厂工厂,在一个工厂工厂,工厂工厂工厂,工厂工厂工厂,工厂工厂工厂工厂,在一个工厂工厂,在一个工厂工厂工厂,在一个工厂工厂,工厂工厂工厂工厂,在一个工厂工厂工厂工厂工工厂工厂工厂工厂工厂工厂工厂工厂工厂工厂工厂工厂工工厂工厂工工工工	助理配置混合型证券投资重金基金聚等度基金基金聚等度基金基金聚等度基金基金聚等度基金基金聚等度基金基金聚为保险基金基金的经验,有一个工作,在一个工作,是一个工作,一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,一个工作,是一个一个工作,是一个工作,一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个一个工作,是一个一个工作,是一个工作,是一个一个工作,是一个工作,是一个一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个一个工作,一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,一个一个工作,一个工作,一个一个工作,一个一					
灵活配置混合型经理,	是活致基金基金经理,货币市场正券投资基金基金经理,货币市场正券投资基金基金保存方金型工程。					
券投资基金基金经理,现任东方金账等货基金基金经理,现任东方金账等货基金基金经理、东方保本基金经理、东方保本型开放式证券理、置置混量金经更满的交基金基金是现代。 电影子投资基金基金 经理,不为企业。 是一个人,我们是一个一个人,我们不是一个人,我们是一个人,我们是一个人,我们是一个人,我们是一个人,我们是一个人,我们还是一个人,我们是一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个	券投资基金基金金 理,现任东方金账 资 医金基金经理,现在新金经理,现在新金经理,东方保本混合型证券投资基金基金经理,东方保本混合型证券投资基金经理,东方企业实现,在 置 是 金经 理 电					
理,现任东方金账簿货币市场证券投资基金基金经型、东方保本混合型开放式证券投资基金基金经型和大家方保本混合型工产型的基金基金经理和管理。在基金基金经理和企业,在企业的企业,在企业的企业,在企业的企业,在企业的企业,在企业的企业,在企业的企业的企业,在企业的企业的企业,在企业的企业的企业的企业的企业的企业的企业的企业的企业的企业的企业的企业的企业的企	理,现任东方金账 簿货币基金经理 资基本是合型开放交通基金经理活致基金 基金经验,东京混查基金经验,在型量上,在型量上,在型量上,在型量上。 整理不是基金经验,在型量上,在型量上,在型量上,在型量上,在型量上,在型量上,在型量上,在型量上					
等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、东方保本混合型证券投资基金基金经灵活配登基金经理、新置混合型证券投东方混合金全经理、配置基金基金经货工产业。	等货。基金基金经理理、东方保本混合型理、东方保本混合型理、东方保本混合型理、东方保本混合型理、东方风景等。 医型 证券投资基金基金经现金额 医型 证券投资 基金基金 经理 正务 经理 工务 经 电					
受基金基金经理、东方保本混合型开放式证券投资基金基金经理、东方保本混合型形券投资基金基金经理、东方高合型证券投资基金基金经理、东方高合型证券投资表面。路灵托配置混合型企业券投资方金证资金是理、本定金货币中、基金基金经理、市场基金基金经理。北京交通大学产业经济学硕士,8年。	资基金基金经理、东方保产者的					
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、东方置混合型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、东方金证通货币市场基金建工、东方金证通货币市场基金经理、东方金证通经平产业经济发展基金经理、东方金证通经平产业经济,等价任益大量,等价级股基金交通运输、纺织服装、较工制造行业研究员。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	东方保本港投资基金基金经理和					
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、东方新思路灵活配置混合型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、东方金证通货币市场基金基金经理、东方金证通货币市场基金基金经理、东方金证通货币市场基金基金经理、东方金证通货币中,全经费大学产业经济学硕士,8 曾任益权至两,曾任在公司,曾任权益投资部交通运输、纺织服装、商业零售行业研究	放式证券投资基金基金经理和 基金经理和 医					
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、东方融高家保本混合型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。 北京交通大学产业经济学硕士,8年证券从业经历,曾任益民基金经理。 化第字顺证为风基金管理方行业经历,曾任益民基金交通运输、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	基金经理、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金基理、东方通过证券投资基金基金经理、东方企工证券投资基金基本企会经理、东方金型设置,在一个工作,在一个工作,在一个工作,在一个工作,在一个工作,在一个工作,在一个工作,在一个工作,在一个工作,在一个工作,是一个工作,也可以工作,是一个工作,是一个工作,也是一个工作,一个工作,也是一个工作,一个工作,也是一个工作,一个工作,也是一个工作,也是一个工作,一个工作,工作,也可以一个工作,也是一个工作,工作,也可以一个工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以一个一个工作,也可以一个工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以,也可以,也可以工作,也可以工作,也可以一个工作,也可以工作,也可以一个工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,					
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、东方金元宝货品市场基金基金经理、东方金元宝货币市场基金基金经理。 北京交通大学产业经济学硕士,8年证券从业经历,曾任益民基金交通运输、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	策略灵活配置混合基金经理、东方新型证券投资基金基金经理、东方高型证券投资基金基金经理、东方高型证券投资基金基金经理。和全型证券投资基金基金经理市场基金基金经理市场基金基金经理市场基金基金经理。北京交通大。8年曾任益民基金经产进入,8年曾任益民基金交交通运输、纺织服装、轻工制造行业研知思东方基金司通运行业研究员。2010年4月加盟东方基金司,直接任政治投资部交通运输、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(甲名为东方策略成长股票型开放式证券投资基金(甲名为东方策略成长为东方策略成长为东方策略成长为东方策略成长为东方策略成长为东方策略成长为东方策略成长为东方策略成长为安西城长					
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、东方额保本混合型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。东方金证通货币市场基金基金经理。北京交通大学产业经济学硕士,8年证券从业经历,曾任益民基金交通运输、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	型证券投资基金基金经理、东方新思路灵活配置金基金经理、东方高型金基金经理、东方高型金基金经理、东方高型金基金经理、东方最高家投资基金基金经理、东方金基基金经理。市场、基金基金经理。市场、基金基金经理。北京交通大,8 年 证券从业经历通运输、约设积股业研发,则是企业的企业。2015年4月即最后在公司,曾任私品投资部交通运输。约约积度,有时,是有时,是有时,是有时,是有时,是有时,是有时,是有时,是有时,是有时,					
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、东方赢家保本混合型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、东方金证通货币市场基金基金经理。 北京交通大学产业经济学硕士,8年证券从业经历,曾任益民基金交通运输、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	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、东方高型证券投资基金基金经理市市场基金基金经理市市场基金基金经理市市场基金基金经理市市场基金基金经理市市场基金基金经理市市场基金基金经理市市场基金基金经理。 北京交通大学。8年 曾任益民基金交通、给领积业全经济从业经交通、统统积积业经营,增压银责任公司。2010年4月理银责任公司。2010年4月理银责任公司。2010年4月理银责任公司。第一个专项,是一个一个一个专项,是一个一个专项,是一个一个一个一个专项,是一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个					
路灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方赢家保本混合型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、东方金证通货币市场基金基金经理。 北京交通大学产业经济学硕士,8年证券从业经历,曾任益民基金交通运输、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	路灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方赢水资基金基金经理、东方赢水资基金基金经理、东方金证或货币市场基金基金经理市市场基金基金经理产单。					
证券投资基金基金经理、东方赢家保本混合型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、东方金证通货币市场基金基金经理。 北京交通大学产业经济学硕士,8年证券从业经历,曾任益民基金交通运输、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	正券投资基金基金经理、东方赢家保本混合型证券投资基金基金经理、东方赢家保本混合型证券投资基金基金经理市场基金基金经理市场基金基金经理。北京交通证通货币市场基金基金经理。 北京交通证是另一个 经济外业经历,通监统行业研究员。2010年4月细盟东方基金管电压,通过分量。2010年4月加盟东方基金管。 电压力					
经理、东方赢家保本混合型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、东方金证通货币市场基金基金经理。 北京交通大学产业经济学硕士,8年证券从业经历,曾任益民基金交通运输、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	经理、东方赢家保本混合型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。					
本混合型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、东方金证通货币市场基金基金经理。 北京交通大学产业经济学硕士,8年证券从业经历,曾任益民基金交通运输、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产,曾任权益投资部交通运产,曾任权益投资部交通运产,曾任权益投资部交通运产,曾任权益投资部交通运产,曾任权益投资部交通运产,曾任权益投资部交通运产,曾任权益投资部交通运产,曾任权益投资部交通运产,曾任权益投资部交通运产,曾任权益投资部交通运产,曾任权益投资部交通运产,曾任权益投资部交通运产,曾任权益投资部交通运产,曾任权益投资部交通运产,曾任权益投资部交通运产,曾任权益投资部交通运产,曾任权益投资部交通运产,自由,其实是是一个专项,是是一个专项,是是一个专项,但是是一个专项,是一个专项,是一个一个专项,是一个一个专项,是一个一个专项,是一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个	本混合型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。 北京交通大学产业经济学硕士,8年证券从业经历,曾任益民基金交通运输、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化权益投资部交通运输、纺织服装、剪通运行业研究员,东方策略成长规则要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)基金经理助理、东方策略成长					
基金基金经理、东 方金元宝货币市场 基金基金经理、东 方金证通货币市场 基金基金经理。 北京交通大学产业 经济学硕士,8年 证券从业经历,曾 任益民基金交通运 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	基金基金经理、东方金元宝货币市场基金基金经理。 北京交通大学产业经济学硕士,8年 证券从业经历,曾任益民基金交通运输、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。					
方金元宝货币市场 基金基金经理、东 方金证通货币市场 基金基金经理。 北京交通大学产业 经济学硕士,8年 证券从业经历,曾 任益民基金交通运输、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	正然 (女 士) 2015年4月 七					
基金基金经理、东方金证通货币市场 基金基金经理。 北京交通大学产业经济学硕士,8年证券从业经历,曾任益民基金交通运输、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	基金基金经理、东方金证通货币市场基金基金经理。 北京交通大学产业经济学硕士,8年证券从业经历,曾任益民基金交通运输、纺织服装、轻工制造行业研究员。2010年4月周,2010年4月积益投资部交通运输、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)基金经理助理、东方策略成长混合					· ·
方金证通货币市场 基金基金经理。 北京交通大学产业 经济学硕士,8年 证券从业经历,曾 任益民基金交通运 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	方金证通货币市场基金基金经理。 北京交通大学产业经济学硕士,8年证券从业经历,自任益民基金交通运输、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)基金经理助理、东方策略成长					
基金基金经理。 北京交通大学产业 经济学硕士,8年 证券从业经历,曾 任益民基金交通运 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	基金基金经理。 北京交通大学产业经济学硕士,8年证券从业经历,曾任益民基金交通运输、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股票型开放式证券投资基金)基金经理助理、东方策略成长					·
北京交通大学产业 经济学硕士,8 年 证券从业经历,曾 任益民基金交通运输、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	王然 (女士) 本基金基金 2015年4月					
	至济学硕士,8年证券从业经历,曾任益民基金交通运输、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股票型开放式证券投资基金)基金经理助理、东方策略成长					
正然(女 本基金基金 2015年4月 士) 经理 2015年4月 30日 - 8年 证券从业经历,曾任益民基金交通运输、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	王然(女 本基金基金 经理 2015年4月 30日 - 8年					
王然(女 本基金基金 と 2015年4月 - 8年 日益民基金交通运输、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	王然(女 本基金基金 经理 2015年4月 30日 - 8年 任益民基金交通运输、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)基金经理助理、东方策略成长					
 編、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工然(女本基金基金 经理 30日 - 8年	王然(女 本基金基金 全理 2015年4月 30日 - 8年					
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至工然(女本基金基金 2015年4月 4	王然(女 士) 本基金基金 2015年4月 30日 - 8年					
王然(女 本基金基金 2015年4月 - 8年 銀床方基金管理有限责任公司,曾任权益投资部交通运权益投资部交通运输、纺织服装、商业零售行业研究	王然(女 士) 本基金基金 经理 2015年4月 30日 - 8年 8年 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)基金经理助理、东方策略成长					
盟东方基金管理有限责任公司,曾任权益投资部交通运 王然(女 本基金基金 2015年4月	王然(女士) 本基金基金 经理 2015年4月 30日 - 8年 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)基金经理助理、东方策略成长					
王然(女 本基金基金 经理 2015年4月 30日 - 8年 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	王然(女士) 本基金基金 经理 2015年4月 30日 - 8年 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)基金经理助理、东方策略成长					
王然 (女 本基金基金 2015年4月 - 8年 权益投资部交通运输、纺织服装、商业零售行业研究	王然 (女 本基金基金 2015年4月 - 8年 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)基金经理助理、东方策略成长					
王然(女 本基金基金 2015年4月 8年 输、纺织服装、商业零售行业研究	王然(女 本基金基金 2015年4月 - 8年 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)基金经理助理、东方策略成长					
士) 经理 30日 8年 业零售行业研究	士) 经理 30日 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)基金经理助理、东方策略成长					
士) 经埋 30日 业零售行业研究	型等售行业研究员,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)基金经理助理、东方策略成长			_	8年	
	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)基金经理助 理、东方策略成长	士) 经理	30 日		0 1	
	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)基金经理助 理、东方策略成长					员,东方策略成长
股票型开放式证券	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)基金经理助 理、东方策略成长					股票型开放式证券
投资基金(于 2015	东方策略成长混合型开放式证券投资基金)基金经理助理、东方策略成长					投资基金 (于 2015
年8月7日更名为	型开放式证券投资基金)基金经理助理、东方策略成长					年8月7日更名为
东方策略成长混合	基金)基金经理助理、东方策略成长					东方策略成长混合
型开放式证券投资	理、东方策略成长					型开放式证券投资
基金)基金经理助						基金)基金经理助
理、东方策略成长	股票型开放式证券					理、东方策略成长
股票型开放式证券						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,
		现任东方保本混合
		型开放式证券投资
		基金基金经理、东
		方策略成长混合型
		开放式证券投资基
		金基金经理、东方
		新兴成长混合型证
		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、东方赢家保本
		混合型证券投资基
		金基金经理、东方
		荣家保本混合型证
		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

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作基金资产,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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。

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。

4.3.2 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。

本报告期内,未出现涉及本基金的交易所公开竞价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 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,人民币汇率的波动情况成为影响市场的主要因素之一。最明显的就是元旦前后人 民币快速贬值从而给市场形成了加速资本外流的预期,导致了开年的暴跌;随后在央行采取一系 列稳定汇率政策和美联储推迟加息的背景下,市场对短期人民币贬值的负面预期逐渐减弱,从而 迎来了春节后的温和反弹行情。我们预计市场全年都将受到美联储加息节奏的影响。

政策面,政府对供给侧改革的支持力度较大,对煤炭、钢铁、有色、高污染行业的减产形成 促进作用,从而使行业内龙头企业的竞争优势进一步增强。在报告期内以上行业均有较好的市场 表现。长期来看,政府在总需求管理和供给侧改革之间谋求平衡,去产能、去库存难以一蹴而成, 经济仍面临调整压力。

另外,基本面改善、增收增利的行业受到投资者的青睐。2016年一季度,宏观经济边际小幅改善。具体来看,中采制造业景气指数回升至荣枯线以上、工业企业利润同比增速由负转正、房地产的火爆销售带动投资上行、基建开工带动经济小幅回升。猪价维持高位,对拉动CPI形成正面作用,同时带动了肉禽养殖和饲料行业的价格上涨。白酒行业经过近年来的行业洗礼,在2016年初出现了经销商订货积极、终端价格上涨的迹象,从而使白酒行业的盈利水平明显改善。

整体上看,报告期内,上证综指下跌 15.12%,深成指下跌 17.45%,创业板指下跌 17.53%。 根据 wind 的数据统计,报告期内,下跌幅度较小的行业包括建筑装饰、银行、建材、有色、食品 饮料、采掘、轻工、农业。另外,新能源汽车、无人驾驶、虚拟现实、互联网金融、借壳上市、 次新股等题材股轮番上涨,显示出春节后市场情绪的恢复和风险偏好的提升。

2016年一季度,债券市场收益率表现纠结、反复盘整,多空因素交织,机构心态较为谨慎。 一方面,债市配置力量强劲,机构配置压力不减;另一方面,1月信贷数据超预期、通胀温和上 行、经济边际回暖等利空因素频发。

报告期内,本基金股票方面跟随市场波动趋势,加大了仓位调整的力度,更加灵活的选择配置的行业。本基金在相对均衡的行业配置基础上,适时参与了供给侧改革、智能制造、次新股等标的的配置,同时针对基本面改善的行业如农业、白酒的优质公司也进行了配置,从而获取其业绩改善带来的收益。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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2016年1月1日起至2016年3月31日,本基金净值增长率为1.14%,业绩比较基准收益率为0.69%,高于业绩比较基准0.45%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 人或基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	34, 659, 966. 78	5. 40
	其中: 股票	34, 659, 966. 78	5. 40
2	基金投资	_	-
3	固定收益投资	380, 640, 637. 90	59. 25
	其中:债券	380, 640, 637. 90	59. 25
	资产支持证券		_
4	贵金属投资	1	
5	金融衍生品投资	-	_
6	买入返售金融资产	109, 000, 384. 50	16. 97
	其中: 买断式回购的买入返		_
	售金融资产		

7	银行存款和结算备付金合计	113, 297, 029. 44	17. 64
8	其他资产	4, 796, 850. 89	0. 75
9	合计	642, 394, 869. 51	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	1
В	采矿业	114, 020. 85	0.02
С	制造业	26, 971, 683. 12	4. 90
D	电力、热力、燃气及水生产和供 应业	-	I
Е	建筑业	-	1
F	批发和零售业	1, 969, 546. 24	0.36
G	交通运输、仓储和邮政业	5, 603, 200. 00	1. 02
Н	住宿和餐饮业	-	
Ι	信息传输、软件和信息技术服务 业	1, 516. 57	0.00
J	金融业	_	_
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	可商务服务业 -	
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	1
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
Р	教育	-	1
Q	卫生和社会工作		-
R	文化、体育和娱乐业	-	
S	综合	-	-
	合计	34, 659, 966. 78	6. 30

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比 例(%)
1	002548	金新农	360, 000	5, 997, 600. 00	1.09
2	002444	巨星科技	350, 000	5, 918, 500. 00	1.08
3	000089	深圳机场	680, 000	5, 603, 200. 00	1. 02

4	002456	欧菲光	200, 000	5, 308, 000. 00	0. 96
5	603898	好莱客	160, 000	4, 958, 400. 00	0. 90
6	002055	得润电子	150, 000	4, 788, 000. 00	0.87
7	600694	大商股份	50,000	1, 969, 000. 00	0. 36
8	601020	华钰矿业	4, 377	114, 020. 85	0.02
9	002747	埃斯顿	23	1, 183. 12	0.00
10	300431	暴风科技	11	1, 027. 84	0.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券		_
2	央行票据	ı	ı
3	金融债券	29, 986, 000. 00	5. 45
	其中: 政策性金融债	29, 986, 000. 00	5. 45
4	企业债券	187, 259, 067. 50	34. 02
5	企业短期融资券	130, 836, 000. 00	23. 77
6	中期票据	31, 029, 000. 00	5. 64
7	可转债 (可交换债)	1, 530, 570. 40	0. 28
8	同业存单	_	_
9	其他		_
10	合计	380, 640, 637. 90	69. 15

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	041560096	15 津临港 CP001	500, 000	50, 350, 000. 00	9. 15
2	011599920	15 桂建工 SCP006	400, 000	40, 284, 000. 00	7. 32
3	101551045	15 五矿股 MTN002	300, 000	31, 029, 000. 00	5. 64
4	1280097	12 河套水 务债	340, 000	30, 872, 000. 00	5. 61
5	127244	15 中关村	300,000	30, 762, 000. 00	5. 59

5.6 报告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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

- **5.7 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** 本基金本报告期末未持有贵金属。
- **5.8** 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权证投资明细本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内未发现存在被监管部门立案调查,或在报告编制目前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	205, 746. 48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	_
4	应收利息	4, 520, 114. 27
5	应收申购款	70, 990. 14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	_
9	合计	4, 796, 850. 89

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	110031	航信转债	753, 072. 00	0. 14

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公 允价值(元)	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情况说 明
1	603898	好莱客	4, 958, 400. 00	0.90	重大事项

§ 6 开放式基金份额变动

单位: 份

报告期期初基金份额总额	874, 019, 983. 27
报告期期间基金总申购份额	2, 787, 500. 43
减:报告期期间基金总赎回份额	401, 548, 177. 04
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"	
填列)	_
报告期期末基金份额总额	475, 259, 306. 66

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位: 份

报告期期初管理人持有的本基金份额	8, 888, 000. 00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	8, 888, 000. 00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	1.87

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 一、《东方保本混合型开放式证券投资基金基金合同》
- 二、《东方保本混合型开放式证券投资基金托管协议》

第 12 页 共 13 页

- 三、东方基金管理有限责任公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 四、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其临时公告

8.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

8.3 查阅方式

投资者可免费查阅,在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相 关公开披露的法律文件,投资者还可在本基金管理人网站(www.orient-fund.com)查阅。

> 东方基金管理有限责任公司 2016年4月21日